

**Artículo 181 Fracción XVIII**

**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, al cierre de trimestre y promedio del periodo, así como el porcentaje que representa del Capital Neto:

Portafolio	1er trim 2024					4to trim 2023				
	27/03/2024	% CN	Promedio	% CN	$\sigma$	29/12/2023	% CN	Promedio	% CN	$\sigma$
Banobras	196.85	0.21%	219.67	0.24%	11.51	236.18	0.25%	267.07	0.29%	13.18
Mercado de Dinero	136.17	0.14%	141.23	0.15%	2.14	140.52	0.15%	149.60	0.16%	5.49
Mesa de Cambios	32.73	0.03%	22.64	0.02%	14.60	45.81	0.05%	78.44	0.09%	14.79
Derivados Negociación	6.63	0.01%	7.34	0.01%	0.33	7.50	0.01%	9.05	0.01%	1.09
Derivados Negoc. Estructurales	139.93	0.15%	148.78	0.16%	4.44	152.19	0.16%	153.83	0.17%	1.10
Derivados Negoc. Reclasificación	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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.