



VALRISK

Concentración Sectorial

Concentración Sectorial: Introducción

El reporte de concentración sectorial mide el grado de concentración que tienen las instituciones de acuerdo a la clasificación de sectores que tiene la Bolsa Mexicana de Valores (BMV).

El principal objetivo es proporcionar información que garantice una administración prudente y un adecuado control en la concentraciones del riesgo de la cartera.

Insumos para generarlo

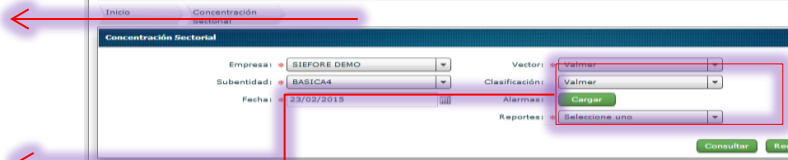
- Información por Sector, Ramo, Sub-ramo, Región y País proporcionados por la Bolsa Mexicana de Valores (BMV)



The screenshot displays the Valmer Grupo BMV web application interface. The top navigation bar includes the Valmer logo and the user email 'Usuario: sorta@valmer.com.mx'. The main navigation menu contains 'Carteras', 'Administración', 'Módulos', 'Reportes', and 'Mi perfil'. The 'Módulos' menu is expanded, showing a list of options: 'VaR Histórico', 'VaR Paramétrico', 'Régimen de Inversión', 'Generación de Reportes', 'Portafolios Experimentales', 'Batch', 'Back Testing', 'Reporte Duración', 'Sensibilidades', 'Stress Testing', 'Riesgo de Crédito', 'Riesgo de Liquidez', 'Inversión en Acciones', and 'Concentración Sectorial' (highlighted in green). The main content area shows 'Administración de carteras' with input fields for 'Fecha' and 'Empresa'.

Concentración Sectorial: Funcionalidad

- Fácil acceso.** Desde cualquier computadora con acceso a internet, de forma segura y a partir de un usuario y contraseña establecidos.
- Vector de precios puede importarse.** El sistema permite utilizar un vector propio definido por el usuario o bien utilizar el de la empresa.
- Modalidad de consulta.** El sistema permite consultar de forma rápida y eficaz la concentración por sector, ramo, región o país.
- Modalidad de reporte en formato Excel.** El sistema permite exportar todos los cálculos realizados para diferentes tipos de análisis.
- Consulta por sector y ramo.** En esta consulta se muestra el sector y ramo el valor total de mercado, la participación del activo, límites y alarmas, así como el monto disponible.
- Consulta por región o país.** Al igual que la consulta por sector y ramo, se muestra un resumen de la concentración a nivel región o país.



Instrumento	Titulos	Precio	Valor de Mercado	País	Región	Sector	Sub Sector
L_KIMBER_A	1589800	30.79	48949942.00	MEXICO	AMERICA	Productos de consumo frecuente	Product...
LD_BONDES_171019	6877619	99.586965	684921202.63633	MEXICO	AMERICA		
LD_BONDES_170622	5567260	99.73362	555242993.28120	MEXICO	AMERICA		
LD_BONDES_190606	3484849	99.200715	345699512.46703	MEXICO	AMERICA		
CD_BAHOB_14-2	2856342	102.976828	294137038.84317	MEXICO	AMERICA		

DATOS ESPECIFICOS POR CLIENTE & CARTERA

CLIENTE	
CARTERA	
FECHA	
ACTIVO TOTAL	\$2,382,432,973.43
CLASIFICACIÓN	Proveedor/Cliente

CONCENTRACIÓN SECTORIAL

SECTOR	LÍMITE	ALARMA	VALOR TOTAL DE MERCADO	% ACTIVO	ESTATUS	CONSUMO	LÍMITE	MONTO DISPONIBLE
Energía	20.00%	19.00%	338,583,098.82	14.24%	FAVORABLE	74.59%	1	112,279,855
Industrial	20.00%	19.00%	222,944,238.50	9.437%	FAVORABLE	43.67%	1	225,918,026
Materiales	20.00%	19.00%	196,338,263.95	8.39%	FAVORABLE	43.14%	1	252,523,991
Productos de consumo frecuente	15.00%	14.25%	597,395,961.17	24.86%	RECURSOS LIMITADO	104.48%	1	250,793,242
Salud	25.00%	23.75%	19,881,000.00	0.82%	FAVORABLE	3.42%	1	541,696,531

