

*“2017, Año del Centenario de la Promulgación
de la Constitución Política de los Estados Unidos Mexicanos”*

Ciudad de México, a 24 de noviembre de 2017

099/2017

COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de septiembre de 2017, el ICAP de las casas de bolsa se ubicó en 28.24%, lo que representó un incremento mensual de 0.12 puntos porcentuales (pp)ⁱ.
- 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 septiembre 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 esta Comisión en términos del artículo 173 de la Ley del Mercado de Valores.

“2017, Año del Centenario de la Promulgación
de la Constitución Política de los Estados Unidos Mexicanos”

CLASIFICACIÓN DE LAS CASAS DE BOLSAⁱⁱ

Cifras al 30 de septiembre de 2017

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN ^{1/}						
Casa de Bolsa	Agosto de 2017	Septiembre de 2017			ICAP, Variación Mensual en pp ^{2/}	Categoría en Agosto de 2017 ^{3/}
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Deutsche Securities	1927.84	1717.96	1717.96	1717.96	-209.88	I
Bursamétrica Casa de Bolsa ^{4/}	845.89	1379.55	1379.55	1379.55	533.66	I
Barclays Capital	569.27	544.80	544.80	544.80	-24.46	I
H SBC	384.60	367.50	367.50	367.50	-17.11	I
JP Morgan	266.37	267.44	267.44	267.44	1.07	I
Credit Suisse	335.87	257.31	257.31	257.31	-78.56	I
UBS	308.39	221.88	221.88	221.88	-86.51	I
Evercore Casa de Bolsa	238.73	208.01	208.01	208.01	-30.72	I
Merrill Lynch	191.32	204.03	204.03	204.03	12.70	I
Kuspit	173.48	174.84	174.84	174.84	1.36	I
BEVA Bancoméxico	296.59	133.25	133.25	133.25	-163.35	I
Santander	120.41	114.65	114.65	114.65	-5.76	I
BTG Pactual CB	120.80	111.88	111.88	111.88	-8.92	I
Vifani Casa de Bolsa ^{5/}	106.02	102.08	102.08	102.08	-3.94	I
Punto Casa de Bolsa	51.67	55.73	55.73	55.73	4.07	I
Accival	52.04	44.45	44.45	44.45	-7.59	I
Morgan Stanley	35.78	39.58	39.58	39.58	3.80	I
Scotia Casa de Bolsa	35.39	39.08	39.08	39.08	3.69	I
Inversora Bursátil	32.43	33.21	33.21	33.21	0.78	I
Valmex	45.08	32.03	32.03	32.03	-13.04	I
Goldman Sachs CB	31.35	30.91	30.91	30.91	-0.44	I
Multiva	27.34	27.31	27.31	27.31	-0.03	I
Masari	27.42	26.96	26.96	26.96	-0.46	I
Monex	28.20	26.08	26.08	26.08	-2.12	I
Casa de Bolsa Banorte-Dre	23.95	25.00	25.00	25.00	1.04	I
CIC Casa de Bolsa	25.75	24.93	24.93	24.93	-0.81	I
Intercam	22.45	20.99	20.99	20.99	-1.46	I
Inveq	17.04	16.81	16.81	16.81	-0.23	I
Casa de Bolsa Base	17.77	16.30	16.30	16.30	-1.46	I
Vector	15.17	16.30	16.30	16.30	1.13	I
GBM	15.95	15.08	15.08	15.08	-0.87	I
Interacciones	16.10	14.84	14.84	14.84	-1.26	I
CB Vector Más	22.14	14.44	14.44	14.44	-7.70	I
Actinver	12.04	13.37	13.37	13.37	1.34	I
Finamex	12.98	13.31	13.31	13.31	0.33	I
Valte	12.58	13.29	13.29	13.29	0.71	I
Total Casas de Bolsa	28.12	28.24	28.24	28.24	0.12	

^{1/} Dado a conocer el 8 de noviembre 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.

^{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 marzo de 2017 cambió de denominación social, antes fue Dumbarton Securities.

^{5/} En septiembre de 2016 cambió de denominación social, antes fue Itaú BBA Casa de Bolsa.

“2017, Año del Centenario de la Promulgación
de la Constitución Política de los Estados Unidos Mexicanos”

- ⁱ 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.
- 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:

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

o0o