

**RIESGO DE MERCADO**

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	25,163,441	57,100,000	31,936,559
Mercado de Capitales	2,014,936	50,000,000	47,985,064
Mercado de Derivados	16,669,333	24,700,000	8,030,667
VaR Global	37,667,938	81,000,000	43,332,062

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

**RIESGO DE LIQUIDEZ**

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	1,592,963	9,500,000	7,907,037
Mercado de Derivados	7,049,136	9,500,000	2,450,864
VaR Global	8,642,099	14,300,000	5,657,901

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

**RIESGO DE CRÉDITO**

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	-62,334,112	47,600,000	109,934,112
Mercado de Derivados	0	19,000,000	19,000,000

(Horizonte anual, nivel de confianza 97.5%)

El Capital Global sobre el cual se calculan los límites es de 953.11 millones (Feb 16)

**RIESGO OPERATIVO: Severidad de la Pérdida**

Tipo de Pérdida	Pérdida Acumulada marzo 2017	Límite	Límite - Pérdida Acumulada	Excede Límite
Error de comunicación	633,790	999,824	366,034	NO
Falla en reporte obligatorio	14,680	0	-14,680	SI

**Severidad Promedio Mensual**

Tipo de Pérdida	Pérdida Promedio
Error de comunicación	211,263
Falla en reporte obligatorio	4,893

Nota: Cifras en pesos corrientes a marzo.

**Indicadores de Riesgo de Crédito**

<b>CVaR<sub>97.5%</sub></b>	17,444,284
Tasa nominal ponderada del portafolio $\alpha$ (1)	2.88%
Tasa real ponderada del portafolio $\alpha$ (2)	3.27%
Tasa revisable ponderada del portafolio $\alpha$ (3)	0.92%
Ganancia anual esperada por acarrero [ $G(\alpha)$ ]	79,778,396
<b>CVaR<sub>97.5%</sub> ajustado [CVaR<sub>97.5%</sub> - <math>G(\alpha)</math>]</b>	-62,334,112
<b>P [ pérdida &gt; <math>G(\alpha)</math> ]</b>	0.00%

(Horizonte anual, nivel de confianza 97.5%)

**Valores promedio de la exposición por tipo de riesgo**

VaR Mercado	Mercado de Dinero	30,570,000
	Mercado de Capitales	6,770,000
	Mercado de Derivados	13,140,000
	Global	43,130,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

VaR Liquidez	Mercado de Dinero	1,830,000
--------------	-------------------	-----------

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

VaR Crédito	Mercado de Dinero	-60,190,000
-------------	-------------------	-------------

(Horizonte anual, nivel de confianza 97.5%)

Promedio del último trimestre

Unidades monetarias en pesos mexicanos