

COMUNICADO DE PRENSA

S&P Dow Jones Indices y B3 lanzan el primer índice de volatilidad implícita para el mercado doméstico brasileño basado en la metodología del índice VIX de Cboe

NUEVA YORK, 19 de marzo de 2024: S&P Dow Jones Indices (S&P DJI), el principal proveedor de índices a nivel mundial, y B3, la bolsa de Brasil, anunciaron hoy el lanzamiento de un nuevo índice de volatilidad implícita, el primero en monitorear el mercado doméstico de Brasil, sobre la base de la metodología del Cboe Volatility Index (índice VIX[®]), propiedad de Cboe Global Markets.

Concebido para medir la volatilidad a corto plazo implícita en los precios de las opciones sobre el Ibovespa B3, el índice S&P/B3 Ibovespa VIX ofrece una visión transparente y eficiente a 30 días de las expectativas de volatilidad en el mercado brasileño.

Este nuevo índice de referencia brasileño pretende proporcionar a los participantes del mercado una mejor comprensión de la magnitud de los posibles movimientos dentro del mercado brasileño de acciones y una idea de cómo esos movimientos pueden afectar a sus carteras.

“S&P Dow Jones Indices se complace en colaborar con B3 en este importante lanzamiento, que amplía aún más el uso de las herramientas de referencia basadas en volatilidad, no sólo en EE. UU., sino en mercados clave de todo el mundo”, dijo Tim Brennan, Director de Mercados de Capitales de S&P Dow Jones Indices. “La incorporación de índices de volatilidad implícita como el índice S&P/B3 Ibovespa VIX refleja el ecosistema líquido de productos en Brasil y supone un complemento a la oferta de índices líderes del mercado de S&P DJI”.

“El nuevo índice añade a la cartera de productos de B3 un indicador de volatilidad que puede ser utilizado por los inversionistas como referencia para medir la percepción del riesgo. El mercado de opciones en Brasil ha alcanzado un nivel más alto en términos de volumen de operaciones, lo que ha permitido el lanzamiento de este índice y ha hecho posible traer al mercado local una metodología que ya está consolidada en otras partes del mundo”, afirmó Henio Scheidt, Director de Índices de B3.

S&P DJI y Cboe han concedido licencias para el uso de la metodología del índice VIX a varias bolsas de valores y empresas de índices de todo el mundo. De este modo, el índice S&P/B3 Ibovespa VIX viene a ampliar aún más el conjunto de indicadores de volatilidad implícita de S&P DJI, que miden el sentimiento de los inversionistas y la volatilidad de los mercados a escala mundial.

“Cboe se complace en trabajar con S&P DJI y B3 para ofrecer licencias de la metodología de nuestro índice VIX con el fin de que se utilice en nuevos mercados”, señaló Catherine Clay, Directora de Derivados Mundiales de Cboe Global Markets. “El lanzamiento del nuevo índice de B3 no sólo subraya la utilidad universal y la innovación del índice VIX como referencia para la volatilidad de los mercados de renta variable, sino que también supone un paso importante en la mejora del ecosistema financiero en todas las regiones del mundo”. El lanzamiento del nuevo índice refleja el reconocimiento por parte de la comunidad financiera mundial del importante papel que el índice VIX desempeña a la hora de proporcionar a los participantes del mercado un indicador claro y medible de la volatilidad esperada”.

El índice VIX de Cboe es un cálculo diseñado para producir una medida de la volatilidad constante esperada a 30 días del mercado de valores estadounidense, a partir de los precios medios de cotización en tiempo real de las opciones de compra y venta del índice S&P 500® (SPXSM). El índice S&P/B3 Ibovespa VIX, desarrollado a partir de la metodología del índice VIX, utiliza de forma similar precios de opciones en lugar de precios de acciones en su cálculo, ya que los precios de las opciones reflejan las expectativas de los compradores y vendedores sobre la volatilidad del Ibovespa B3. Si bien el índice S&P/B3 Ibovespa VIX no es un producto negociable, el índice de referencia busca proporcionar visibilidad sobre el sentimiento del mercado, lo que puede ayudar a los participantes del mercado a comprender el nivel de riesgo percibido y una visión a 30 días de la gama potencial de rendimientos del Ibovespa B3.

Para más información acerca de S&P Dow Jones Indices, visite <https://www.spglobal.com/spdji/es/>.

ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es la mayor fuente mundial de ideas, datos e investigación basadas en índices. Es, además, la cuna de emblemáticos indicadores del mercado financiero, como el S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Existen más activos invertidos en productos vinculados a nuestros índices que en los productos basados en índices de cualquier otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow creó el primer índice en 1884, S&P DJI se ha dedicado a la innovación y desarrollo de índices dentro de diversas clases de activos, ayudando a definir la manera en que los inversionistas miden los mercados y operan en ellos.

S&P Dow Jones Indices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI), que proporciona la información fundamental que personas, empresas y gobiernos necesitan para tomar decisiones con confianza. Para más información, visite <https://www.spglobal.com/spdji/es/>.

SOBRE B3

B3 S.A. (B3SA3) es una de las principales empresas de infraestructura de mercado financiero en el mundo y es una de las más grandes en valor de mercado, entre los líderes mundiales del sector de bolsas. Conecta, desarrolla y facilita el mercado financiero y de capitales y, junto con los clientes y la sociedad, impulsa el crecimiento de Brasil.

Opera en ambientes bursátiles y de mercado abierto, además de ofrecer productos y servicios para la cadena de financiamiento. Con sede en Sao Paulo y oficinas en Chicago, Londres, Singapur y Shanghái, desempeña funciones importantes en el mercado a través de la promoción de mejores prácticas en gobierno corporativo, gestión de riesgo y sostenibilidad.

VIX® y Cboe® son marcas registradas de Cboe Exchange, Inc. ("Cboe") y han sido licenciadas para su uso por S&P Dow Jones Indices.

La metodología del VIX pertenece a Cboe, y Cboe ha concedido a S&P Dow Jones Indices una licencia para utilizar la metodología del VIX con el fin de crear el índice S&P/B3 Ibovespa VIX y ha acordado que S&P Dow Jones Indices puede permitir la difusión de los valores del índice S&P/B3 Ibovespa VIX. Cboe no hace ninguna declaración con respecto al índice S&P/B3 Ibovespa VIX o la conveniencia de confiar en dicho índice para cualquier propósito, y Cboe no patrocina, respalda, vende o promociona ningún producto de inversión que esté o pueda estar basado en dicho índice.

Ibovespa, Ibovespa B3 y B3 son marcas registradas de B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

PARA MÁS INFORMACIÓN:

COMUNICADO DE PRENSA

S&P Dow Jones Indices

Alyssa Augustyn

Comunicaciones, América

(+1) 773 919 4732

alyssa.augustyn@spglobal.com

B3

+55 11 2565 7639

imprensa@b3.com.br