



VALRISK

Portafolios
Experimentales

Portafolios Experimentales: Introducción

La simulación de operaciones de compra-venta de instrumentos, de operaciones en reporto o préstamos de valores, posible venta anticipada de alguna posición, en el día a día es un proceso muy importante, ya que en las instituciones para una buena administración de riesgos, debemos procurar mejores prácticas para generar rendimientos y minimizar los riesgos, es por ello que en las inversiones, es necesario conocer como afectarán las operaciones realizadas en la cartera, el riesgo en que se incurrirá de acuerdo a las características de los instrumentos y apegarnos al régimen de inversión de acuerdo a la regulación, o de acuerdo a la propia institución.

Insumos

- Vector de precios
- Operaciones a realizar
- Cartera original

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

Portafolios Experimentales: 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 riesgo mercado, crédito y liquidez, así como sensibilidades para cada uno de nuestros portafolios experimentales.
- **Modalidad de reporte en formato Excel.** El sistema permite exportar todos los cálculos realizados con nuestros portafolios experimentales para diferentes tipos de análisis.
- **Consulta de históricos.** El sistema permite consultar los datos históricos del cálculo de todos los portafolios realizados por el usuario o bien, recalcularlos.
- **Huella de auditoría.** El sistema permite exportar un documento en Excel donde se muestra que usuario y que operaciones simuló, el día y la hora.

The screenshot displays the Valmer web application interface. At the top, the Valmer logo and 'GrupoBMV' are visible, along with the user 'sorta@valmer.com.mx' and the date '24 de Febrero, 2015 19:55:13'. The main navigation bar includes 'Carteras', 'Administración', 'Módulos', 'Reportes', and 'Mi perfil'. The interface is divided into several sections:

- Datos Generales:** A form for entering portfolio details such as 'Empresa' (SIEFORE DEMO), 'Subentidad' (BASICA4), 'Proveedor Precios Matriz' (Valmer), 'Proveedor Precios Vector' (Valmer), and 'Fecha' (13/02/2015).
- Parámetros VaR Paramétrico:** A section with buttons for 'Nuevo', 'Duplicar', 'Consultar', 'Operaciones', 'Experimental', 'Derivados', and 'Eliminar'.
- Cartera:** A table showing portfolio holdings with columns for 'Tipo Valor', 'Emisora', 'Serie', 'Consecutivo', 'Tipo Invers...', and 'Títulos'. The table lists various bond holdings from BONS, CHHCB, PEMEX, and TFOVIS.
- Operaciones:** A section for managing transactions, including a 'Resumen VaR Histórico' and 'Resumen Régimen Inversión'.
- Resumen VaR Histórico:** A comparison of VaR results for 'Experimental' and 'Original' scenarios, showing 'VaR del portafolio', 'VaR portafolio %', 'Fecha del escenario', 'Activo Total', and 'Activo sin estructurados'.

Portafolios Experimentales: Funcionalidad

- El sistema permite la carga desde un archivo en Excel de las operaciones que se desean realizar para cada uno de los fondos que conforman la operadora, además de un archivo con posiciones totalmente nuevas para la generación de una experimental desde cero.

Tipo Entidad:
SIEFORES BASICA

Escenarios:
26

Activos:
67013144354.39

Parámetros VaR Paramétrico

Nuevo Duplicar Consultar

Operaciones Experimental

Derivados Eliminar

Swaps | Forwards | Opciones

Tipo: IRS Fecha de Valuación: 13/02/2015

Emisora: 1EURLEU

Contraparte: American Express (...)

Nocional: 1000000

Archivo:

Entrega:

Recibe:

Datos

Nocional	Entrega	Recibe
Convención		
Periodo		
Vencimiento	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Amortiza		

Valuación

Valor Recibe	Valor Entrega	Valor Swap	Fecha del Escenario	Numero del Escenario	Valor de diferencia

Var:

- El sistema permite simular operaciones de derivados OTC, ya que cuenta con calculadoras que crean la matriz de diferencias del instrumento y lo ingresan en los vectores y tablas correspondientes para poder calcular medidas de riesgo, todo a partir de un calendario en formato Excel si se requiere, o simplemente ingresar datos básicos.