Artículo 181 Fracción XVI

Riesgo de mercado

En Banobras el Valor en riesgo (VaR) de mercado se determina aplicando la metodología de VaR Condicional (CVaR) con un horizonte de tiempo de un día hábil, una ventana de 250 datos y un nivel de confianza teórico del 97%.

Los cálculos de CVaR se obtienen para cada una de las mesas de operación del Banco (Mercado de Dinero, Mesa de Cambios y Mesas de Derivados), las cuales consolidan la posición de Banobras.

En el siguiente cuadro, se presenta el CVaR de Banobras, por mesa de operación, de cierre de trimestre y promedio del periodo, así como el porcentaje que representa del Capital Neto:

Portafolio	3er trim 2017					2do trim 2017				
	30/09/2017	% del Capital Neto	Promedio	% del Capital Neto	σ	30/06/2017	% del Capital Neto	Promedio	% del Capital Neto	σ
Banobras	256.32	0.55%	239.26	0.52%	10.51	239.66	0.53%	313.45	0.71%	52.36
Mercado de Dinero	108.98	0.23%	78.22	0.17%	15.41	73.16	0.16%	149.15	0.34%	53.64
Mesa de Cambios	14.39	0.03%	12.62	0.03%	1.48	10.36	0.02%	9.58	0.02%	3.19
Derivados Negociación	9.87	0.02%	9.36	0.02%	0.59	9.50	0.02%	9.74	0.02%	0.22
Derivados Negoc. Estructurales	212.18	0.45%	211.88	0.46%	2.54	216.37	0.48%	223.08	0.50%	4.06
Derivados Negoc. Reclasificación	2.43	0.01%	4.22	0.01%	1.04	4.84	0.01%	4.82	0.01%	0.08

Notas:

- Cifras en millones de pesos
- C.N.: Capital Neto vigente en la fecha de generación del reporte de riesgos de Mercado.
- Los datos de promedio, consumo de Capital Neto promedio y desviación estándar se calculan con los datos diarios observados durante el periodo.