

## Artículo 181 Fracción XVI

### Valor en riesgo de mercado promedio del periodo y porcentaje de su Capital Neto al cierre del periodo

En Banobras el Valor en riesgo (VaR) de mercado se realiza aplicando la metodología de VaR Condicional (CVaR) con un horizonte de tiempo de un día hábil, una ventana de 500 datos y un nivel de confianza teórico del 97%.

Los cálculos de CVaR se obtienen para cada una de las mesas de operación (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	2o trim 2020					1er trim 2020				
	30/06/2020	% CN	Promedio	% CN	$\sigma$	31/03/2020	% CN	Promedio	% CN	$\sigma$
Banobras	332.46	0.52%	321.40	0.52%	8.45	326.40	0.53%	218.19	0.29%	50.00
Mercado de Dinero	200.18	0.31%	200.84	0.32%	5.75	211.00	0.34%	121.60	0.15%	46.09
Mesa de Cambios	39.37	0.06%	33.75	0.05%	6.54	13.11	0.02%	28.76	0.04%	4.43
Derivados Negociación	15.81	0.02%	16.10	0.03%	0.54	14.15	0.02%	8.67	0.01%	1.62
Derivados de Negociación Estructurales	203.72	0.32%	194.10	0.31%	6.25	197.12	0.32%	136.79	0.19%	26.67
Derivados de Negociación por Reclasificación	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Cifras en millones de pesos.

% CN: Cifras como porcentaje del Capital Neto.

Los datos de promedio y desviación estándar se calculan con los datos diarios observados durante el periodo.