

RIESGO DE MERCADO

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	12,898,221	57,100,000	44,201,779
Mercado de Capitales	4,627,039	50,000,000	45,372,961
Mercado de Derivados	12,467,757	24,700,000	12,232,243
VaR Global	24,927,892	81,000,000	56,072,108

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

RIESGO DE LIQUIDEZ

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	789,411	9,500,000	8,710,589
Mercado de Derivados	5,731,621	9,500,000	3,768,379
VaR Global	6,521,032	14,300,000	7,778,968

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

RIESGO DE CRÉDITO

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	-44,574,098	47,600,000	92,174,098
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 septiembre 2017	Límite	Límite - Pérdida Acumulada	Excede Límite
Error de comunicación	2,019,434	3,047,581	1,028,147	NO
Falla en reporte obligatorio	14,916	0	-14,916	SI
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	210,566	469,953	259,387	NO

Severidad Promedio Mensual

Tipo de Pérdida	Pérdida Promedio
Error de comunicación	224,382
Falla en reporte obligatorio	1,657
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	23,396

Nota: Cifras en pesos corrientes a septiembre.

Indicadores de Riesgo de Crédito

CVaR_{97.5%}	11,779,547
Tasa nominal ponderada del portafolio α_1)	1.65%
Tasa real ponderada del portafolio α_2)	1.89%
Tasa revisable ponderada del portafolio α_3)	0.69%
Ganancia anual esperada por acarrero [$G(\alpha)$]	56,356,645
CVaR_{97.5%} ajustado [CVaR_{97.5%} - $G(\alpha)$]	-44,574,098
P [pérdida > $G(\alpha)$]	0.00%

(Horizonte anual, nivel de confianza 97.5%)

Valores promedio de la exposición por tipo de riesgo

VaR Mercado	Mercado de Dinero	16,560,000
	Mercado de Capitales	5,340,000
	Mercado de Derivados	11,500,000
	Global	27,860,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

VaR Liquidez	Mercado de Dinero	980,000
--------------	-------------------	---------

(Horizonte semanal, nivel de confianza 97.5%)

VaR Crédito	Mercado de Dinero	-43,990,000
-------------	-------------------	-------------

(Horizonte anual, nivel de confianza 97.5%)

Promedio del último trimestre

Unidades monetarias en pesos mexicanos