

PROCEDIMIENTO DE CORRECCIONES

De acuerdo con el reglamento (UE) 2016/1011 del Parlamento Europeo y del Consejo de 8 de junio de 2016, el procedimiento de correcciones descrito en el presente documento dispone de la información completa sobre las medidas relativas a las correcciones de la determinación o publicación de un índice de referencia o una familia de índices de referencia.

Sociedad de Bolsas, S.A., dispone de un procedimiento sobre las posibles correcciones que haya que introducir a los datos asociados a los índices o a su cálculo, en caso de que se haya producido alguna inexactitud o error, de la que se ha tenido constancia con posterioridad a su publicación.

Aunque las Normas Técnicas para la Composición y Cálculo de los Índices de Sociedad de Bolsas, S.A. prevalecen en todas las situaciones, este procedimiento proporciona orientación adicional sobre el proceso a seguir en los casos descritos a continuación.

1. Difusión de los Índices

Sociedad de Bolsas, S.A. como Gestor, hará pública la información sobre los mismos a través de los medios que establezca al efecto.

La información sobre los Índices consistirá tanto en la publicación de los anuncios sobre los mismos como en la información en tiempo real de Sociedad de Bolsas, S.A. en su flujo de información (Vendor-feed) a disposición de los redifusores profesionales de información.

Los anuncios de los Índices incluirán los principales datos de los Índices al cierre, así como los ajustes, en su caso, los hechos relevantes conocidos que vayan a afectar al Índice en, al menos, las próximas 5 sesiones bursátiles y los anuncios oficiales pertinentes en sus revisiones ordinarias y extraordinarias.

Con independencia de los medios establecidos por Sociedad de Bolsas, S.A., los anuncios del Índice serán hechos públicos por las cuatro Sociedades Rectoras de las Bolsas Españolas a través de los Boletines Oficiales de Cotización.

En caso de omisión o error en los datos publicados, Sociedad de Bolsas se compromete a publicar los datos de cierre de los índices, y una vez hayan sido recalculados se generarán ficheros de corrección de cierre.

Sociedad de Bolsas no recalculará ni publicará datos intradía de la sesión, en caso de que estos se hayan omitido o publicado erróneamente.

2. Procedimiento de corrección

El procedimiento se iniciará por La Secretaría de Gestión en caso de que se identifique una causa que determine la conveniencia o necesidad de republicar un índice, o unos de los elementos que intervienen en el cálculo del índice, como son componentes, precio, número de acciones, coeficiente flotante o divisor.

Si alguno de los elementos que intervienen en el cálculo del índice descritos con anterioridad hubiera sido difundido de forma inexacta o por error, el Gestor del Índice dispondrá las actuaciones necesarias para la corrección de tales elementos así como de los niveles de índices afectados por esta causa. Las correcciones se realizarán lo antes posible.

El Gestor del Índice puede decidir no implementar una corrección en caso de que considere que ya no procede debido al tiempo transcurrido y en aras de los intereses del índice y de los usuarios del mismo, así como de la replicabilidad del índice.

En caso de ajustes a los índices con dividendos o con dividendos netos, debido a importes o fechas ex date incorrectos o anunciados por el emisor con posterioridad a la fecha de ajuste, el Gestor no modificará los niveles del índice.

En cuanto a los datos históricos de los índices, en relación a aquellos índices que deban cumplir con la normativa UCITS, Sociedad de Bolsas no permite cambios retrospectivos sobre índices ya publicados (backfilling).

3. Circunstancias excepcionales

En circunstancias excepcionales en las que todo o parte del mercado no esté difundiendo un precio para los valores, debido a suspensiones, subastas de volatilidad, interrupciones técnicas, etc., y de acuerdo con las Normas Técnicas de Cálculo, en su apartado 3.1.2.1 Precio, en los casos de suspensión de cotización de un valor por cualquier motivo se tomará como precio válido para el cálculo del Índice aquél al que se realizó la última transacción anterior a la suspensión del referido valor.

A partir del cierre del mercado, se pasará a utilizar el precio de cierre calculado de acuerdo con lo anterior.

En situaciones de tensión de mercado que afecten a todos o parte de los valores que lo componen, el índice se calculará según lo establecido en los párrafos anteriores.

Adicionalmente, si el Gestor lo considera oportuno podrá, en casos excepcionales, proponer al Comité Asesor Técnico una solución distinta de las anteriormente descritas atendiendo a las características de cada caso.