

RIESGO DE MERCADO

Tipo de Riesgo	VaR de Mercado	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	10,261,461	12,500,000	2,238,539
Mercado de Capitales	4,119,431	11,800,000	7,680,569
Mercado de Derivados	0	14,200,000	14,200,000
Mesa de Dinero institucional	5,164,245	7,500,000	2,335,755
VaR Global	14,793,898	23,700,000	8,906,102

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE LIQUIDEZ

Tipo de Riesgo	VaR de Liquidez	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	481,755	3,700,000	3,218,245
Mercado de Derivados	0	4,600,000	4,600,000
VaR Global	481,755	5,500,000	5,018,245

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE CRÉDITO

Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mercado de Dinero	-7,717,558	50,400,000	58,117,558
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 279.02 millones (Nov 21)

RIESGO OPERATIVO: Severidad de la Pérdida

Tipo de Pérdida	Pérdida Acumulada diciembre 2021	Límite	Límite - Pérdida Acumulada	Excede Límite
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	926,080	456,071	-470,009	SI
De otras normas	1,365,999	24,719	-1,341,280	SI
Error de comunicación	4,128,670	9,489,239	5,360,569	NO
Falla en la operación del modelo o sistema	4,955,985	0	-4,955,985	SI

Severidad Promedio Mensual

Tipo de Pérdida	Pérdida Promedio
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	77,173
De otras normas	113,833
Error de comunicación	344,056
Falla en la operación del modelo o sistema	412,999

Nota: Cifras en pesos corrientes a diciembre.

Indicadores de Riesgo de Crédito

CVaR_{99%}	1,750,273
Tasa nominal ponderada del portafolio (α_1)	2.82%
Tasa real ponderada del portafolio (α_2)	2.17%
Tasa revisable ponderada del portafolio (α_3)	0.18%
Ganancia anual esperada por acarrero [$G(\alpha)$]	9,467,831
CVaR_{99%} ajustado [CVaR_{99%} - $G(\alpha)$]	-7,717,558
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	9,230,000
	Mercado de Capitales	4,110,000
	Mercado de Derivados	0
	Mesa de Dinero institucional	5,020,000
	Global	13,790,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Liquidez	Mercado de Dinero	390,000
	Mercado de Derivados	0
	Global	390,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Crédito	Mercado de Dinero	-8,700,000
-------------	-------------------	------------

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

Promedio del último trimestre

Unidades monetarias en pesos mexicanos