



VALRISK

Riesgo de Liquidez

Riesgo de Liquidez: Introducción

El riesgo de liquidez es la pérdida que pudiera presentarse por la venta de una posición a descuentos inusuales debido a condiciones extraordinarias de mercado (riesgo de liquidez exógeno)

Fuentes de información

- Posturas de los últimos 6 meses para cada acción reportadas por el Área de Estadística de la Bolsa Mexicana de Valores.
- Precios de las acciones.
- Niveles de bursatilidad reportados por la BMV.
- Precios Bid-Ask y de cierre para cada acción en la moneda de origen reportados por Proveedores Internacionales.
- Posturas en el mercado de los Brókers Electrónicos.

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

Riesgo de Liquidez: 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 de liquidez.
- **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 riesgo de liquidez, o bien, recalcularlos.
- **Cálculo de riesgo de liquidez 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.

REPORTE DE RIESGO DE LIQUIDEZ POR FACTOR DE RIESGO

| | |
|------------------------------------|-------------------|
| CARTERA | BASICA4 |
| CLIENTE | SIEFORE DEMO |
| FECHA | 13-feb-15 |
| ACTIVO TOTAL | 67,013,144,354.39 |
| RIESGO LIQUIDEZ \$ | 221,834,001.34 |
| VALOR PORTAFOLIO | 67,013,207,025.80 |
| RIESGO LIQUIDEZ % ACTIVO TOTAL | 0.331031% |
| RIESGO LIQUIDEZ % VALOR PORTAFOLIO | 0.331030% |
| LIMITE | 1.35% |
| ALARMA | 95.00% |
| STATUS | FAVORABLE |
| STRESS 1 | 2 |
| STRESS 2 | 4 |
| STRESS 3 | 6 |
| STRESS 4 | 8 |
| STRESS 5 | 10 |
| STRESS 1 \$ | 372,956,278.85 |
| STRESS 2 \$ | 670,172,345.61 |
| STRESS 3 \$ | 960,907,766.79 |
| STRESS 4 \$ | 1,245,417,826.47 |
| STRESS 5 \$ | 1,523,943,397.05 |
| STRESS 1 % | 0.556542% |
| STRESS 2 % | 1.000061% |
| STRESS 3 % | 1.433909% |
| STRESS 4 % | 1.858468% |
| STRESS 5 % | 2.274096% |

Riesgo de Liquidez: Funcionalidad

- Definición de escenarios de estrés en la misma pantalla de consulta. El usuario puede definir los cinco escenarios de estrés disponibles, para afectar las volatilidades del spread para el riesgo de liquidez.

