

Análisis de Sensibilidad de PROF-B4 [1]		
Factor	Cambio en el factor	Cambio en el fondo
Tasa Nominal	-/+ 1 pb	+/-0.000096
Tasa Real	-/+ 1 pb	+/-0.000348
Divisas	-/+ 1 pb	+/-0
Sensibilidad	-/+ 1 pb	+/-0.000445

[1] Al 30-ago-2019

Valor en Riesgo, por día de PROF-B4 [1]	
Límite	2.10
VaR	0.516678

[1] Al 30-ago-2019

Rendimiento de gestión últimos 36 meses de PROF-B4 [1]	
[1] Al 31-jul-2019	7.60

[1] Es el rendimiento que obtuvieron los activos de las SIEFORES antes de comisiones sobre saldo

Fuente: CONSAR

La información presentada no debe interpretarse como una recomendación en ningún sentido.

Estructura de comisiones por administración de las cuentas [1]	
Sobre saldo [2]	0.99

[1] Al 31-jul-2019

[2] Porcentaje anual.

Desglose del Riesgo de Crédito y Liquidez de PROF-B4				
Sector	Calificación	Plazo a vencimiento promedio (días)	Monto (miles)	Posición porcentual
Gobierno Federal			56,920,194	60.6%
Otro			20,199,623	21.5%
	Otros		5,742,124	6.1%
	Derivados		-1,620,745	-1.7%
	Capitales		16,078,243	17.1%
Europeso		3,497	405,176	0.4%
	A	1,128	81,540	0.1%
	A-	3,497	184,989	0.2%
	BBB+	1,802	138,647	0.1%
Energía		4,092	1,105,123	1.2%
	AA+	3,137	707,161	0.8%
	AA-	1,586	328,461	0.3%
	A- ≥	4,092	69,502	0.1%
Industrial		2,012	438,399	0.5%
	AAA	1,751	365,444	0.4%
	AA+	2,012	72,955	0.1%
Materiales		2,844	108,772	0.1%
	AA	919	69,368	0.1%
	AA-	2,844	39,403	0.0%
Productos de consumo		2,818	1,497,040	1.6%
	AAA	1,286	704,203	0.8%
	AA+	2,759	314,330	0.3%
	AA	1,833	377,602	0.4%
	AA-	2,818	56,571	0.1%
	A- ≥	876	44,335	0.0%
Servicios de Telecomunicaciones		6,461	1,518,498	1.6%
	AAA	895	742,129	0.8%
	AA+	3,400	117,541	0.1%
	AA-	2,151	644,029	0.7%
	A- ≥	6,461	14,800	0.0%
Servicios financieros		5,868	10,767,999	11.5%
	AAA	2,648	10,526,403	11.2%
	AA+	1,275	238,703	0.3%
	AA-	4,953	99	0.0%
	A- ≥	5,868	2,794	0.0%
Infraestructura		7,070	731,290	0.8%
	AAA	7,070	364,645	0.4%
	AA+	4,376	217,628	0.2%
	A+	4,624	149,017	0.2%
Estados, municipios y provincias		1,828	162,361	0.2%
	AAA	1,828	162,361	0.2%
Total General			93,854,475	100.0%