



# VALRISK

---

Reporte Global

# Reporte Global: Introducción

El Reporte Global es un consolidado de diversos reportes generados, es decir, un resumen que contiene la información más relevante de cada uno de los riesgos calculados como son mercado, crédito liquidez y sensibilidades, además de un prudente desglose de valuación y factores de riesgo que afectan la cartera.

## *Fuentes de Información*

- Riesgo de Crédito
- Riesgo de Liquidez
- VaR Histórico
- VaR Paramétrico
- Sensibilidades

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

# Reporte Global: 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 Global.
- **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 Global, o bien, recalcularlos.

## EXPOSICIÓN GLOBAL

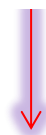
FECHA	14-Ene-15
TIPO DE FONDO	demo
CLIENTE	demo

## RESUMEN DE LÍMITES

RIESGO	CALCULADO \$
ACTIVO TOTAL	500,347,525.00
ACTIVO TOTAL SIN ESTRUCTURADOS	
MERCADO PARAMÉTRICO	26,008.88
MERCADO HISTÓRICO	13,590.12
MERCADO MONTECARLO	
RÉGIMEN	
CREDITO	2,333,454.12
LÍQUIDEZ	219,765.23

# Reporte Global: Funcionalidad

IMPORTE	PESO	PARAMÉTRICO \$	PARAMÉTRICO %
515,818,147.97	100.000000%	26,008.88	0.005200%
28,363,544.18	5.498700%	1,103.20	0.000200%
9,663,041.28	1.873300%	628.88	0.000100%
9,663,041.28	1.873300%	628.88	0.000100%
18,700,502.91	3.625400%	474.32	0.000100%
18,700,502.91	3.625400%	474.32	0.000100%
121,175,083.80	23.491800%	1,528.94	0.000300%
3,001,559.91	0.581900%	69.13	0.000000%
3,001,559.91	0.581900%	69.13	0.000000%
118,173,523.89	22.909900%	1,459.81	0.000300%
118,173,523.89	22.909900%	1,459.81	0.000300%
366,279,519.99	71.009400%	23,376.74	0.004700%
307,823,715.99	59.676800%	5,716.05	0.001100%
89,875,562.24	17.423900%	0.00	0.000000%
112,348,784.90	21.780700%	3,971.66	0.000800%
20,677,306.81	4.008600%	343.89	0.000100%
84,922,062.05	16.463600%	1,400.49	0.000300%
58,455,804.00	11.332600%	17,660.69	0.003500%
58,455,804.00	11.332600%	17,660.69	0.003500%
515,818,147.97	0.000000%	26,008.88	0.005200%



- El Reporte Global muestra los activos con mayor exposición a riesgo de mercado paramétrico, a riesgo de crédito, a riesgo de liquidez, detalle de todos los insumos, calificaciones de los instrumentos, valuación y sensibilidades, así como los factores de riesgo.

# Reporte Global: Reporte

## ***El contenido del reporte:***

- Detalle Por Tipo de Riesgo
  - Importe
  - Peso
  - Paramétrico \$
  - Paramétrico %
  - P Limite
  - P Alarma
  - P Estatus
  - Histórico \$
  - Histórico %
  - H Limite
  - H Alarma
  - H Estatus
  - Crédito \$
  - Crédito %
  - C Limite
  - C Alarma
  - C Estatus
- Liquidez \$
  - Liquidez %
  - L Limite
  - L Alarma
  - L Estatus
  - Total \$
  - 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 Reporte Global

Inicio Diseñar Reporte

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: \* Reporte Consolidado Nombre: \*

Plantilla base: \* Seleccione uno