

Resultados de la 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, 19 DE AGOSTO 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 implementará cambios tanto en la elegibilidad del índice según el criterio de liquidez, como en la frecuencia de rebalanceo.

La tabla a continuación describe los cambios a implementar 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	Actualización
Criterios de Elegibilidad	Liquidez. 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 PEN 250,000 (Los componentes vigentes deben contar con al menos PEN 125,000) 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.	Liquidez. 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 PEN 150,000 (Los componentes vigentes deben contar con al menos PEN 100,000) 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 dos veces al año con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer viernes de marzo y septiembre .

La regla para alcanzar la cuenta mínima de componentes donde cuando corresponda, se basa en la selección de acuerdo con la liquidez (tomando como referencia el MDVT de seis meses) permanece sin cambios.

CALENDARIO DE IMPLEMENTACIÓN

S&P DJI implementará los cambios previamente descritos conjuntamente con el rebalanceo semestral de septiembre, que será efectivo antes de la apertura de mercado del **Lunes 23 de Septiembre de 2024**. El impacto de los cambios descritos en este documento será visible para nuestros clientes en los archivos proforma a partir del **Viernes 6 de Septiembre de 2024**

Para más información acerca de S&P Dow Jones Indices, visite 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.

PARA MAYOR INFORMACION:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com