

## Consulta sobre la periodicidad del rebalanceo y los criterios de elegibilidad de los índices S&P/BVL Peru Select y S&P/BVL Peru Select 20% Capped

**CIUDAD DE MÉXICO, 8 DE JULIO DE 2024:** S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) ha iniciado una consulta dirigida a los participantes de mercado para conocer su opinión acerca de posibles cambios en los índices S&P/BVL Peru Select y S&P/BVL Peru Select 20% Capped.

Debido al deterioro en la liquidez del mercado local y para mejorar la amplitud y estabilidad de la composición del índice, S&P DJI propone cambios en la elegibilidad del índice según el criterio de liquidez y en la frecuencia de rebalanceo.

La tabla a continuación describe los cambios propuestos en la elegibilidad a los índices S&P/BVL Peru Select y S&P/BVL Peru Select 20% Capped según la liquidez.

Cambio	Metodología	
	Vigente	Propuesta
Criterios de Elegibilidad	<b>Liquidez.</b> A la fecha de referencia del rebalanceo, las acciones deben haber negociado una mediana por volumen diario de transacciones (MDVT por sus siglas en inglés) de al menos <b>PEN 250,000</b> (Los componentes vigentes deben contar con al menos <b>PEN 125,000</b> ) en los períodos de tres meses y de seis meses anteriores. En esta selección se tiene en cuenta tanto la liquidez local como la liquidez en América del Norte.	<b>Liquidez.</b> A la fecha de referencia del rebalanceo, las acciones deben haber negociado una mediana por volumen diario de transacciones (MDVT por sus siglas en inglés) de al menos <b>PEN 150,000</b> (Los componentes vigentes deben contar con al menos <b>PEN 100,000</b> ) en los períodos de tres meses y de seis meses anteriores. En esta selección se tiene en cuenta tanto la liquidez local como la liquidez en América del Norte.

Asimismo, la tabla a continuación resume la propuesta para la periodicidad de rebalanceo del índice S&P/BVL Peru Select 20% Capped.

Cambio	Metodología	
	Vigente	Vigente
Rebalanceo	El índice se rebalancea una vez al año con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de septiembre, cuando las adiciones y eliminaciones se implementan como resultado de la revisión integral.	El índice se rebalancea <b>dos veces al año</b> con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de <b>marzo y septiembre</b> .

Para obtener información adicional acerca de la familia S&P/BVL Indices, consulte la Metodología de los S&P/BVL Indices [aquí](#).

### ANÁLISIS DEL IMPACTO

Consulte la presentación disponible [aquí](#) para obtener más información sobre los cambios propuestos, incluida información sobre el impacto hipotético de los cambios propuestos utilizando datos de los rebalances de Marzo de 2018 a Marzo de 2024.

Puede encontrar datos y análisis adicionales en nuestro Centro de Recursos para Clientes [www.spglobal.com/spdji/en/client-services/](http://www.spglobal.com/spdji/en/client-services/) que puede actualizarse con regularidad durante el período

## ÍNDICES AFECTADOS

ÍNDICE	CÓDIGO
S&P/BVL Peru Select Index (USD)	SPBLPSUP
S&P/BVL Peru Select 20% Capped Index (PEN)	SPBLSCPP

## CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

S&P DJI propone la implementación de los cambios previamente descritos, en caso de ser adoptados, conjuntamente con el rebalanceo semestral de septiembre, que será efectivo antes de la apertura de mercado del **Lunes 23 de Septiembre de 2024**. Si los cambios descritos en este documento fueran implementados, el impacto sería visible para nuestros clientes en los archivos prof orma a partir del **Viernes 6 de Septiembre de 2024**

## PREGUNTAS

Responda por favor a las siguientes preguntas y exponga ante S&P DJI sus argumentos

1. ¿Está de acuerdo con el cambio propuesto en el criterio de liquidez para fines de elegibilidad de los índices S&P/BVL Peru Select y S&P/BVL Peru Select 20% Capped?
2. ¿Está de acuerdo con el cambio propuesto a la frecuencia de rebalanceo del índice S&P/BVL Peru Select 20% Capped?
3. ¿Está de acuerdo que en los casos donde corresponda, la cuenta mínima en el criterio de selección de componentes se determine según la liquidez (tomando para este fin el MDVT de seis meses) o debería considerarse también la capitalización de mercado ajustada por flotación (FMC)?
  - Opción 1: solamente tomando el MDVT (criterio actual)
  - Opción 2: tomando MDVT y FMC
4. Si se adopta alguno de los cambios propuestos, ¿está de acuerdo con la fecha de implementación?
5. ¿Tiene algún otro comentario con respecto a los cambios propuestos descritos anteriormente?

Su participación en esta consulta es de suma importancia, pues representa un vehículo para conocer su percepción y preferencias al respecto. Por favor responda a más tardar el **5 de Agosto de 2024**.

## CONSULTA

Después de esta fecha S&P DJI no tomará en cuenta retroalimentación recibida. Antes de que el Comité del Índice concluya la revisión de los comentarios, es posible que S&P DJI contacte a los participantes de esta consulta con el propósito de pedir aclaraciones como parte del proceso de revisión.

Para participar en esta consulta, responda a la encuesta disponible [aquí](#).

*Por favor considere que todos los comentarios serán revisados y tomados en cuenta antes de tomar una decisión final, sin embargo, S&P DJI no garantiza ni tiene obligación alguna de cumplir o hacer efectiva ninguna de las respuestas. Esta consulta pudiera resultar en la ausencia de cambios o resultados de cualquier otro tipo. Si S&P DJI decidiera cambiar la metodología, un anuncio será emitido y publicado en su sitio web.*

Gracias por completar esta encuesta.

Para más información acerca de S&P Dow Jones Indices, visite [www.spglobal.com/spdji](http://www.spglobal.com/spdji).

#### ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es proveedor de datos, investigación y conceptos acerca de índices, más grande a nivel mundial, así como hogar de indicadores financieros iconos de la industria, como los índices S&P 500® y el Dow Jones Industrial Average®. Más activos son invertidos en productos basados en nuestros índices que en ningún otro proveedor en el mundo. Desde que Charles Dow inventó el primer índice en 1884, S&P DJI se ha convertido en la casa de alrededor de 1,000,000 de índices dentro del espectro de las distintas clases de activos que han definido la forma en que los inversionistas parametrizan y hacen negocios en el mercado.

S&P Dow Jones Indices es una división de S&P Global (NYSE: SPGI), que provee inteligencia financiera esencial a individuos, empresas y gobiernos para una óptima y segura toma de decisiones. Para más información, visite [www.spglobal.com/spdji](http://www.spglobal.com/spdji).

#### PARA MAYOR INFORMACION:

##### **S&P Dow Jones Indices**

[index\\_services@spglobal.com](mailto:index_services@spglobal.com)