



VALRISK

Inversión en Acciones

Inversión en Acciones: Introducción

El seguimiento que se debe realizar a las inversiones en vehículos e índices es muy importante para una buena administración de riesgos, ya que contiene información relevante para distintos tipos de análisis como la referencia y el porcentaje del índice del vehículo correspondiente, así como los componentes y los correspondientes porcentajes contra el activo.

Fuentes de información

- Índices/Vehículos
- Referencias
- Composición de la Referencia
- Composición del índice o vehículo
- Cartera

Valmer
GrupoBMV

Usuario: sorta@valmer.com.mx

Carteras Administración **Módulos** Reportes Mi perfil

Inicio Administración de carteras

Administración de carteras

Fecha: * 23/02/2023
Empresa: * Selección

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
Concentración Sectorial

Inversión en Acciones: Funcionalidad

- **Fácil acceso.** Desde cualquier computadora con acceso a internet, de forma segura y a partir de un usuario y contraseña establecidos.
- **Parámetros, referencias e índices pueden importarse en el sistema.** El sistema permite utilizar los parámetros y referencias definidos por el usuario.
- **Modalidad de consulta.** El sistema permite consultar de forma rápida y eficaz el reporte de inversión en acciones.
- **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 inversión en acciones, o bien, recalcularlos.
- **Cálculo de riesgo de inversión en acciones 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.

The screenshot shows the Valmer web application interface. At the top, the Valmer logo and 'Grupo BMV' are visible, along with the user 'sorta@valmer.com.mx' and the date '24 de Febrero, 2015 14:05:32'. A navigation bar includes 'Carteras', 'Administración', 'Módulos', 'Reportes', and 'Mi perfil'. Below this, there are buttons for 'Inicio' and 'Inversión en Acciones'. The main section is titled 'Inversión en Acciones' and contains a form with the following fields: 'Empresa' (SIFORE DEMO), 'Subentidad' (BASICA4), and 'Fecha' (23/02/2015). To the right, there is a 'Vector' dropdown (Valmer) and three 'Cargar' buttons for 'Referencias', 'Índices', and 'Parámetros'. At the bottom right of the form are buttons for 'Consultar', 'Recalcular', and 'Reporte'. Red arrows point from the text in the list to these specific elements in the interface.

DATOS ESPECÍFICOS POR CLIENTE & CARTERA

TIPO FONDO	Siefore
CLIENTE	DEMO
CARTERA	DEMO4
FECHA	13-ene-15
ACTIVO TOTAL	34,858,056,095.05

ÍNDICES VEHÍCULOS

VEHICULO	DESCRIPCION	REFERENCIA
1B_NAFTRAC_ISHRS	INVERSIÓN QUE RÉPLICAN ÍNDICES DE MERCAL	IPC
1C_CORPTRC_ISHRS	INVERSIÓN QUE REPLICAN ÍNDICES DE DEUDA DE MI	VLMR_CORPOTRAC

Inversión en Acciones: Funcionalidad

- El reporte de inversión en acciones nos muestra los porcentajes con respecto al activo neto, pudiendo configurar un parámetro límite y alarmas para conocer el estatus de nuestras inversiones para el buen manejo de régimen de inversión.

COMPONENTES	% ACTIVO NETO	% LIMITE	ALARMA	ESTATUS
11	14.67%	8.00%	95.00%	FAVORABLE
7	0.18%	20.00%	95.00%	FAVORABLE

COMPONENTES

COMPONENTE	INDICE O VEHICULO	REFERENCIA	PRECIO	% INDICE VEHICULO	% REFERENCIA
1_GFNORTE_0	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	75.18	2.329185%	3.700620%
1_LAMX_L	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	16.40	24.143542%	21.924276%
1_GCARSQ_A1	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	68.99	1.062539%	1.253639%
1_GFINBUR_0	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	39.18	1.538973%	2.489441%
1_GEO_B	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	0.00	0.845896%	0.772194%
1_AZTECA_CPO	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	5.97	2.398252%	0.457319%
1_GMEXICO_B	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	40.40	5.389530%	7.549667%
1_AXTEL_CPO	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	3.16	1.430202%	0.328922%
1_URBL'	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	0.00	1.127262%	0.720720%
1_ICH_B	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	67.98	0.267882%	0.388671%
1_MFRISCO_A-1	1B_NAFTRAC_ISHRS	1	20.66	1.063438%	1.390250%
91_HOLDIM_12-2	1C_CORPTRC_ISHRS	2	100.74	0.540000%	0.536638%
91_INCARSD_13	1C_CORPTRC_ISHRS	2	100.27	1.040000%	0.870754%
91_GCARSQ_12	1C_CORPTRC_ISHRS	2	100.70	1.800000%	1.446888%
91_INCARSD_12	1C_CORPTRC_ISHRS	2	100.96	1.740000%	1.453973%
91_IDEAL_11-2	1C_CORPTRC_ISHRS	2	100.44	0.720000%	0.556338%
91_TELMEX_09-4	1C_CORPTRC_ISHRS	2	102.28	0.780000%	1.374528%
91_NEMAK_07	1C_CORPTRC_ISHRS	2	103.18	1.900000%	1.856444%

TITULOS EN DIRECTO	MONTO INVERTIDO EN DIRECTO	MONTO TOTAL INVERTIDO	% MAX PERMITIDO	% ACTIVO NETO
48,250	3,627,435.00	3,711,922.87	2.776050%	0.010600%
101,183,000	1,659,401,200.00	2,060,039,419.30	4.233942%	5.909800%
5,185,700	357,761,443.00	361,562,797.02	2.580296%	1.037200%
4,100,000	160,638,000.00	163,110,175.83	2.679155%	0.467900%
422,734	0.42	0.43	2.541776%	0.000000%
1,600,000	9,552,000.00	9,781,176.56	2.516586%	0.028100%
6,586,000	266,074,400.00	282,011,166.60	3.083973%	0.809000%
2,122,100	6,705,836.00	6,801,743.02	2.506314%	0.019500%

- Los reportes contienen toda la información necesaria para poder replicar los datos necesarios así como poder realizar distintos tipos de análisis para la administración de riesgos.

Inversión en Acciones: Reporte

El contenido del reporte:

- Vehículo
- Descripción
- Referencia
- Títulos
- Precio
- Valor de Mercado
- Rango
- Componentes
- % Activo Neto
- % Límite
- Alarma
- Estatus
- Componente
- Índice o Vehículo
- Referencia
- Precio
- % Índice o Vehículo
- % Referencia
- Monto Invertido
- Títulos en Directo
- Monto Invertido Directo
- Monto Total Invertido
- % Máximo Permitido
- % Activo Neto
- Estatus
- Alarma
- Resumen

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 Inversión en Acciones.

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: * InversionAcciones Nombre: *

Plantilla base: * INVERSION_ACCIONES

Hoja 1 Hoja 2

Secciones Disponibles:

- Detalles
- Totales

Aplicadas:

Columnas

Guardar