

RIESGO DE MERCADO

Tipo de Riesgo	VaR de Mercado	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	5,030,676	33,600,000	28,569,324
Mercado de Capitales	13,093,523	31,700,000	18,606,477
Mercado de Derivados	5,411,347	38,000,000	32,588,653
Portafolio Asset Swaps	0	11,200,000	11,200,000
VaR Global	18,011,054	63,400,000	45,388,946

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE LIQUIDEZ

Tipo de Riesgo	VaR de Liquidez	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	204,478	7,400,000	7,195,522
Mercado de Derivados	1,498,163	9,300,000	7,801,837
VaR Global	1,702,640	11,200,000	9,497,360

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE CRÉDITO

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	-5,478,628	50,400,000	55,878,628
Mercado de Derivados	0	20,100,000	20,100,000

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

El Capital Global sobre el cual se calculan los límites es de 830.58 millones (Jul 20)

RIESGO OPERATIVO: Severidad de la Pérdida

Tipo de Pérdida	Pérdida Acumulada marzo 2021	Límite	Límite - Pérdida Acumulada	Excede Límite
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	874,250	107,636	-766,614	SI
Error de comunicación	755,985	2,239,538	1,483,553	NO
Falla en la operación del modelo o sistema	4,209,176	0	-4,209,176	SI

Severidad Promedio Mensual

Tipo de Pérdida	Pérdida Promedio
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	291,417
Error de comunicación	251,995
Falla en la operación del modelo o sistema	1,403,059

Nota: Cifras en pesos corrientes a marzo.

Indicadores de Riesgo de Crédito

CVaR_{99%}	7,642,526
Tasa nominal ponderada del portafolio (α_1)	2.85%
Tasa real ponderada del portafolio (α_2)	2.25%
Tasa revisable ponderada del portafolio (α_3)	0.81%
Ganancia anual esperada por acarrero [$G(\alpha)$]	13,121,154
CVaR_{99%} ajustado [CVaR_{99%} - $G(\alpha)$]	-5,478,628
P [pérdida > $G(\alpha)$]	0.00%

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

Valores promedio de la exposición por tipo de riesgo

VaR Mercado	Mercado de Dinero	5,240,000
	Mercado de Capitales	12,740,000
	Mercado de Derivados	7,560,000
	Portafolio Asset Swaps	0
	Global	16,760,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Liquidez	Mercado de Dinero	390,000
	Mercado de Derivados	1,520,000
	Global	1,910,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Crédito	Mercado de Dinero	-5,480,000
-------------	-------------------	------------

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

Promedio del último trimestre

Unidades monetarias en pesos mexicanos