

“LA CAPACIDAD DE MOVER AL MERCADO”

CALENDARIO DE REBALANCEOS DE INDICES 2020

Los principales índices globales tienen rebalances y reponderaciones en fechas específicas. Durante estos eventos, los gestores de fondos indexados (llamados pasivos por seguir obligatoriamente un índice) negocian estas acciones para que el rendimiento de dichos fondos no sufra a su índice referencia. **Estos eventos han cobrado mayor relevancia en los mercados de valores internacionales dada la creciente preferencia de muchos inversionistas globales por fondos pasivos** (y su versión negociable en bolsa, los ETF). Para los fondos activos, no obligados a seguir un índice, estos pueden ser relevantes para diferentes usos: “benchmarks” o puntos de referencia para evaluar sus rendimientos; definición de universos de inversión (un fondo activo que siga un índice “emergente” puede contar con limitaciones para invertir libremente si un mercado es considerado “frontera”, por ejemplo).



Los rebalances de los principales proveedores de índices como MSCI, FTSE o S&P DJI son cada vez más relevantes en el comportamiento de las acciones, dado que los índices son las puertas de entrada para potenciales inversionistas globales.

REBALANCEO

Se refiere a los cambios en la composición de un índice, así como en las acciones en circulación y en los factores de capital flotante.

REPONDERACIÓN

Es la actualización de las ponderaciones, acciones y factores de capital flotante.

[Descarga el PDF](#)

Síguenos en:

