

RIESGO DE MERCADO			
Tipo de Riesgo	VaR de Mercado	Límite	Límite -VaR
Mesa de Fondeo	63,969,614	69,900,000	5,930,386
Mercado de Capitales	1,992,601	29,900,000	27,907,399
Mercado de Derivados	5,971,922	9,900,000	3,928,078
Portafolio Asset Swap	6,916,024	29,900,000	22,983,976
VaR Global	69,216,389	106,600,000	37,383,611

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE LIQUEDEZ			
Tipo de Riesgo	VaR de Liquedez	Límite	Límite -VaR
Mesa de Fondeo	1,364,414	13,300,000	11,935,586
Mercado de Derivados y Portafolio Asset Swap	5,264,126	26,600,000	21,335,874
VaR Global	6,628,540	39,900,000	33,271,460

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

RIESGO DE CRÉDITO			
Tipo de Riesgo	VaR	Límite	Límite -VaR
Mesa de Fondeo	-11,496,705	33,300,000	44,796,705
Mercado de Derivados	0	6,600,000	6,600,000

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

El Capital Neto sobre el cual se calculan los límites es de 1,332.85 millones (Abril 26)

RIESGO OPERATIVO: Severidad de la Pérdida				
Tipo de Pérdida	Pérdida Acumulada junio 2026	Límite	Límite - Pérdida Acumulada	Excede Límite
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	3,412,188	1,480,980	-1,931,208	SI
Error de comunicación	1,253,051	1,336,837	83,786	NO
De otras normas	13,224,118	337,545	-12,886,573	SI

Severidad Promedio Mensual	
Tipo de Pérdida	Pérdida Promedio
De la normativa aplicable a las casas de bolsa	568,698
Error de comunicación	208,842
De otras normas	2,204,020

Nota: Cifras en pesos corrientes a marzo.

Indicadores de Riesgo de Crédito	
CVaR _{99%}	7,254,784
Tasa nominal ponderada del portafolio (α_1)	1.12%
Tasa real ponderada del portafolio (α_2)	4.49%
Tasa revisable ponderada del portafolio (α_3)	0.53%
Ganancia anual esperada por acarrero [$G(\alpha)$]	18,751,489
CVaR _{99%} ajustado [CVaR _{99%} - $G(\alpha)$]	-11,496,705
P [pérdida > $G(\alpha)$]	0.00%

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

Valores promedio de la exposición por tipo de riesgo		
VaR Mercado	Mesa de Fondeo	58,480,000
	Mercado de Capitales	2,560,000
	Mercado de Derivados	4,440,000
	Portafolio Asset Swap	4,400,000
	Global	62,380,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Liquedez	Mesa de Fondeo	1,260,000
	Mercado de Derivados y Portafolio Asset Swap	3,250,000
	Global	4,510,000

(Horizonte semanal, nivel de confianza 99%)

VaR Crédito	Mesa de Fondeo	-14,940,000
-------------	----------------	-------------

(Horizonte anual, nivel de confianza 99%)

Promedio del último trimestre
Unidades monetarias en pesos mexicanos