



VALRISK

Régimen de Inversión
CONSAR

Régimen de Inversión: Introducción

Conforme a la normatividad emitida por la CONSAR, cada cliente deberá establecer alarmas tempranas sobre el consumo de los parámetros señalados en las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión, además, se deberá cumplir con las exigencias de computo para cada uno de los rubros que componen el mismo.

Fuentes de información

- Archivos Contables.
- Vector de Precios
- Características Instrumentos
- Catálogos CONSAR
- Prospectos
- Front VALMER especializado en computo régimen de CONSAR.

Valmer
Grupo BMV

Usuario: sorta@valmer.com.mx

Carteras Administración Módulos Reportes Mi perfil

Inicio Administración de carteras

Administración de carteras

Fecha: *
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

Régimen de Inversión: Funcionalidad

- Fácil acceso.** Desde cualquier computadora con acceso a internet, de forma segura y a partir de un usuario y contraseña establecidos.
- Modalidad de consulta.** El sistema permite consultar de forma rápida y eficaz el régimen de Inversión.
- Simulaciones intradía:** El sistema permite simular operaciones de compra-venta para tener una visión clara de como afectará en el régimen de inversión.
- 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 régimen de inversión, o bien, recalcularlos.

Concepto	Monto	% Activo	Estatus	Alarma
Emisoras Relacionadas	\$1,758,533,185.12	3.464918%	FAVORABLE	14.47%
Contraparte Reporto (Anexo A)	\$67,005,628.83	0.132024%	FAVORABLE	4.78%
Mismo Emisor (Anexo D, E, H, I)	\$11,417,490.44	0.022496%	FAVORABLE	0.77%
Monto en Circulación	N/A	18.803302%	FAVORABLE	34.13%
Nexos Patrimoniales	\$0.00	.0%	FAVORABLE	4.83%
Mismo Emisor (SGI)	\$5,158,389.86	0.010164%	INCUMPLIMIENTO	.0%
Mismo Emisor (Anexo A, F y J)	\$1,149,144,893.47	2.264213%	FAVORABLE	4.78%
Instrumentos en Udis o de tasa real	\$8,954,862,091.64	17.644173%	ALARMA	100%

DATOS ESPECIFICOS POR CLIENTE & CARTERA

CLIENTE	SIFORE DEMO
CARTERA	BASICA4
FECHA	26-mar-15
ACTIVO TOTAL	59,856,985,221.89
ACTIVO TOTAL SIN ESTRUCTURADOS	47,523,698,534.83
NIVEL DE CONFIANZA	94.80%
VECTOR	Valmer
MATRIZ	Valmer

Régimen de Inversión: Funcionalidad

- El reporte en Excel muestra el detalle de cada uno de los rubros que la empresa tiene para computo, de acuerdo al tipo de calculo de cada uno de estas clasificaciones. Además, el reporte permite visualizar un resumen de todos los rubros con una etiqueta de si se está favorable o desfavorable, y la revisión del detalle de cada uno de estos rubros por separado.

Otros Estructurados	1R_PBFFLCX_12	1,982,350	125,842,222.00
Otros Estructurados	1R_PMCPOK_10	230,000	25,633.00
			963,156,988.64

VALORES EXTRANJEROS

CONCEPTO	EMISION	TITULOS	MONTO	% ACTIVO TOTAL
Valores Extranjeros	DR_MER_12-07	65	70,379,290.77	0.14%
Valores Extranjeros	DR_IPM_1-07	5,108	54,451,204.01	0.11%
Valores Extranjeros	DR_MER_5-06	408	45,618,219.90	0.09%
Valores Extranjeros	DR_MER_1-06	717	68,827,011.58	0.14%
Valores Extranjeros	DR_CS-USA_1-06	2,666	28,746,989.46	0.06%
Valores Extranjeros	DR_MGFUND_1-06	278	28,942,609.21	0.06%
			296,965,324.94	0.59%
Valores Extranjeros	11_MLY_*	141,782	159,621,063.42	0.31%
			159,621,063.42	0.31%

