

Versión actualizada el 10 de octubre de 2022

**Preguntas al Manual y al Formulario ESC 2022-2024
derivado de la reunión con la Asociación Mexicana de Intermediarios Bursátiles
(AMIB).**

1. La hoja Liquidez, no considera las aportaciones que las Casas de Bolsa hacemos al Fondo de Reserva, sin embargo, el art. 146 de las Disposiciones se incluye este concepto como parte de la liquidez.

Respuesta: Se modificó el formulario para agregar la fracción IV del artículo 146 de las Disposiciones.

2. El último párrafo del inciso j) hace referencia a que solo se solicitan los valores anuales al cierre de diciembre 2022, diciembre 2023 y diciembre 2024, siendo inconsistente con el Formulario, el cual hace referencia únicamente a diciembre 2022.

Respuesta: Se solicita que el Análisis de Sensibilidades se aplique para los valores anuales al cierre de 2022. Se corrigió el Manual para ser consistente con el Formulario.

3. La pestaña “Impacto de Mercado” del Formulario, señala que se debe de indicar la Metodología utilizada para el impacto.

Respuesta: En caso de que la CB utilice una metodología para el cálculo del impacto del mercado, se solicitará que describa detalladamente en el documento cualitativo la metodología utilizada.

4. El tercer bullet del inciso g) Rentabilidad, señala que se deberá realizar el cálculo de las comisiones cobradas por cuenta de clientes y el cálculo de las comisiones por custodia y administración, las cuales no se mencionan en el formulario.

Respuesta: Las comisiones se eliminaron del Formulario, toda vez que las Limitaciones para la Proyección en Escenarios Adversos, señalados en el numeral 3.2 del Manual, se modificaron. Se corrigió el Manual para ser consistente con el Formulario.

5. Con excepción de la tasa de Cetes 28 días, el dato del 3Q22 de todas las variables difieren entre el escenario supervisor base y supervisor adverso ¿dado que es un trimestre histórico, qué dato debemos considerar como correcto? ¿se reenviará el formulario realizando alguna corrección?

Cabe señalar que, lo anterior sería inconsistente con los escenarios supervisores del ESC para Casas de Bolsa, debido a que los valores de los primeros 3 trimestres de 2022 para ambos escenarios son los mismos.



Respuesta: La información financiera y de solvencia, al tercer trimestre de 2022, debe ser histórica, por lo que la información macroeconómica de dicho periodo no afecta las cifras proyectadas.

6. En el Formulario hay rubros de los Estados financieros que no están considerados, tales como:

- Pagos anticipados y otros activos; Propiedades, mobiliario y equipo; Inversiones permanentes; Pasivo por Préstamo de valores; Pasivo por Beneficios a los empleados; Créditos diferidos y cobros anticipados; Comisiones cobradas por Actividades fiduciarias; Comisiones cobradas por Custodia o administración de bienes.

Respuesta: Los rubros señalados anteriormente, deberán agruparse en “otros activos” u “otros pasivos” según corresponda, y se deberán mencionar en el documento cualitativo las cuentas que, en su caso, integran dichos rubros.

7. ¿Cómo puedo saber si tengo que aplicar ejercicio de sensibilidad?

Respuesta: En el punto 4 del Manual, la tercera columna de la tabla tiene como título “Aplica Sensibilidades”, si la celda está vacía se debe entender que la casa de bolsa no deberá aplicar sensibilidades, por el contrario, si la celda está señalada con “Sí”, significa que la casa de bolsa deberá aplicar el análisis de sensibilidades, conforme lo señala el numeral 3.3. Secciones del Formulario ESC, inciso j) del Manual.

8. El formulario tiene algunos vínculos a archivos externos, ¿Nos pudieran decir cómo proceder con esto por favor?

Respuesta: Se sugiere romper los vínculos, no obstante, se enviará el Formulario que atiende dicho comentario y las observaciones señaladas anteriormente.