

Índices

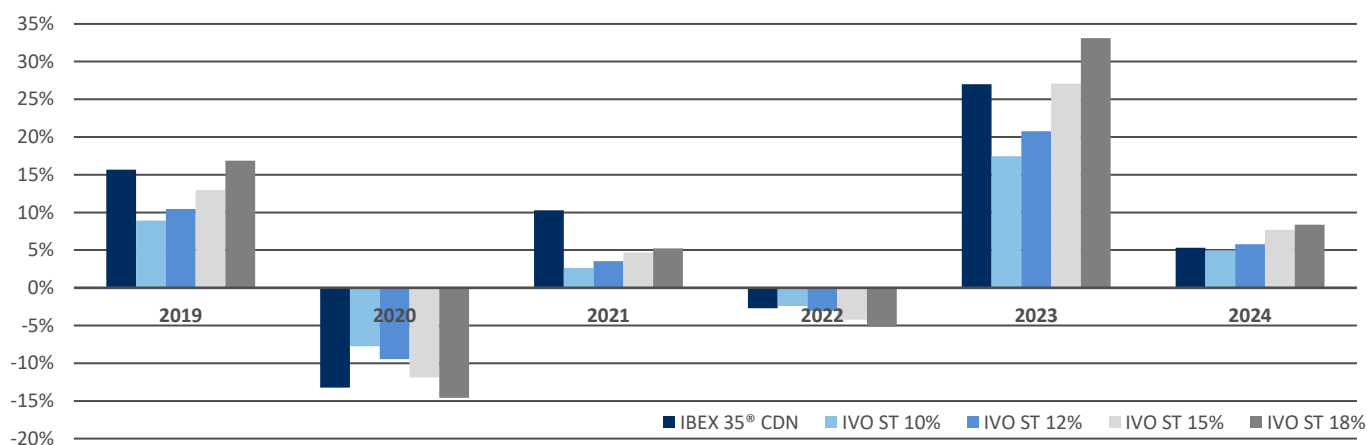
Índices IBEX 35® VOLATILIDAD OBJETIVO ESTÁNDAR

Descripción Del Índice

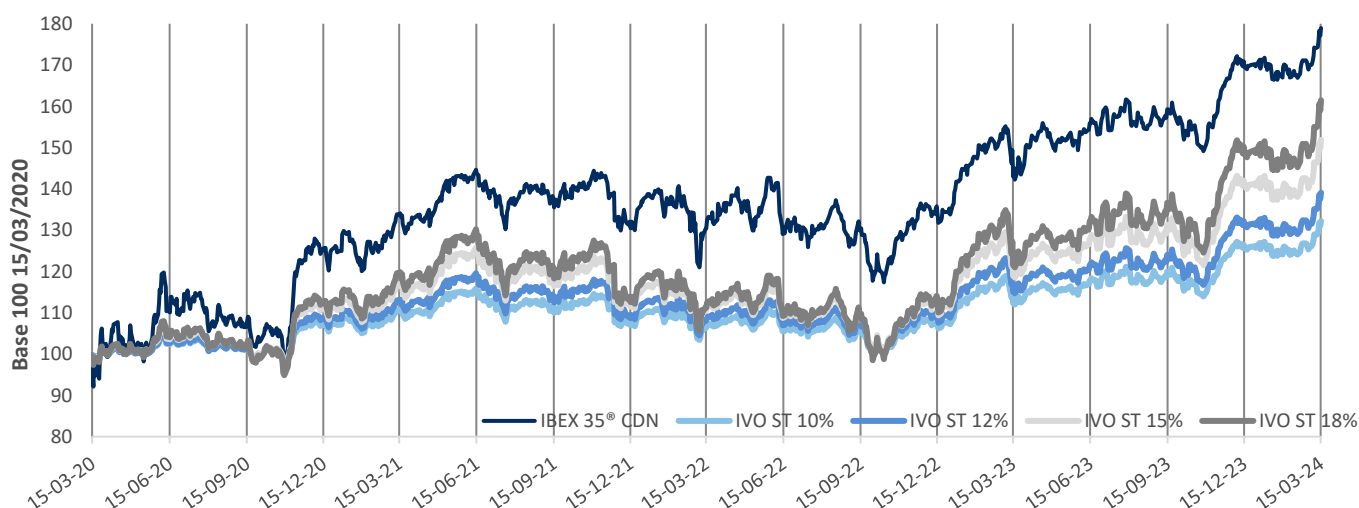
Bolsas y Mercados Españoles (BME) calcula, publica y distribuye en tiempo real los índices IBEX. BME, la compañía que integra los principales mercados de valores y sistemas financieros de España, es el quinto mayor operador de mercados de Europa por volumen de contratación de renta variable según datos de la Federación Europea de Bolsas (FESE). El volumen contratado en renta variable durante el mes de marzo es de 29.362 millones de euros y el número de negociaciones asciende a 2,84 millones.

