

Análisis de Sensibilidad de PROF-B3 [1]		
Factor	Cambio en el factor	Cambio en el fondo
Tasa Nominal	-/+ 1 pb	+/-0.000092
Tasa Real	-/+ 1 pb	+/-0.000345
Divisas	-/+ 1 pb	+/-0
Sensibilidad	-/+ 1 pb	+/-0.000437

[1] Al 28-jun-2019

Valor en Riesgo, por día de PROF-B3 [1]	
Límite	1.40
VaR	0.473528

[1] Al 28-jun-2019

Rendimiento de gestión últimos 36 meses de PROF-B3 [1]	
[1] Al 31-may-2019	7.48

[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-may-2019

[2] Porcentaje anual.

Desglose del Riesgo de Crédito y Liquidez de PROF-B3					
Sector	Calificación	Plazo a vencimiento promedio (días)	Monto (miles)	Posición porcentual	
Gobierno Federal			117,558,171	61.4%	
Otro			31,423,661	16.4%	
	Otros		8,942,519	4.7%	
	Derivados		-5,542,850	-2.9%	
	Capitales		28,023,992	14.6%	
Europeso			3,560	1,132,355	0.6%
	IA	1,191	228,435	0.1%	
	IA-	3,560	516,316	0.3%	
	IBBB+	1,865	387,604	0.2%	
Energía			4,155	4,318,271	2.3%
	AAA	1,416	1,594,736	0.8%	
	AA+	2,494	2,384,714	1.2%	
	A- ≥	4,155	338,821	0.2%	
Industrial			2,075	1,001,292	0.5%
	AAA	1,814	834,642	0.4%	
	AA+	2,075	166,651	0.1%	
Materiales			2,907	313,477	0.2%
	AA	982	221,118	0.1%	
	AA-	2,907	92,359	0.0%	
Productos de consumo			2,881	3,784,290	2.0%
	AAA	1,349	1,945,646	1.0%	
	AA+	2,822	721,442	0.4%	
	AA	1,896	862,280	0.5%	
	AA-	2,881	132,498	0.1%	
	A- ≥	939	122,425	0.1%	
Servicios de Telecomunicaciones			6,524	6,142,092	3.2%
	AAA	1,435	4,334,005	2.3%	
	AA-	2,214	1,763,497	0.9%	
	A- ≥	6,524	44,590	0.0%	
Servicios financieros			5,261	23,388,449	12.2%
	AAA	2,696	23,387,142	12.2%	
	AA+	5,261	877	0.0%	
	AA-	5,016	224	0.0%	
	A- ≥	186	206	0.0%	
Infraestructura			7,133	1,861,546	1.0%
	AAA	7,133	885,895	0.5%	
	AA+	4,439	484,797	0.3%	
	AA-	4,687	490,854	0.3%	
Estados, municipios y provincias			1,891	393,904	0.2%
	AAA	1,891	393,904	0.2%	
<b>Total General</b>			<b>191,317,509</b>	<b>100.0%</b>	