

# ÍNDICE FTSE4GOOD IBEX



FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME) han creado conjuntamente el índice FTSE4Good IBEX. El índice se compone de valores pertenecientes al índice IBEX 35® de BME y al índice FTSE Spain All Cap, que cumplen con los criterios de buena práctica en responsabilidad social corporativa (RSC). Estas compañías trabajan por la sostenibilidad medioambiental, el desarrollo de relaciones positivas con los grupos de interés de la compañía y el apoyo y preservación de los derechos humanos universales.

Los criterios de inclusión FTSE4Good representan los estándares generalmente aceptados de buenas prácticas en responsabilidad social corporativa, según evolucionan. Los criterios FTSE4Good se desarrollan a partir de un extenso proceso de consulta con el mercado. Una amplia gama de grupos de interés contribuyen a definir los criterios de admisión, entre ellos ONGs, organismos gubernamentales, consultores, académicos, la comunidad inversora y el sector empresarial.

## CUMPLIENDO LAS NECESIDADES DE LOS INVERSORES RESPONSABLES

El FTSE4Good IBEX tiene unos criterios de inclusión respecto de la responsabilidad corporativa que son totalmente transparentes y de dominio público. El índice es una herramienta que:

- Permite a los inversores responsables identificar e invertir en aquellas compañías que cumplen con los estándares globales de responsabilidad corporativa.
- Proporciona a los gestores de activos un indicador de inversión socialmente responsable (IRS) y una herramienta para el desarrollo de productos IRS.
- Puede usarse como solución para los gestores de fondos de pensiones públicas, a los que ahora la ley en España les exige que inviertan un 10% de los fondos de pensiones públicas en IRS.
- Permite a los inversores capitalizar los beneficios del buen gobierno corporativo (como ecoeficiencias, mejora de imagen de marca, etc.)
- Fomenta entre las compañías la idea de ser socialmente responsables.

## PROCESO DE SELECCIÓN DE COMPONENTES DEL INDICE FTSE4GOOD IBEX

	PROCESO DE SELECCIÓN DE COMPAÑÍAS			
	Universo Elegible	Sectores Excluidos	Criterios de Inclusión	Indices
Detalle	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Índice FTSE Spain All Cap (parte del FTSE Global Equity Index Series)</li> <li>• Índice IBEX 35®</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Compañías tabaqueras</li> <li>• Empresas que suministran servicios o piezas estratégicas o que fabrican sistemas de armamento nuclear</li> <li>• Fabricantes de sistemas de armamento completos</li> <li>• Propietarios u operadores de centrales de energía nuclear.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Medio ambiente                             <ul style="list-style-type: none"> <li>• Gestión medioambiental</li> <li>• Cambio climático</li> </ul> </li> <li>Social                             <ul style="list-style-type: none"> <li>• Derechos humanos y del trabajador</li> <li>• Estándares de trabajo en la cadena de abastecimiento</li> <li>• Rechazo ante la corrupción</li> </ul> </li> </ul>	Índice FTSE4Good IBEX

## EVOLUCIÓN DEL FTSE4GOOD IBEX A 5 AÑOS (EURO, SERIE DE PRECIOS)



Fuente: FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME) datos hasta 30 de septiembre de 2011

## CARACTERÍSTICAS

- Las compañías son asesoradas respecto a los criterios de inclusión de FTSE4Good IBEX por nuestro equipo de investigación, EIRIS (Ethical Investment Research Service) y su socio en España Ecodes (Fundación Ecología y Desarrollo).
- El índice es supervisado por un órgano de gobierno independiente, el FTSE4Good Policy Committee, compuesto por profesionales destacados en el área de inversión socialmente responsable y por expertos en los principios y criterios usados para determinar aquellas entidades medioambiental y socialmente responsables.
- A las compañías se les aplica un coeficiente flotante para asegurar que las acciones incluidas en el índice estén disponibles en el mercado.
- Se calcula tanto el índice de precios como un índice con dividendos.
- El índice se calcula de acuerdo a la clasificación ICB (Industry Classification Benchmark), un estándar global desarrollado en colaboración con Dow Jones Indexes
- El índice está diseñado para la creación de productos derivados, fondos referenciados y ETFs
- La liquidez de los valores se analiza para asegurar la replicabilidad del índice.
- Parte de los fondos obtenidos de licencias de uso FTSE4Good son destinados a UNICEF para ayudar a niños de todo el mundo

## UNIDAD DE INVERSIÓN RESPONSABLE

- La RIU (Responsible Investment Unit) de FTSE desarrolla un programa global de comunicación continua y diálogo con las empresas afectadas por la introducción de nuevos criterios para ayudarlas a entender qué cambios son necesarios y cuándo. El equipo también desarrolla una labor de ayuda y apoyo a las empresas mientras éstas se esfuerzan por seguir cumpliendo con los criterios del índice.

## BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES (BME)

- Bolsas y Mercados Españoles (BME) integra a las compañías que gestionan los sistemas de mercados financieros en España. Engloba el mercado de renta variable, renta fija, el mercado de derivados y el sistema de liquidación y compensación. BME es una compañía cotizada desde el 14 de julio de 2006, y forma parte del índice IBEX 35® desde el 2 de julio del 2007.