La serie de índices de volatilidad objetivo basan su estrategia en una combinación de inversión en renta variable y renta fija. Estos índices incorporan la estrategia de limitar el riesgo de la inversión, para ello fijan un objetivo de volatilidad y distribuyen la inversión entre renta variable y renta fija de acuerdo con las condiciones

Rentabilidades Anuales de la Serie Estándar Y Del Subyacente



Evolución de la Serie Estándar Con El Subyacente



Características Del Índice

	IBEX 35®	IVO ESTÁNDAR
Nº de Componentes	35	
Fecha de Lanzamiento	14/01/1992	24/09/2013
Fecha base	29/12/1989	29/04/1999
Índice base	3.000	100

Top 10 Componentes IBEX 35 ®

NOMBRE VALOR	CÓDIGO	POND %
INDITEX	ITX	15,48
IBERDROLA	IBE	12,95
SANTANDER	SAN	11,97
BBVA	BBVA	11,17
CAIXABANK	CABK	4,96
FERROVIAL SE	FER	4,94
AMADEUS IT	AMS	4,76
CELLNEX	CLNX	4,18
TELEFONICA	TEF	4,14
AENA	AENA	3,93

Perfil de Riesgo Y Rentabilidad

	Rentabilidades				Volatilidades anuales			
	6 M %	12 M %	3 A %	5 A %	2024 %	2023 %	2022 %	Media últ. 10 años %
IBEX 35 Con Dividendos Netos	12,33	25,21	33,80	31,11	11,29	14,15	19,42	18,41
IVO Estándar 10%	10,22	17,78	19,49	16,82	9,81	9,78	9,70	10,03
IVO Estándar 12%	12,14	20,94	23,10	19,30	11,76	11,72	11,62	12,03
IVO Estándar 15%	15,67	27,72	30,01	24,62	14,73	14,65	14,56	15,05
IVO Estándar 18%	18,17	32,92	35,10	28,83	16,91	17,57	17,45	17,91
IVO Financiado 10%	8,12	14,15	14,50	12,35	9,84	9,79	9,70	10,04
IVO Financiado 12%	9,91	16,63	18,31	15,42	11,80	11,75	11,63	12,04
IVO Financiado 15%	11,91	20,83	21,44	15,92	14,66	14,70	14,51	15,04
IVO Financiado 18%	13,97	24,78	25,81	19,77	16,94	17,61	17,45	17,92

Resumen Del Reparto de Inversiones en 2023

	LÍMITE 10%	LÍMITE 12%	LÍMITE 15%	LÍMITE 18%
Promedio Inversión en RV	73,99	88,78	110,98	131,70
Nivel Mínimo Inversión en RV	45,37	54,44	68,05	81,66
Nivel Máximo Inversión en RV	92,61	111,13	138,91	150,00

Información Del Índice

CÓDIGOS	ISIN	REUTERS	BLOOMBERG
IBEX 35	ES0SI0000005	<.IBEX>	IBEX Index <GO>
IBEX 35 CDN	ES0SI0000047	<.IBEXTR>	IBEX35TR Index <GO>
IBEX 35 VOL. OBJ. ST. 10%	ES0S00000083	<.IBEXVA>	IBXTV10S Index <GO>
IBEX 35 VOL. OBJ. ST. 12%	ES0S00000091	<.IBEXVB>	IBXTV12S Index <GO>
IBEX 35 VOL. OBJ. ST. 15%	ES0S00000109	<.IBEXVC>	IBXTV15S Index <GO>
IBEX 35 VOL. OBJ. ST. 18%	ES0S00000117	<.IBEXVD>	IBXTV18S Index <GO>

Metodología Del Índice

La serie IBEX 35 VOLATILIDAD OBJETIVO son índices estratégicos basados en el IBEX 35. Están denominados en Euros y se calculan al cierre de cada sesión. La serie estándar cuenta con un capital inicial que se reparte en una proporción en Renta Variable y el remanente en renta fija.

El cálculo de la volatilidad se realiza según un modelo EWMA basado en los datos históricos de los índices. Los cuatro niveles de volatilidad objetivo son 10%, 12%, 15% y 18%.

La inversión en renta variable se realiza concretamente en el IBEX 35 Con Dividendos Netos con un determinado nivel de apalancamiento. La inversión en Renta Fija obtiene una rentabilidad conforme al €STR (Euro short-term rate).

Licencia

El uso de Índices IBEX y sus marcas registradas (®) así como el acceso a los datos restringidos de índices, se rigen por un acuerdo de licencia. Para solicitar una licencia de datos de índices, por favor contacte con indexlicense@grupobme.es