RAMO	LÍMITE	ALARMA	VALOR TOTAL DE MERCADO	% ACTIVO	ESTATUS	CONSUMO	LÍMITE	MONTO DISPONIBLE
Equipos y servicios de energía	20.00%	19.00%	26,362,883.16	1.107%	FAVORABLE	5.83%	1	422,833,382
Petróleo gas y combustibles	19.00%	19.00%	310,420,226.67	13.040%	FAVORABLE	63.9%	1	108,442,028
Construcción de viviendas	15.00%	14.25%	15,229,295.61	0.64%	FAVORABLE	4.9%	1	245,074,240
Controladoras	25.00%	23.75%	47,936,491.90	2.02%	FAVORABLE	8.54%	1	353,933,242
Dispositivos electromédicos	20.00%	19.00%	30,946,256.00	1.305%	FAVORABLE	20.24%	1	317,916,060
Infraestructura de transportes	20.00%	19.00%	68,750,295.89	2.90%	FAVORABLE	15.32%	1	380,111,363
Materiales de construcción	20.00%	19.00%	43,018,990.50	1.855%	FAVORABLE	3.74%	1	405,042,254
Metales y minería	15.00%	14.25%	38,825,817.35	1.659%	FAVORABLE	10.34%	1	239,820,881
Productos madereros y papeleros	25.00%	23.75%	812,480.00	0.02%	FAVORABLE	0.1%	1	560,485,051
Productos químicos	20.00%	19.00%	115,080,195.10	4.870%	FAVORABLE	25.64%	1	333,782,959
Alimentos	20.00%	19.00%	154,779,465.19	6.552%	FAVORABLE	34.46%	1	294,062,800
Bebidas	20.00%	19.00%	376,773,623.85	15.94%	FAVORABLE	83.34%	1	72,888,652
Productos domésticos	15.00%	14.25%	41,612,597.32	1.78%	FAVORABLE	12.94%	1	295,034.11
Venta de productor de consumo frecuente	25.00%	23.75%	14,229,276.00	0.602%	FAVORABLE	2.5%	1	546,193,095
Servicios médicos	15.00%	14.25%	19,881,000.00	0.82%	FAVORABLE	5.10%	1	317,485,359

Concentración Sectorial: Funcionalidad

- Información clara y precisa para la administración de Riesgos, y un prudente control de sus concentraciones.

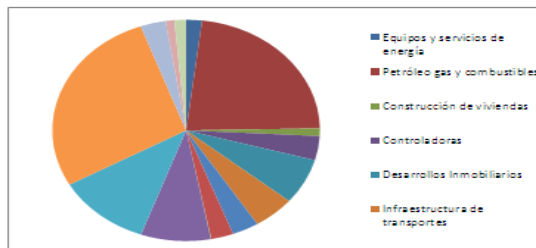
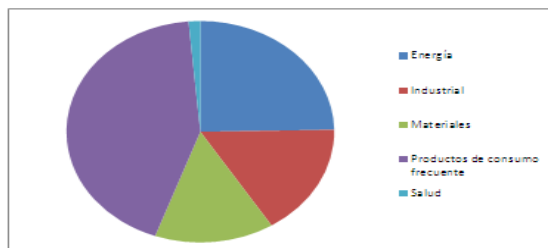
DATOS ESPECIFICOS POR CLIENTE & CARTERA

CLIENTE	
CARTERA	
FECHA	
ACTIVO TOTAL	\$ 2,362,432,973.43
CLASIFICACIÓN	Proveedor/Cliente

CONCENTRACIÓN SECTORIAL

SECTOR	LÍMITE	ALARMA	VALOR TOTAL DE MERCADO	% ACTIVO	ESTATUS	CONSUMO LÍMITE	MONTO DISPONIBLE
Energía	20.00%	19.00%	\$ 336,583,103.82	14.247%	FAVORABLE	74.93%	\$ 112,273,155
Industrial	20.00%	19.00%	\$ 222,944,238.50	9.437%	FAVORABLE	49.67%	\$ 225,918,026
Materiales	20.00%	19.00%	\$ 196,338,363.95	8.311%	FAVORABLE	43.74%	\$ 252,523,301
Productos de consumo frecuente	15.00%	14.25%	\$ 587,385,961.17	24.864%	INCUMPLIMIENTO	114.48%	\$ 250,739,262
Salud	25.00%	23.75%	\$ 19,181,300.00	0.812%	FAVORABLE	3.42%	\$ 541,836,531

