

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

CONTACTO: AURELIO BUENO HERNÁNDEZ  
CARGO: DIRECTOR GENERAL ADJUNTO DE COMUNICACIÓN SOCIAL  
TEL. 1454-6713

CIUDAD DE MÉXICO, A 19 DE OCTUBRE DE 2016.

085/2016

## COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de agosto de 2016, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 27.49%<sup>1</sup>.
- Todas las casas de bolsa en operación se ubican en la Categoría I de alertas tempranas y cumplen con el requerimiento mínimo de capitalización del 8% más el suplemento de conservación de capital de 2.5% constituido con capital fundamental; es decir, con un ICAP superior al 10.5%.

---

Con el propósito de mantener informado al público sobre el desempeño de las entidades que conforman al sector de casas de bolsa y dar cumplimiento a lo dispuesto en el artículo 135 de la Ley del Mercado de Valores, y en relación con los artículos 204 Bis 1 y 204 Bis 2 de las "Disposiciones de carácter general aplicables a las casas de bolsa" (Disposiciones), la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV) da a conocer a través de su página de Internet, <http://www.gob.mx/cnbv>, los indicadores de capitalización: Índice de Capitalización (ICAP), Coeficiente de Capital Básico (CCB) y Coeficiente de Capital Fundamental (CCF), a agosto de 2016; así como la clasificación en Categorías de alertas tempranas asignada a cada entidad con base en estos tres indicadores. Lo anterior, conforme a las disposiciones aplicables a los requerimientos de capitalización, emitidas por la CNBV en términos del artículo 173 de la Ley del Mercado de Valores.

CLASIFICACIÓN DE LAS CASAS DE BOLSA DE ACUERDO A LOS ARTÍCULOS 204 BIS 1 Y 204 BIS 2 DE LAS DISPOSICIONES DE CARÁCTER GENERAL APLICABLES A LAS CASAS DE BOLSA <sup>1/</sup>  
CIFRAS AL 31 DE AGOSTO DE 2016

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN <sup>1/</sup>						
CASA DE BOLSA	JULIO DE 2016	AGOSTO DE 2016			ICAP, VARIACIÓN MENSUAL EN PP <sup>2/</sup>	CATEGORÍA EN AGOSTO DE 2016 <sup>3/</sup>
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Barclays Capital	498.69	569.23	569.23	569.23	70.54	I
Deutsche Securities	483.49	548.24	548.24	548.24	64.75	I
Dunbarton Securities	405.00	439.74	439.74	439.74	34.74	I
H SBC	377.71	364.31	364.31	364.31	-13.40	I
JPMorgan	186.88	233.24	233.24	233.24	46.36	I
Credit Suisse	280.16	218.72	218.72	218.72	-61.44	I
Kusbit	168.40	202.39	202.39	202.39	33.99	I
BBVA Bancomer	172.05	185.98	185.98	185.98	13.93	I
Itaú BBA Casa de Bolsa	189.35	184.66	184.66	184.66	-4.68	I
Merrill Lynch	163.04	179.55	179.55	179.55	16.52	I
Evercore Casa de Bolsa	179.44	179.50	179.50	179.50	0.07	I
UBS	108.94	160.95	160.95	160.95	52.01	I
BTG Pactual CB	137.96	132.71	132.71	132.71	-5.25	I
Santander	108.46	114.11	114.11	114.11	5.65	I
Punto Casa de Bolsa	62.27	61.33	61.33	61.33	-0.94	I
Achival	58.21	55.28	55.28	55.28	-2.93	I
Goldman Sachs CB	26.71	36.39	36.39	36.39	9.67	I
Valmax	24.00	30.82	30.82	30.82	6.82	I
Morgan Stanley	24.80	29.96	29.96	29.96	5.16	I
Inversora Bursátil	21.26	25.79	25.79	25.79	4.52	I
Masari	24.17	23.94	23.94	23.94	-0.23	I
CIC Casa de Bolsa	34.51	23.07	23.07	23.07	-11.43	I
Scotia Casa de Bolsa	28.00	21.59	21.59	21.59	-6.41	I
CBV por Más	21.35	20.82	20.82	20.82	-0.53	I
Casa de Bolsa Banorte-Dre	23.05	20.16	20.16	20.16	-2.89	I
Interam	19.26	18.88	18.88	18.88	-0.38	I
Interacciones	23.58	15.83	15.83	15.83	-7.75	I
Casa de Bolsa Base	16.54	15.48	15.48	15.48	-1.07	I
Actinver	12.58	14.38	14.38	14.38	1.80	I
GBM	15.04	14.36	14.36	14.36	-0.69	I
Monex	15.84	14.30	14.30	14.30	-1.54	I
Valhe	14.11	14.09	14.09	14.09	-0.02	I
Finamex	15.51	13.88	13.88	13.88	-1.63	I
Vector	13.43	13.79	13.79	13.79	0.36	I
Invex	12.29	13.34	13.34	13.34	1.05	I
Multiva	13.58	12.81	12.81	12.81	-0.77	I
<b>Total Casas de Bolsa</b>	<b>26.00</b>	<b>27.49</b>	<b>27.49</b>	<b>27.49</b>	<b>1.49</b>	

<sup>1/</sup> Dado a conocer el 11 de octubre de 2016 por el Banco de México, con base en la información entregada por las casas de bolsa, y de acuerdo con las definiciones contenidas en los artículos 204 Bis 1 y 204 Bis 2 de las Disposiciones publicadas en el DOF el 22 de diciembre de 2006 y con las resoluciones modificatorias subsecuentes.

<sup>2/</sup> pp = puntos porcentuales. Los datos de variaciones pueden no coincidir debido al redondeo de cifras.

<sup>3/</sup> **Categorías:** **I:** ICAP > = 10.5%; **II:** 10.5 > ICAP > = 8.0%; **III:** 8.0 > ICAP > = 7.0%; **IV:** 7.0 > ICAP > = 4.5% y **V:** ICAP < 4.5%.

<sup>i</sup> De acuerdo con las Disposiciones, a partir de octubre de 2015 se reportan tres indicadores de capitalización: ICAP, CCB y CCF de las casas de bolsa.

El capital neto de todas las entidades está compuesto por capital fundamental, por lo que los tres indicadores de capitalización son de la misma magnitud.

<sup>ii</sup> A fin de mantenerse en el nivel I de las categorías de alertas tempranas las casas de bolsa deberán cumplir con lo siguiente:

1. Un índice de capitalización mínimo requerido igual o mayor a 8.0%
2. Un CCB de por lo menos 6.0%.
3. Un CCF de por lo menos 4.5%.
4. Un suplemento de conservación de capital equivalente al 2.5% de los activos ponderados sujetos a riesgo totales por encima de los niveles antes descritos, el cual debe estar constituido por capital fundamental.

De lo anterior se desprende que, el ICAP de las casas de bolsa deberá ser igual o mayor a 10.5% para ubicarse en la categoría I de alertas tempranas:

$$\text{ICAP} = 8.0\% \text{ (mínimo requerido)} + 2.5\% \text{ (suplemento de conservación de capital)}$$

o0o