

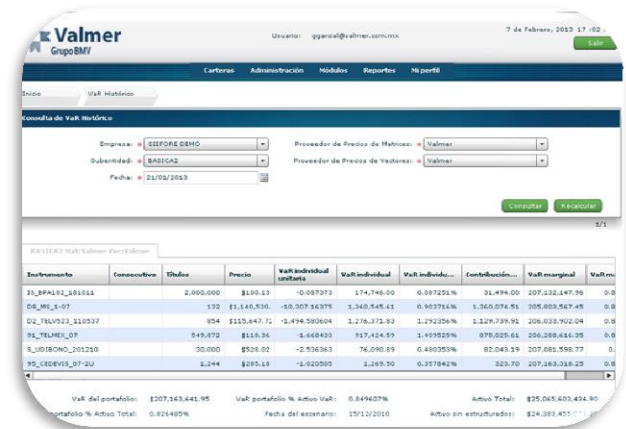
¿Realmente conoces cuál es tu riesgo?



V@Irisk es una solución integral para la gestión de riesgos financieros, cuenta con el soporte de un equipo de expertos, que permite a las instituciones financieras y a las tesorerías corporativas tomar decisiones de inversión monitoreando los riesgos. No se requiere de la compra de licencias ya que el acceso es por vía web segura https, cuenta con huella de auditoría y cumple con la normativa vigente.

Módulos de Riesgo:

- ✓ VaR Histórico
- ✓ VaR Paramétrico
- ✓ Portafolios Experimentales
- ✓ Concentrado de Duración
- ✓ Estrés de Mercado
- ✓ Backtesting de Mercado
- ✓ Riesgo de Crédito
- ✓ Inversión en Acciones
- ✓ Riesgo de Liquidez
- ✓ Régimen de Inversión
- ✓ Sensibilidades
- ✓ Sensibilidad de Derivados
- ✓ PV01
- ✓ VaR Montecarlo
- ✓ Escenarios de Crisis
- ✓ Concentración Sectorial
- ✓ Reporte de Riesgos Global



Instrumento	Consecutivo	Título	Precio	VaR individual unitaria	VaR individual	VaR individual...	Contribución...	VaR marginal	VaR m...
IS_BPALE1_081011		2,000,000	\$100.13	-0.097373	174,746.00	0.087251%	31,494.00	207,332,147.36	0.8
DE_M8_1-07	132	\$1,140,830	-0.30754375	3,340,545.41	0.503714%	1,360,074.81	308,803,547.45	0.8	
DE_TELV92_110327	894	\$115,447.71	-1.494380604	1,276,371.83	1.272256%	1,129,739.91	206,028,902.04	0.8	
SL_TELME0_07	549,872	\$118.36	-1.668433	917,424.59	1.49525%	875,025.41	206,288,416.35	0.8	
S_UD18OMO_101210	30,000	\$709.02	-2.536363	76,090.89	0.480353%	82,043.19	207,081,598.77	0.8	
SL_C4DEV9_07-20	1,244	\$395.18	-1.020085	1,249.50	0.37842%	323.70	207,163,718.25	0.8	

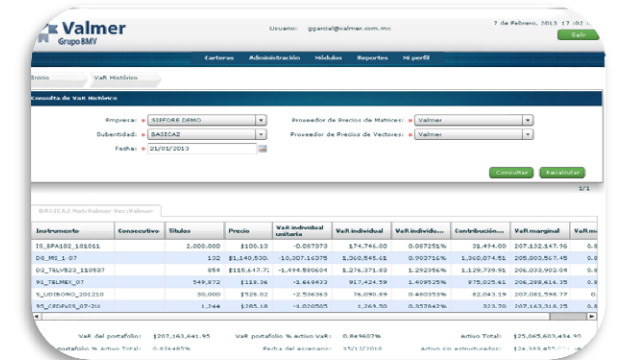
VaR del portafolio: \$207,163,718.25 VaR portafolio % Activo VaR: 0.849678% Activo Total: \$25,045,403,434.90
 Portafolio % Activo Total: 0.824485% Fecha del escenario: 17/12/2010 Activo en estructura: \$24,383,455,111.11

Outsourcing Reportes:

- ✓ Valores Extremos
- ✓ Liquidez por Calce
- ✓ Escenarios de Crisis
- ✓ Coeficiente de Liquidez
- ✓ Profundidad de Mercado
- ✓ Rendimiento Ajustado por Riesgo
- ✓ Reporte Ejecutivo
- ✓ Risk Ratios
- ✓ Perfil de Vencimientos
- ✓ Estructuras Vinculadas
- ✓ Tracking error

Funcionalidad del Sistema:

- ✓ Carga automática y manual
- ✓ Control de Usuarios
- ✓ Personalización de Reportes
- ✓ Huella de Auditoría
- ✓ Módulo Batch
- ✓ Reportes por Periodos
- ✓ Pantalla de Consulta
- ✓ Entrega de Reportes Automática



Instrumento	Consecutivo	Título	Precio	VaR individual unitaria	VaR individual	VaR individual...	Contribución...	VaR marginal	VaR m...
IS_BPALE1_081011		2,000,000	\$100.13	-0.097373	174,746.00	0.087251%	31,494.00	207,332,147.36	0.8
DE_M8_1-07	132	\$1,140,830	-0.30754375	3,340,545.41	0.503714%	1,360,074.81	308,803,547.45	0.8	
DE_TELV92_110327	894	\$115,447.71	-1.494380604	1,276,371.83	1.272256%	1,129,739.91	206,028,902.04	0.8	
SL_TELME0_07	549,872	\$118.36	-1.668433	917,424.59	1.49525%	875,025.41	206,288,416.35	0.8	
S_UD18OMO_101210	30,000	\$709.02	-2.536363	76,090.89	0.480353%	82,043.19	207,081,598.77	0.8	
SL_C4DEV9_07-20	1,244	\$395.18	-1.020085	1,249.50	0.37842%	323.70	207,163,718.25	0.8	

VaR del portafolio: \$207,163,718.25 VaR portafolio % Activo VaR: 0.849678% Activo Total: \$25,045,403,434.90
 Portafolio % Activo Total: 0.824485% Fecha del escenario: 17/12/2010 Activo en estructura: \$24,383,455,111.11