

PARA MAYOR INFORMACIÓN:

CONTACTO: MARÍA DE LAS NIEVES LANZAGORTA GARCÍA  
CARGO: DIRECTORA DE COMUNICACIÓN SOCIAL  
CORREO: [mlanzagorta@cnbv.gob.mx](mailto:mlanzagorta@cnbv.gob.mx)  
TEL. 1454-6730

CIUDAD DE MÉXICO, A 21 DE AGOSTO DE 2017

070/2017

### COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de junio de 2017, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 27.11%, lo que representó un incremento mensual de 0.93 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, [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 junio de 2017; 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<sup>ii</sup> CIFRAS AL 30 DE JUNIO DE 2017

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN <sup>1/</sup>						
CASA DE BOLSA	MAYO DE 2017	JUNIO DE 2017			ICAP, VARIACIÓN MENSUAL EN PP <sup>2/</sup>	CATEGORÍA EN JUNIO DE 2017 <sup>3/</sup>
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Deutsche Securities	1563.66	1756.66	1756.66	1756.66	193.00	I
UBS	652.39	643.51	643.51	643.51	-8.89	I
Barclays Capital	549.43	556.30	556.30	556.30	6.87	I
HSBC	386.67	422.03	422.03	422.03	35.36	I
Credit Suisse	225.76	290.92	290.92	290.92	65.16	I
JP Morgan	257.61	262.40	262.40	262.40	4.79	I
BBVA Bancomer	209.90	249.83	249.83	249.83	39.93	I
Evercore Casa de Bolsa	145.63	218.29	218.29	218.29	72.66	I
Merrill Lynch	183.40	200.95	200.95	200.95	17.55	I
Kuspit	213.88	195.41	195.41	195.41	-18.48	I
Bursamétrica Casa de Bolsa <sup>a/</sup>	333.41	162.76	162.76	162.76	-170.66	I
Vifaru Casa de Bolsa <sup>b/</sup>	145.57	136.80	136.80	136.80	-8.77	I
BTG Pactual CB	120.09	125.70	125.70	125.70	5.61	I
Santander	107.66	109.56	109.56	109.56	1.90	I
Accival	53.34	51.56	51.56	51.56	-1.78	I
Punto Casa de Bolsa	42.23	49.12	49.12	49.12	6.90	I
Morgan Stanley	31.69	38.98	38.98	38.98	7.29	I
Scotia Casa de Bolsa	35.83	36.23	36.23	36.23	0.40	I
Valmex	38.10	33.34	33.34	33.34	-4.76	I
Goldman Sachs CB	27.56	31.15	31.15	31.15	3.59	I
Multiva	40.22	28.88	28.88	28.88	-11.34	I
Inversora Bursátil	28.05	28.87	28.87	28.87	0.82	I
CI Casa de Bolsa	27.32	27.56	27.56	27.56	0.23	I
Monex	20.70	26.53	26.53	26.53	5.83	I
Masari	23.00	24.26	24.26	24.26	1.26	I
Casa de Bolsa Banorte-Ixe	21.48	23.90	23.90	23.90	2.42	I
Intercom	24.04	21.21	21.21	21.21	-2.83	I
CB Ve por Más	21.57	19.68	19.68	19.68	-1.89	I
Casa de Bolsa Base	15.09	17.32	17.32	17.32	2.23	I
GBM	17.27	15.17	15.17	15.17	-2.09	I
Interacciones	13.11	14.95	14.95	14.95	1.84	I
Vector	11.35	13.40	13.40	13.40	2.05	I
Invex	17.14	13.39	13.39	13.39	-3.76	I
Finamex	12.94	12.92	12.92	12.92	-0.02	I
Value	12.65	12.50	12.50	12.50	-0.14	I
Actinver	11.23	12.04	12.04	12.04	0.81	I
<b>Total Casas de Bolsa</b>	<b>26.18</b>	<b>27.11</b>	<b>27.11</b>	<b>27.11</b>	<b>0.93</b>	

<sup>1/</sup> Dado a conocer el 8 de agosto de julio de 2017 por el Banco de México, con base en la información entregada por las casas de bolsa, y de acuerdo con las definiciones contenidas en las Disposiciones.

<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>a/</sup> En marzo de 2017 cambió de denominación social, antes fue Dumbarton Securities.

<sup>b/</sup> En septiembre de 2016 cambió de denominación social, antes fue Itaú BBA Casa de Bolsa.

<sup>i</sup> 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 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:

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

**oOo**