## TABLA DE RENTABILIDAD DEL ÍNDICE FTSE4GOOD IBEX (CON DIVIDENDOS)

	RENTABILIDAD						VOLATILIDAD				
	3M	6M	YTD	12M	3A	5A	3A	5A	Vol 1A	Vol3A	Vol5A
	(%)	(%)	(%)	(%)	(%)	(%)	(%RA)	(%RA)	(%RA)*	(%RA)**	(%RA)***
FTSE4GOOD IBEX (TR)	-17,4	-18,7	-10,9	-12,0	-8,2	-15,5	-2,8	-3,3	24,8	28,2	22,8
IBEX 35 CON DIVIDENDOS	-16,3	-16,4	-9,5	-13,7	-7,5	-15,7	-2,6	-3,4	26,0	29,0	22,6

\*Basada en rentabilidades diarias anualizadas usando 252 sesiones en el año

\*\*Basada en rentabilidades semanales anualizadas usando 52 semanas en el año

\*\*\*Basada en rentabilidades mensuales anualizadas

Fuente: FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME), datos del 30 de septiembre del 2011

## PRIMEROS 5 COMPONENTES DEL ÍNDICE FTSE4GOOD IBEX

Nombre	ICB Supersector	Capitalización (mil €)	Ponderación %
1 Telefonica	Telecomunicaciones	7.910	10,11
2 Banco Santander	Banca	7.316	9,35
3 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	Banca	6.425	8,21
4 Iberdrola	Utilities	5.464	6,98
5 Repsol	Petróleo y energía	4.686	5,99
<b>Total</b>		<b>31.800</b>	<b>40,65</b>

Fuente: FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME), datos del 30 de septiembre del 2011

## CLASIFICACIÓN INDUSTRIAL DEL ÍNDICE FTSE4GOOD IBEX

Cód. ICB	ICB Supersector	Nº Comp.	Capitalización (mil €)	Ponderación %
0500	Petróleo y energía	1	4.686	5,99
1300	Industria Química	-	-	-
1700	Recursos Básicos	2	3.029	3,87
2300	Construcción	5	8.008	10,24
2700	Bienes y Serv Industriales	2	1.627	2,08
3300	Automoviles y Componentes	-	-	-
3500	Alimentación y bebidas	1	89	0,11
3700	Bienes de consumo	-	-	-
4500	Salud	-	-	-
5300	Comercio Minorista	2	5.179	6,62
5500	Media	3	1.353	1,73
5700	Viajes y Ocio	2	3.294	4,21
6500	Telecomunicaciones	1	7.910	10,11
7500	Utilities	4	14.159	18,10
8300	Banca	8	22.556	28,83
8500	Seguros	1	2.160	2,76
8600	Inmobiliara	-	-	-
8700	Servicios Financieros	2	4.183	5,35
9500	Tecnología	-	-	-
<b>Total</b>		<b>31</b>	<b>26736</b>	<b>100,00</b>

Fuente: FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME), datos del 30 de septiembre del 2011

## CARACTERÍSTICAS DE LA CARTERA DEL ÍNDICE FTSE4GOOD IBEX

	FTSE4Good IBEX
Número de componentes	34
Capitalización (EURm)	78.234
<b>Tamaño de Componentes: (EURm)</b>	
Media	2.301
Mayor	7.910
Menor	87
Mediana	2.021
Ponderación máxima en un valor (%)	10,11
%Capitalizac.10 primeros valores	61

Fuente: FTSE Group y Bolsas y Mercados Españoles (BME), datos del 30 de septiembre del 2011

## COMITÉS Y REVISIONES

Los criterios de FTSE4Good han sido diseñados para ser totalmente transparentes usando un proceso de estudio de mercado que involucra a una amplia gama de grupos de interés, incluyendo a expertos en medioambiente y responsabilidad social corporativa, la comunidad inversora, el sector empresarial, órganos del gobierno y ONGs

**PARA MÁS INFORMACIÓN:**  
VISITE [WWW.FTSE.COM](http://WWW.FTSE.COM) EMAIL [INFO@FTSE.COM](mailto:INFO@FTSE.COM)  
O [WWW.BOLSASYMERCADOS.ES](http://WWW.BOLSASYMERCADOS.ES) EMAIL [IBEX@GRUPOBME.ES](mailto:IBEX@GRUPOBME.ES)

## INFORMACIÓN

### Universo Elegible

Índice FTSE Spain All Cap (parte del FTSE Global Equity Index Series) y el índice IBEX 35 (BME)

### Fecha de lanzamiento

9 de abril del 2008

### Fecha base

31 de diciembre del 2002

### Valor base

5.000

### Replicabilidad

Ajustado por flotante y liquidez

### Cálculo del índice

Índice en tiempo real difundido cada 15 segundos.

Índice de fin de día disponible

### Distribución fin de día

Los índices serán puestos a disposición por BME a las 18:30 hora local

### Moneda

Euro

### Fechas de revisión

Revisión completa semestral en marzo y septiembre

### Normas del índice

Disponibles en [www.ftse.com/ftse4good](http://www.ftse.com/ftse4good)

### Códigos vendor

Disponibles en [www.ftse.com/ftse4good](http://www.ftse.com/ftse4good)

© FTSE International Limited ("FTSE") and Ethical Investment Research Services ("EIRIS") 2008. All rights reserved. "FTSE®", "FTSE®" and "Footsie®" are trade marks jointly owned by the London Stock Exchange Plc and The Financial Times Limited and are used by FTSE under licence. All rights in and to the FTSE4GoodRatings and Indices vest in FTSE and/or EIRIS. The information and opinions contained in this document which has been prepared by FTSE are not intended to be a comprehensive study, nor to provide any advice, and should not be relied on as such. All information is provided for information purposes only. No reliance may be placed for any purposes whatsoever in the information contained in this document or its completeness. No representation or warranty is given by FTSE or EIRIS as to the accuracy or completeness of the information or opinions contained in this document and no liability is accepted for any such information or opinions. No liability can be accepted by FTSE and/or EIRIS for any errors or for any loss arising from use of this publication. This document and its contents may not be reproduced, redistributed, stored in retrieval system, or passed on, directly or indirectly, to any other person or published, or transmitted by any other form or means whether electronic, mechanical

