

Ciudad de México, a 14 de julio de 2022.



Estimados clientes de VALMER.

Por este conducto, le informamos que el 25 de julio de 2022 se realizará una actualización al reporte Riesgo de Crédito, la cual tiene como intención, robustecer la métrica de tal suerte que los cambios aplicados permiten mantener el reporte apegado a la normatividad vigente. Los cambios fueron validados con las recomendaciones de la SUGEVAL.

Actualmente se considera que para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo crediticio el tratamiento de los instrumentos ETF's es como un título accionario, considerando que es un conjunto diversificado de activos que cotizan en bolsa, de lo anterior se asigna al ponderador 0% de acuerdo con lo señalado en el inciso p del reglamento; considerando las recomendaciones recibidas, el tratamiento que se debe de otorgar a los ETF's es el de un fondo de inversión, es decir, se deberá de buscar su calificación mínima de acuerdo con las calificadoras aprobadas y posteriormente, asignar el ponderador correspondiente al nivel de la calificación. Por lo que aquellas emisiones que no cuenten con una calificación, se les asignará el ponderador del 10%.

Si después de esta actualización presenta algún inconveniente, favor de reportarlo al correo valmerriesgos@grupobmv.com.mx.

Nos reiteramos a sus órdenes sobre el particular y aprovechamos para enviarles un cordial saludo y agradecerles por su preferencia. En VALMER nuestra prioridad es trabajar con dedicación y objetividad para satisfacer las necesidades y requerimientos de nuestros clientes.

Atentamente

Valuación Operativa y Referencias de Mercado