



# VALRISK

---

## Reporte de Duración

# Duración: Introducción

**Duración Modificada:** La duración es un indicador muy útil en el mercado al proporcionar la sensibilidad de un instrumento ante variaciones en las tasas; se define como el cambio en el valor de un bono o instrumento de mercado ante un movimiento en las tasas de interés (yield).

**Duración Macaulay:** Es el plazo promedio ponderado de vencimiento de los flujos de efectivo de un bono. El peso de cada flujo efectivo se determina dividiendo el valor presente de dicho flujo entre el precio.

## Fuentes de información

- Vector de precios
- Cartera

Valmer  
Grupo BMV

Usuario: sorta@valmer.com.mx

Carteras Administración Módulos Reportes Mi perfil

Inicio Administración de carteras

Administración de carteras

Fecha: \*

Empresa: \*

Reporte Duración

Sensibilidades

Stress Testing

Riesgo de Crédito

Riesgo de Liquidez

Inversión en Acciones

# Duración: 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 el reporte de duración.
- Modalidad de reporte en formato Excel.** El sistema permite exportar todos los cálculos realizados para diferentes tipos de análisis.
- Consulta de históricos.** El sistema permite consultar los datos históricos del cálculo de reporte de duración, o bien, recalcularlos.
- Cálculo del reporte de duración y generación de reportes automáticamente y de forma manual.** El sistema permite realizar cargas y generación de reportes de forma automática o manual, a través de un FTP seguro o vía correo electrónico.

## DURACION GENERAL

|                        |                  |
|------------------------|------------------|
| TIPO DE FONDO          | DEMO             |
| CLIENTE                | DEMO             |
| CARTERA                | DEMO             |
| FECHA                  | 31-dic-14        |
| IMPORTE CON INTERESES  | 4,024,136,637.89 |
| NUMERO DE INSTRUMENTOS | 41               |
| VENCIMIENTO PONDERADO  | 973.43           |
| DUR MOD PONDERADA      | 2.13             |
| DUR MAC PONDERADA DIAS | 781.47           |
| DUR MAC PONDERADA      | 2                |

## DURACION CONSOLIDADO

| RANGO (DIAS)         | DESCRIPCION |
|----------------------|-------------|
| 0-360                | 2014        |
| 361-720              | 2015        |
| 721-1080             | 2016        |
| 1081-1440            | 2017        |
| 1441-1800            | 2018        |
| 1801-2160            | 2019        |
| <del>2161-2520</del> | 2020        |
| 2521-2880            | 2021        |
| 2881-3240            | 2022        |
| 3241-3600            | 2023        |
| 3600+                |             |

Mayor a 2023

# Duración: Funcionalidad

- El reporte contiene un resumen por rangos definidos para cada tipo de duración y vencimientos, con información necesaria para obtener un perfil de vencimientos.

## DURACION CONSOLIDADO

| RANGO (DIAS) | DESCRIPCION  | DURACION PROMEDIO PONDERADA (DIAS) |
|--------------|--------------|------------------------------------|
| 0-360        | 2014         | 84.68                              |
| 361-720      | 2015         | 197.94                             |
| 721-1080     | 2016         | 193.41                             |
| 1081-1440    | 2017         | 172.78                             |
| 1441-1800    | 2018         | 49.31                              |
| 1801-2160    | 2019         | 14.96                              |
| 2161-2520    | 2020         | 0.00                               |
| 2521-2880    | 2021         | 0.00                               |
| 2881-3240    | 2022         | 59.00                              |
| 3241-3600    | 2023         | 0.00                               |
| 3600+        | Mayor a 2023 | 201.36                             |

## DURACION DETALLE

| INSTRUMENTO       | TIPO OPERACION | IMPORTE CON INTERESES | DURACION (DIAS) | VENCIMIENTO CONTRACTUAL (DXV) |
|-------------------|----------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------|
| 2P_BANOB01_151106 | D              | 101,351,814.86        | 297             | 310                           |
| 2P_BCM0001_161027 | D              | 10,138,745.43         | 608             | 666                           |
| 90_CBPF_48        | D              | 67,603,329.47         | 5,871           | 11,957                        |
| 90_GDFCB_10       | D              | 10,795,884.48         | 85              | 170                           |
| 91_CATFIN_12      | D              | 16,654,745.61         | 409             | 702                           |
| 91_CICB_08        | D              | 15,615,192.85         | 0               | 1,972                         |
| 91_GASN_11-2      | D              | 96,052,560.25         | 133             | 135                           |
| 91_GCARSO_12      | D              | 25,758,100.25         | 770             | 806                           |
| 91_HSCCB_08       | D              | 6,185,280.85          | 0               | 1,581                         |
| 91_LIVEPOL_12     | D              | 50,663,265.13         | 777             | 813                           |
| 91_METROCB_03-2   | D              | 7,389,266.02          | 0               | 715                           |
| 91_METROCB_04     | D              | 5,644,092.01          | 0               | 715                           |
| 91_MOLYMET_13-2   | D              | 59,161,822.54         | 1,084           | 1,160                         |
| 91_SCRECB_12      | D              | 28,287,114.89         | 730             | 1,049                         |
| 94_BACMENT_11     | D              | 114,213,225.89        | 78              | 79                            |
| 95_CEDAVIS_10-3U  | D              | 898,728.47            | 186             | 8,573                         |
| 95_CEDAVIS_10U    | D              | 3,722,462.15          | 78              | 8,482                         |
| -----             | -              | -----                 | ---             | ---                           |

- Los reportes contienen toda la información necesaria para poder replicar el perfil de vencimientos de la cartera, además de contener información relevante para distintos tipos de análisis.

# Duración: Reporte

## El contenido del reporte:

- Rango (Días)
- Descripción
- Duración Promedio ponderada en días
- Número de Instrumentos Duración
- Importe con Intereses Duración
- Peso en Posición Duración
- Vencimiento Promedio Ponderado en Días
- Número de Instrumentos Vencimiento
- Importe con Intereses Vencimiento
- Peso en Posición Vencimiento
- Rango Duración Macaulay
- Descripción
- Duración Macaulay Ponderada
- Número de Instrumentos
- Importe con Intereses
- Peso en Posición Duración Macaulay
- Rango Duración Modificada
- Duración Modificada Ponderada
- Número de Instrumentos Duración Modificada
- Peso en Posición Duración Modificada
- Instrumento
- Tipo de Operación
- Duración Días
- Vencimiento Contractual
- Duración Macaulay
- Duración Macaulay Ponderada
- Duración Modificada
- Duración Modificada Ponderada

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 Duración.

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: \* Duración Nombre: \*

Plantilla base: \* DURACION

Hoja 1 Hoja 2 Hoja 3 Hoja 4 Hoja 5

Secciones

Disponibles:

- DURACION CONSOLIDADO
- DURACION CONSOLIDADO DURACION MOD
- DURACION CONSOLIDADO MACAULAY
- DURACION DETALLE
- DURACION GENERAL

Aplicadas:

Columnas

Guardar