RESUMEN RÉGIMEN DE INVERSIÓN

CONCEPTO	MONTO	POC. ACTIVO TOTAL	NIVEL ALARMA	PARAMETRO
Instrumentos en Udis o de tasa real	8,953,681,571.65	14.96%	min. 100.00%	max. 100.00%
Bursatilizados	65,455,111.66	0.11%	max. 28.95%	max. 30.00%
Estructurados	2,482,325,894.51	4.15%	max. 19.11%	max. 20.00%
Estructurados Infraestructura y Vivienda n:	2,119,168,905.87	3.54%	max. 12.54%	max. 13.00%
Otros Estructurados	361,976,488.64	0.60%	max. 6.76%	max. 7.00%
Divisas	10,834,992,559.27	18.10%	max. 28.66%	max. 30.00%
Renta Variable	18,455,497,511.18	30.83%	max. 38.61%	max. 40.00%
Valores Extranjeros	9,456,653,088.37	15.80%	max. 19.11%	max. 20.00%
Nexos Patrimoniales	0.00	0.00%	max. 4.83%	max. 5.00%
Emisoras Relacionadas	1,757,352,665.13	2.94%	max. 14.47%	max. 15.00%
Mismo Emisor (Anexo A, F y J)	1,147,964,373.48	1.92%	max. 4.78%	max. 5.00%
Mismo Emisor (Anexo B y G)	311,867,768.60	0.52%	max. 2.93%	max. 3.00%
Mismo Emisor (Anexo C)	0.00	0.00%	max. 1.95%	max. 2.00%
Mismo Emisor (Anexo D, E, H, I)	10,236,970.45	0.02%	max. 0.77%	max. 1.00%
Mismo Emisor (Diferentes Anexos)	78,819,107.53	0.13%	max. 4.88%	max. 5.00%
Mismo Emisor (SGI)	3,977,869.87	0.01%	max. 0.00%	max. 0.00%
Monto en Circulación	176,171,715.24	0.29%	max. 34.13%	max. 35.00%
Contraparte Reporto (Anexo A)	65,825,108.83	0.11%	max. 4.78%	max. 5.00%
Contraparte Reporto (Anexo B)	0.00	0.00%	max. 2.93%	max. 3.00%
Contraparte Reporto (Anexo C)	0.00	0.00%	max. 1.95%	max. 2.00%
VaR	617,895,945.70	1.032287%	max. 2.01%	max. 2.10%
Diferencial VaR	98,626,260.97	0.164770%	max. 0.75%	max. 0.80%

- El reporte contiene a detalle cada uno de los rubros para poder realizar cualquier tipo de réplica con respecto al computo definido por la CONSAR.

Régimen de Inversión: Reporte

El contenido del reporte:

- Resumen
- Instrumentos en Udis o Tasa Real
- Bursatilizados
- Estructurados
- Estructurados Infraestructura y Vivienda
- Otros Estructurados
- Divisas
- Renta Variable
- Valores Extranjeros
- Nexos Patrimoniales
- Emisoras Relacionadas
- Mismo Emisor (Anexo A, F y J)
- Mismo Emisor (Anexo B y G)
- Mismo Emisor (Anexo C)
- Mismo Emisor (Anexo D, E, H, I)
- Mismo Emisor Diferentes Anexos
- Mismo Emisor(Sin Grado de Inversión)
- Monto en Circulación
- Contraparte en Reporte (Anexo A)
- Contraparte en Reporto (Anexo B)
- Contraparte en Reporto (Anexo C)
- VaR
- Diferencial VaR
- Monto
- Porcentaje Activo Total
- Nivel Alarma
- Parámetro
- % Consumo de Límite
- Monto Disponible
- Estatus
- Concepto
- Emisión
- Títulos
- Consecutivo
- Títulos en Cartera
- Títulos Totales todos los Fondos
- Títulos Emitidos
- % del Monto en Circulación
- Emisor
- Moneda

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 Régimen de Inversión.

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: * Régimen de inversión 2 Nombre: *

Plantilla base: * REGIMEN_INVERSION

Hoja 1 Hoja 2 Hoja 3 Hoja 4 Hoja 5 Hoja 6 Hoja 7 Hoja 8 Hoja 9 Hoja 10 Hoja 11 Hoja 12

Secciones

Disponibles:

- CONTRAPARTE EN REPORTE
- DESGLOSE DE LOS PARÁMETROS POR INSTRUMENTO
- DESGLOSE MISMO EMISOR
- Datos de cliente y cartera
- Depositos Bancarios
- Divisas
- Emisoras Relacionadas
- Instrumentos en Udis o de tasa real
- Montos en Circulación
- Nexos Patrimoniales

Aplicadas:

Columnas