

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

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

CIUDAD DE MÉXICO, A 22 DE NOVIEMBRE DE 2016.

094/2016

## COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de septiembre de 2016, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 26.04%.<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, [www.gob.mx/cnbv](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 septiembre 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 30 DE SEPTIEMBRE DE 2016

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN <sup>1/</sup>						
CASA DE BOLSA	AGOSTO DE 2016	SEPTIEMBRE DE 2016			ICAP, VARIACIÓN MENSUAL EN PP <sup>2/</sup>	CATEGORÍA EN SEPTIEMBRE DE 2016 <sup>3/</sup>
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Barclays Capital	569.23	537.33	537.33	537.33	-31.90	I
Deutsche Securities	548.24	530.44	530.44	530.44	-17.80	I
Dumont Securities	439.74	474.49	474.49	474.49	34.76	I
H SBC	364.31	372.28	372.28	372.28	7.97	I
JPMorgan	233.24	252.42	252.42	252.42	19.17	I
Crédit Suisse	218.72	239.86	239.86	239.86	21.14	I
BBVA Bancomer	185.98	230.39	230.39	230.39	44.42	I
Motus Inverste <sup>4/</sup>	184.66	188.12	188.12	188.12	3.46	I
Kuspit	202.39	184.23	184.23	184.23	-18.16	I
UBS	160.95	175.07	175.07	175.07	14.12	I
Merrill Lynch	179.55	164.52	164.52	164.52	-15.04	I
Evercore Casa de Bolsa	179.50	151.47	151.47	151.47	-28.03	I
BTG Pactual CB	132.71	128.00	128.00	128.00	-4.72	I
Santander	114.11	109.12	109.12	109.12	-4.99	I
Accival	55.28	59.41	59.41	59.41	4.14	I
Punto Casa de Bolsa	61.33	58.73	58.73	58.73	-2.60	I
Multiva	12.81	32.26	32.26	32.26	19.45	I
Inversora Bursátil	25.79	27.90	27.90	27.90	2.12	I
Vainex	30.82	24.85	24.85	24.85	-5.97	I
Goldman Sachs CB	36.39	24.39	24.39	24.39	-12.00	I
Masari	23.94	24.24	24.24	24.24	0.31	I
Morgan Stanley	29.96	21.69	21.69	21.69	-8.27	I
Scotia Casa de Bolsa	21.59	21.54	21.54	21.54	-0.05	I
CIC Casa de Bolsa	23.07	21.47	21.47	21.47	-1.61	I
Finamex	13.88	19.68	19.68	19.68	5.80	I
CBV por Más	20.82	19.26	19.26	19.26	-1.56	I
Interam	18.88	18.91	18.91	18.91	0.03	I
Casa de Bolsa Banorte-Dre	20.16	17.96	17.96	17.96	-2.21	I
Monex	14.30	17.23	17.23	17.23	2.93	I
GBM	14.36	17.09	17.09	17.09	2.73	I
Value	14.09	15.92	15.92	15.92	1.82	I
Interacciones	15.83	14.93	14.93	14.93	-0.89	I
Activer	14.38	14.33	14.33	14.33	-0.05	I
Casa de Bolsa Base	15.48	14.21	14.21	14.21	-1.26	I
Vector	13.79	13.88	13.88	13.88	0.09	I
Invex	13.34	13.35	13.35	13.35	0.02	I
<b>Total Casas de Bolsa</b>	<b>27.49</b>	<b>26.04</b>	<b>26.04</b>	<b>26.04</b>	<b>-1.45</b>	

<sup>1/</sup> Dado a conocer el 10 de noviembre 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.

<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