

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 2015

	MMS
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	30,344
Exposición al Riesgo de Moneda	0
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	30,344
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	21,310
Límite	
Patrimonio Efectivo	206,154
MARGEN DISPONIBLE	154,500
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	4,637
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	13
Límite	
999% Margen Acumulado	50,760
MARGEN DISPONIBLE	46,110
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	202
Límite	
10% Patrimonio Efectivo	20,615
MARGEN DISPONIBLE	20,413

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 2015, 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 descalces 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