

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 Septiembre de 2013

	MMM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	14,619
Exposición al Riesgo de Moneda	0
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	14,619
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	12,675
Límite	181,535
Patrimonio Efectivo	181,535
MARGEN DISPONIBLE	154,241
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	3,299
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	350
Límite	64,748
999% Margen Acumulado	64,748
MARGEN DISPONIBLE	61,099
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	246
Límite	18,153
10% Patrimonio Efectivo	18,153
MARGEN DISPONIBLE	17,907

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

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 Septiembre de 2013, 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 descuales 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.

ALFONSO EYZAGUIRRE L.