RAMO	LÍMITE	ALARMA	VALOR TOTAL DE MERCADO	% ACTIVO	ESTATUS	CONSUMO LÍMITE	MONTO DISPONIBLE
Equipos y servicios de energía	20.00%	19.00%	\$ 26,162,883.15	1.107%	FAVORABLE	5.83%	\$ 422,639,382
Petróleo gas y combustibles	20.00%	19.00%	\$ 310,420,226.67	13.140%	FAVORABLE	69.16%	\$ 138,442,038
Construcción de viviendas	15.00%	14.25%	\$ 15,329,255.61	0.649%	FAVORABLE	4.55%	\$ 321,317,443
Controladoras	25.00%	23.75%	\$ 47,918,481.90	2.028%	FAVORABLE	8.54%	\$ 513,153,349
Desarrollos Inmobiliarios	20.00%	19.00%	\$ 90,946,205.00	3.850%	FAVORABLE	20.26%	\$ 357,916,060
Infraestructura de transportes	20.00%	19.00%	\$ 68,750,295.99	2.910%	FAVORABLE	15.32%	\$ 380,111,869
Materiales de construcción	20.00%	19.00%	\$ 43,819,910.50	1.855%	FAVORABLE	9.76%	\$ 405,042,354
Metales y minería	15.00%	14.25%	\$ 36,825,817.35	1.559%	FAVORABLE	10.94%	\$ 299,820,881
Productos madereros y papeleros	25.00%	23.75%	\$ 612,480.00	0.026%	FAVORABLE	0.11%	\$ 560,465,351
Productos químicos	20.00%	19.00%	\$ 115,090,156.10	4.871%	FAVORABLE	25.64%	\$ 333,782,109
Alimentos	20.00%	19.00%	\$ 154,779,465.19	6.552%	FAVORABLE	34.48%	\$ 294,082,800
Bebidas	20.00%	19.00%	\$ 376,773,632.65	15.949%	FAVORABLE	83.94%	\$ 72,088,632
Productos domésticos	15.00%	14.25%	\$ 41,612,587.32	1.761%	FAVORABLE	12.36%	\$ 295,034,111
Venta de productos de consumo frecuente	25.00%	23.75%	\$ 14,220,276.00	0.602%	FAVORABLE	2.53%	\$ 546,857,555
Servicios médicos	15.00%	14.25%	\$ 19,181,300.00	0.812%	FAVORABLE	5.70%	\$ 317,465,399



Concentración Sectorial: Reporte

El contenido del reporte:

- Sector
 - Límite
 - Alarma
 - Valor de Mercado
 - % Activo
 - Estatus
 - Consumo Límite
 - Monto Disponible
 - Ramo
 - Sector
 - Subsector
 - Ramo
 - Subramo
 - Instrumento
 - Valor total de Mercado
 - Concentración contra Activo Total
 - Instrumentos que no tienen una Clasificación
- Concentración por Región y País
 - Región
 - País
 - Instrumento
 - Valor de Mercado
 - Concentración contra activo Total

El reporte puede personalizarse desde el sistema, elegir en un libro de Excel en que hoja y en que orden o que columnas se desea que aparezca en el reporte de Concentración Sectorial.

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: * Nombre: *

Plantilla base: *

Hoja 1 Hoja 2 Hoja 3 Hoja 4 Hoja 5 Hoja 6 Hoja 7 Hoja 8 Hoja 9 Hoja 10 Hoja 11

Secciones

Disponibles:

- DATOS CLIENTE Y CARTERA PAIS/REGION
- DATOS CLIENTE Y CARTERA SECTOR/RAMO
- DETALLE S/C
- DETALLE S/C
- DETALLE SECTORIAL PAIS
- DETALLE SECTORIAL RAMO
- DETALLE SECTORIAL REGION
- DETALLE SECTORIAL SECTOR
- TOTAL SECTOR REGION
- TOTAL SECTORIAL PAIS

Aplicadas:

Columnas

Guardar