Valmer Grupo BMV

Usuario: sorta@valmer.com.mx 16 de Febrero, 2015 18:35:34

Salir

Carteras Administración Módulos Reportes Mi perfil

Inicio Riesgo de Liquidez

Riesgo de Liquidez

Empresa: SIFORE DEMO Proveedor de Precios de Matrices: Valmer

Subentidad: BASICA4 Proveedor de Precios de Vectores: Valmer

Fecha: 13/02/2015

Stress 1: 2 Stress 2: 4 Stress 3: 6 Stress 4: 8 Stress 5: 10

Consultar Recalcular

| INSTRUMENTO | MONTO INVERTIDO | TIPO DE CALCULO | BURSATLIDAD | ULTIMO HECHO | SPREAD PROMEDIO | COSTO SPREAD | VOLATILIDAD SPREAD | COSTO VOLATILIDAD | FRL |
|-------------------|------------------|------------------|-------------|--------------|-----------------|--------------|--------------------|-------------------|-----------|
| 1B_NAFTRAC_ISHRS | 3,223,207,898.60 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.000503 | 0.000000 | 0.000098 | 0.000000 | 0.070017% |
| 1I_EWC_* | 1,082,979,996.61 | RV INTERNACIONAL | 0.000000 | 0.010000 | 0.000406 | 0.000000 | 0.000149 | 0.000000 | 0.070445% |
| 1R_MRPCK_12 | 334,017,288.91 | PRECIO | 0.000000 | 0.000000 | 0.000090 | 0.000000 | 0.000512 | 0.000000 | 0.111435% |
| 1R_PLANICK_12 | 132,552,537.10 | PRECIO | 0.000000 | 0.000000 | 0.000120 | 0.000000 | 0.000947 | 0.000000 | 0.201436% |
| 1_AC_* | 195,200,116.65 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.002146 | 0.000000 | 0.000970 | 0.000000 | 0.408620% |
| 1_BACHOCO_B | 64,476,642.40 | RV NACIONAL | MEDIA | 0.000000 | 0.003273 | 0.000000 | 0.001495 | 0.000000 | 0.626242% |
| 1_BIMBO_A | 58,760,892.00 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.001478 | 0.000000 | 0.000655 | 0.000000 | 0.278859% |
| 1_SORIANA_B | 44,722,758.00 | RV NACIONAL | MEDIA | 0.000000 | 0.004856 | 0.000000 | 0.002159 | 0.000000 | 0.917360% |
| 1_TEAK_CPO | 140,950,490.00 | RV NACIONAL | BAJA | 0.000000 | 0.004856 | 0.000000 | 0.002159 | 0.000000 | 0.917360% |
| 1_TLEVISA_CPO | 70,419,314.40 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.000825 | 0.000000 | 0.000508 | 0.000000 | 0.184179% |
| 1_VESTA_* | 850,023,914.04 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.003585 | 0.000000 | 0.001455 | 0.000000 | 0.649470% |
| 1_WALMEX_V | 409,753,270.08 | RV NACIONAL | ALTA | 0.000000 | 0.000921 | 0.000000 | 0.000335 | 0.000000 | 0.159099% |
| 91_MEXCHEM_12 | 244,510,414.88 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000000 | 0.000181 | -0.103853 | 0.000366 | -0.209266 | 0.477423% |
| 91_RCO_12U | 245,268,155.26 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000000 | 0.000280 | -1.176423 | 0.000405 | -1.703245 | 0.879102% |
| 91_RCO_14 | 124,658,957.99 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000000 | 0.000153 | -0.116001 | 0.000366 | -0.276114 | 0.640506% |
| LD_BONDES0_190606 | 346,291,556.95 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000035 | 0.000055 | -0.022294 | 0.000081 | -0.032831 | 0.088434% |
| LD_BONDES0_191003 | 283,284,414.87 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000035 | 0.000055 | -0.023844 | 0.000081 | -0.035113 | 0.094697% |
| M_BONDS_241205 | 1,950,044,125.33 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000050 | 0.000087 | -0.078725 | 0.000105 | -0.095006 | 0.199689% |
| S_UDIBONO_401115 | 5,299,074,027.35 | POSTURAS | 0.000000 | 0.000235 | 0.000124 | -1.257143 | 0.000158 | -1.601239 | 0.730446% |

67,013,207,025.80

- Los reportes contienen toda la información necesaria para poder replicar el factor de riesgo de liquidez, así como el estrés para cada uno de ellos.

Riesgo de Liquidez: Reporte

El contenido del reporte:

- Instrumento
- Títulos
- Tipo de Inversión
- Monto Invertido
- Tipo de Cálculo
- Precio Limpio
- Precio Limpio 24 H
- Precio Sucio
- Precio Sucio 24H
- Precio Limpio Promedio
- Duración
- Convexidad
- Nivel Bursatilidad
- Último Hecho
- Spread Promedio
- Costo del Spread
- Volatilidad del Spread
- Costo de la Volatilidad
- Composición
- Factor Riesgo Liquidez
- Riesgo Liquidez por instrumento
- Contribución Pérdida Potencial %
- Estrés (Escenario1)
- Estrés (Escenario2)
- Estrés (Escenario3)
- Estrés (Escenario4)
- Estrés (Escenario5)
- Resumen de Cartera

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 Riesgo de Liquidez.

Configuración de una nueva plantilla para reportes

Tipo de cálculo: * Riesgo de Liquidez Nombre: *

Plantilla base: * RIESGO_LIQUIDEZ_GENERAL

Hoja 1 Hoja 2

Secciones Disponibles: DATOS GENERALES

Secciones Aplicadas: DETALLE RIESGO LIQUIDEZ

Columnas

Guardar