

Modificación a la Metodología del S&P/BVL Peru Select Index

CIUDAD DE MEXICO, MARZO 30, 2020: S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) anuncia el siguiente cambio en la metodología del S&P/BVL Peru Select Index.

Con la intención de estandarizar las reglas aplicables a la familia del índice, S&P DJI ha alineado la metodología del S&P/BVL Peru Select Index con la del recientemente lanzado S&P/BVL Peru Select 20% Capped Index. La siguiente tabla resume los cambios en cuestión:

Cambio	Metodología	
	Anterior	Vigente
Valor por Capitalización de Mercado	Las acciones deben tener una capitalización de mercado ajustada al capital flotante mínima de PEN 150 millones a la fecha de referencia del rebalanceo. (Los componentes vigentes deben contar con al menos PEN 75 millones)	Las acciones deben tener una capitalización de mercado ajustada al capital flotante mínima de PEN 200 millones a la fecha de referencia del rebalanceo. (Los componentes vigentes deben contar con al menos PEN 100 millones)
Listado en Bolsa	El índice utiliza principalmente el universo de acciones listadas localmente para valorar la adición de cada componente. Sin embargo, se puede considerar aquellas acciones negociadas en la región de América del Norte si resulta ser más líquida que la operada localmente.	El índice utiliza principalmente el universo de acciones listadas localmente para valorar la adición de cada componente. Sin embargo, se puede considerar aquellas acciones negociadas en la región de América del Norte si resulta ser más líquida que la operada localmente. El listado de acciones incluido en el índice podría cambiar si el MDVT de seis meses del listado de acciones que son parte del índice es del doble del listado incluido.
Rebalanceo	El índice se rebalancea dos veces al año con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer Viernes de Marzo y Septiembre. Además, el índice se repondera con periodicidad trimestral después del cierre de mercado del tercer Viernes de los meses de Junio y Diciembre. La fecha de referencia del rebalanceo para los cambios en la composición del índice es cinco semanas antes de la fecha de rebalanceo. La cuenta de acciones para efectos de rebalanceo se calcula tomando los precios de cierre de siete días hábiles previos a la fecha de rebalanceo.	El índice se rebalancea dos veces al año con fecha efectiva después del cierre de mercado del tercer Viernes de Marzo y Septiembre. Además, el índice se repondera con periodicidad trimestral después del cierre de mercado del tercer Viernes de los meses de Junio y Diciembre. La fecha de referencia para la implementación de los cambios en la composición del índice es cinco semanas antes de la fecha del rebalanceo. Con excepción del rebalanceo del mes de Septiembre, el número de acciones por componente se calcula tomando los precios de cierre de siete días hábiles previos a la fecha del rebalanceo. En el caso del rebalanceo de Septiembre, el número de acciones por componente se calcula tomando los precios de cierre de los 12 días hábiles previos a la fecha de rebalanceo.

Estos cambios serán efectivos antes de la apertura de mercado del Martes 31 de Marzo de 2020.

Para mayor información, visite nuestro sitio web www.spdji.com.

ACERCA DE S&P DOW JONES INDICES

S&P Dow Jones Indices es el mayor centro mundial de ideas, datos e investigación basadas en índices. Es, además, la cuna de emblemáticos indicadores del mercado, 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 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 subsidiaria 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 www.spdji.com.

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com