



ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO

Exposición al Riesgo de Tasa de Interés, Moneda y Reajustabilidad
(Cifras en millones de pesos)

Información al 30 de Junio de 2014

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	31.020
Exposición al Riesgo de Moneda	349
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	31.369
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	15.376
Límite	
Patrimonio Efectivo	181.535
MARGEN DISPONIBLE	134.790
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	3.722
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	371
Límite	
999% Margen Acumulado	65.414
MARGEN DISPONIBLE	61.321
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	403
Límite	
10% Patrimonio Efectivo	18.153
MARGEN DISPONIBLE	17.750

Conforme a Normas Financieras capítulo III B.2 del Banco Central de Chile

Estado Trimestral de Exposición a los Riesgos de Mercado

Control y publicación de la Exposición a los Riesgos de Mercado:

Conforme a lo dispuesto por el Banco Central de Chile, en el inciso primero del número 2.15 del capítulo III B.2 y el número 28 del Capítulo 12-9 de la Recopilación Actualizada de Normas de la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras, se efectúa la publicación trimestral al 30 de Junio de 2014, según lo siguiente:

Posición de Riesgos de Mercado y su medición:

La Exposición al Riesgo de Mercado se mide y controla a través de la diferencia entre los saldos de activos y pasivos en moneda extranjera (posición neta) y los flujos de efectivo por pagar (asociados a partidas del pasivo) y de efectivo por cobrar (asociados a partidas del activo), en el Libro de Negociación y Libro de Banca, para un determinado plazo o banda temporal.

Las posiciones en moneda extranjera y descalses de plazo están expuestos a diferentes factores de ajustes, sensibilidad y cambios de tasa.

Exposiciones a los Riesgos

La Exposición al Riesgo de Mercado se determinará sobre los siguientes riesgos:

- Riesgo de Tasa de Interés
- Riesgo de Moneda
- Riesgo Gamma
- Riesgo Vega
- Riesgo de Reajustabilidad

RAFAEL CONTRERAS M.
Gerente Control Financiero

ALFONSO EYZAGUIRRE L.
Gerente General

JPMORGAN MERCADO

15X6

14/07/14