

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

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

CIUDAD DE MÉXICO, A 20 DE JULIO DE 2016.

057/2016

## COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de mayo de 2016, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 26.11%, lo que representó una disminución mensual de 0.08 puntos porcentuales (pp).<sup>i</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 portal de Internet, <http://www.cnbv.gob.mx>, los indicadores de capitalización: Índice de Capitalización (ICAP), Coeficiente de Capital Básico (CCB) y Coeficiente de Capital Fundamental (CCF), a mayo 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<sup>1/</sup>

## CIFRAS AL 31 DE MAYO DE 2016

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN <sup>1/</sup>						
	ABRIL DE 2016	MAYO DE 2016				
CASA DE BOLSA	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %	ICAP, VARIACIÓN MENSUAL EN PP <sup>2/</sup>	CATEGORÍA EN MAYO DE 2016 <sup>3/</sup>
Barclays Capital	513.77	551.30	551.30	551.30	37.54	I
Deutsche Securities	473.08	478.79	478.79	478.79	5.70	I
Dumarton Securities	419.27	417.42	417.42	417.42	-1.85	I
H SBC	472.36	364.52	364.52	364.52	-107.84	I
Kuspit	147.01	197.77	197.77	197.77	50.76	I
Itaú BBA Casa de Bolsa	206.57	193.60	193.60	193.60	-12.96	I
Credit Suisse	138.71	181.03	181.03	181.03	42.31	I
BBVA Bancomer	134.05	148.97	148.97	148.97	14.93	I
BTG Pactual CB	151.52	147.89	147.89	147.89	-3.63	I
Evercore Casa de Bolsa	100.37	147.75	147.75	147.75	47.38	I
Merrill Lynch	207.93	138.12	138.12	138.12	-69.81	I
UBS	175.47	118.22	118.22	118.22	-57.26	I
JPMorgan	89.89	89.35	89.35	89.35	-0.54	I
Accival	51.54	57.66	57.66	57.66	6.12	I
Santander	51.52	50.54	50.54	50.54	-0.98	I
Punto Casa de Bolsa	59.89	48.73	48.73	48.73	-11.16	I
Valmex	33.99	39.61	39.61	39.61	5.63	I
Goldman Sachs CB	35.60	38.23	38.23	38.23	2.63	I
CICasa de Bolsa	38.49	32.51	32.51	32.51	-5.98	I
Morgan Stanley	48.06	32.20	32.20	32.20	-15.86	I
Masari	19.69	23.33	23.33	23.33	3.64	I
Interacciones	21.58	21.99	21.99	21.99	0.40	I
Inversora Bursátil	14.30	21.97	21.97	21.97	7.66	I
Multiva	21.06	20.93	20.93	20.93	-0.14	I
Casa de Bolsa Banorte-De	24.71	20.15	20.15	20.15	-4.56	I
Scotia Casa de Bolsa	22.96	18.90	18.90	18.90	-4.06	I
Interam	18.43	18.20	18.20	18.20	-0.23	I
CBVepor Más	15.86	17.60	17.60	17.60	1.74	I
Monex	13.65	16.51	16.51	16.51	2.85	I
Valbe	14.92	15.30	15.30	15.30	0.38	I
GBM	13.96	13.90	13.90	13.90	-0.06	I
Invex	13.38	13.80	13.80	13.80	0.42	I
Finamex	12.50	12.05	12.05	12.05	-0.45	I
Actinver	11.89	11.88	11.88	11.88	-0.01	I
Vector	11.57	10.72	10.72	10.72	-0.84	I
Casa de Bolsa Base	13.36	10.58	10.58	10.58	-2.78	I
<b>Total Casas de Bolsa</b>	<b>26.19</b>	<b>26.11</b>	<b>26.11</b>	<b>26.11</b>	<b>-0.08</b>	

<sup>1/</sup> Dado a conocer el 11 de julio 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 la resolución modificatoria 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: ICAP, CCB y CCF.

<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**