

Ciudad de México, a 28 de febrero de 2018

019/2018

COMUNICADO DE PRENSA

- Al cierre de diciembre de 2017, el ICAPⁱ de las casas de bolsa se ubicó en 26.83%.
- 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 diciembre 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.

CLASIFICACIÓN DE LAS CASAS DE BOLSAⁱⁱ

Cifras al 31 de diciembre de 2017

INDICADORES DE CAPITALIZACIÓN ^{1/}						
Casa de Bolsa	Noviembre de 2017	Diciembre de 2017			ICAP, Variación Mensual en pp ^{2/}	Categoría en Diciembre de 2017 ^{3/}
	ICAP %	ICAP %	CCB %	CCF %		
Deutsche Securities	1423.93	602.96	602.96	602.96	-820.97	I
Barclays Capital	558.27	598.65	598.65	598.65	40.38	I
H SBC	309.26	407.19	407.19	407.19	97.93	I
BBVA Bancomer	385.92	382.78	382.78	382.78	-3.14	I
Credit Suisse	167.08	299.81	299.81	299.81	132.73	I
Santander	265.91	282.12	282.12	282.12	16.20	I
Evermore Casa de Bolsa	196.43	259.85	259.85	259.85	63.43	I
JP Morgan	261.71	252.58	252.58	252.58	-9.13	I
Bursamétrica Casa de Bolsa ^{4/}	739.19	224.79	224.79	224.79	-514.40	I
Kusbit	192.98	186.61	186.61	186.61	-6.38	I
UBS	187.48	126.81	126.81	126.81	-60.67	I
BTG Pactual CB	121.12	109.82	109.82	109.82	-11.30	I
Merrill Lynch	128.21	108.44	108.44	108.44	-19.77	I
Vifam Casa de Bolsa	88.88	86.39	86.39	86.39	-2.49	I
Punto Casa de Bolsa	66.16	65.01	65.01	65.01	-1.15	I
Multiva	37.18	43.58	43.58	43.58	6.40	I
Accival	75.67	41.65	41.65	41.65	-34.02	I
Morgan Stanley	37.19	39.39	39.39	39.39	2.20	I
Valmex	34.55	38.25	38.25	38.25	3.71	I
Inversora Bursátil	33.25	37.30	37.30	37.30	4.04	I
Scotia Casa de Bolsa	29.70	36.04	36.04	36.04	6.34	I
Masari	29.81	31.71	31.71	31.71	1.90	I
CI Casa de Bolsa	24.68	31.30	31.30	31.30	6.62	I
Goldman Sachs CB	29.00	27.30	27.30	27.30	-1.70	I
Interam	25.32	26.57	26.57	26.57	1.25	I
Casa de Bolsa Banorte-Ixe	31.85	21.13	21.13	21.13	-10.72	I
GBM	19.34	20.68	20.68	20.68	1.34	I
Monex	23.84	20.40	20.40	20.40	-3.44	I
Casa de Bolsa Base	17.52	19.70	19.70	19.70	2.19	I
Invex	17.25	16.33	16.33	16.33	-0.92	I
CB Vepor Más	13.61	15.29	15.29	15.29	1.68	I
Interacciones	14.21	14.52	14.52	14.52	0.31	I
Vector	13.89	13.69	13.69	13.69	-0.20	I
Valte	12.17	13.31	13.31	13.31	1.14	I
Finamex	15.30	13.18	13.18	13.18	-2.12	I
Actinver	12.14	12.72	12.72	12.72	0.58	I
Total Casas de Bolsa	29.01	26.83	26.83	26.83	-2.18	

^{1/} Dado a conocer el 08 de febrero de 2018 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.

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.

De acuerdo con las Disposiciones:

Índice de Capitalización (ICAP)

$$\text{Coeficiente de Capital Básico (CCB)} = \frac{\text{Capital Fundamental} + \text{Capital No Fundamental}}{\text{Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Total}}$$

Coeficiente de Capital Fundamental (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 acuerdo con las Disposiciones, la composición del capital neto estará formada por una parte básica y una complementaria, así mismo la parte básica, tendrá una parte fundamental y no fundamental.

$$\text{Capital Neto} = \text{Capital Fundamental} + \text{Capital No Fundamental} + \text{Capital Complementario}$$

$$\text{Capital Básico} = \text{Capital Fundamental} + \text{Capital No Fundamental}$$

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