

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

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

CIUDAD DE MÉXICO, A 12 DE ENERO DE 2017.

003/2017

COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de noviembre de 2016, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 24.95%.¹
- 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 portal de Internet, www.gob.mx/cnbv, los indicadores de capitalización: Índice de Capitalización (ICAP), Coeficiente de Capital Básico (CCB) y Coeficiente de Capital Fundamental (CCF), a noviembre 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 esta Comisión 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 ^{1/}
CIFRAS AL 30 DE NOVIEMBRE DE 2016

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN ^{1/}						
CASA DE BOLSA	OCTUBRE DE 2016	NOVIEMBRE DE 2016			ICAP, VARIACIÓN MENSUAL EN PP ^{2/}	CATEGORÍA EN NOVIEMBRE DE 2016 ^{3/}
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Deutsche Securities	551.73	565.12	565.12	565.12	13.39	I
Barclays Capital	549.87	563.23	563.23	563.23	13.36	I
Dumarton Securities	471.48	469.04	469.04	469.04	-2.44	I
HSBC	407.94	373.81	373.81	373.81	-34.14	I
BEVA Bancomer	211.36	296.45	296.45	296.45	85.09	I
JPMorgan	230.33	251.41	251.41	251.41	21.08	I
Credit Suisse	177.18	221.96	221.96	221.96	44.79	I
Vifani Casa de Bolsa ^{4/}	201.04	204.50	204.50	204.50	3.46	I
UBS	181.19	192.21	192.21	192.21	11.02	I
Kuspit	195.06	177.58	177.58	177.58	-17.48	I
Evercore Casa de Bolsa	178.28	176.92	176.92	176.92	-1.36	I
Merrill Lynch	142.60	170.44	170.44	170.44	27.84	I
BTG Pactual CB	123.48	104.34	104.34	104.34	-19.14	I
Santander	109.28	95.61	95.61	95.61	-13.67	I
Acoival	59.59	65.60	65.60	65.60	6.01	I
Punto Casa de Bolsa	63.10	56.26	56.26	56.26	-6.84	I
Valmax	28.05	29.12	29.12	29.12	1.07	I
Multiva	33.42	28.66	28.66	28.66	-4.77	I
Goldman Sachs CB	30.16	26.84	26.84	26.84	-3.32	I
Masari	24.68	26.33	26.33	26.33	1.65	I
CICasa de Bolsa	29.09	25.20	25.20	25.20	-3.89	I
Inversora Bursátil	21.46	24.60	24.60	24.60	3.14	I
CBV por Más	21.12	19.21	19.21	19.21	-1.91	I
Scotia Casa de Bolsa	23.73	18.84	18.84	18.84	-4.89	I
Intercom	19.00	18.29	18.29	18.29	-0.71	I
GBM	16.90	18.11	18.11	18.11	1.21	I
Monex	17.10	17.88	17.88	17.88	0.77	I
Casa de Bolsa Banorte-Dxe	18.95	17.11	17.11	17.11	-1.85	I
Finamex	19.41	16.26	16.26	16.26	-3.15	I
Morgan Stanley	31.75	15.82	15.82	15.82	-15.93	I
Casa de Bolsa Base	15.79	15.82	15.82	15.82	0.03	I
Interacciones	15.60	15.06	15.06	15.06	-0.53	I
Valle	15.04	14.06	14.06	14.06	-0.97	I
Actinver	12.53	13.47	13.47	13.47	0.94	I
Inveex	14.41	12.44	12.44	12.44	-1.98	I
Vector	13.05	12.18	12.18	12.18	-0.88	I
Total Casas de Bolsa	27.36	24.95	24.95	24.95	-2.41	

^{1/} Dado a conocer el 9 de enero de 2017 por el Banco de México, con base en la información entregada por las casas de bolsa, y de acuerdo con las Disposiciones.

^{2/} pp = Puntos porcentuales. Los datos de variaciones pueden no coincidir debido al redondeo de cifras.

^{3/} **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%.

^{4/} En septiembre de 2016 cambió de denominación social, antes fue Itaú BBA Casa de Bolsa.

ⁱ 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.

ⁱⁱ 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:

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

000