

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 2011

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	14.009
Exposición al Riesgo de Moneda	0
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	14.009
6% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	12.214
Límite	179.856
Patrimonio Efectivo	159.533
MARGEN DISPONIBLE	159.533
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	2.505
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	316
Límite	79.849
99% Margen Acumulado	77.028
MARGEN DISPONIBLE	77.028
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	365
Límite	17.985
10% Patrimonio Efectivo	17.921
MARGEN DISPONIBLE	17.921

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 2011, 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 expuestas 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

VICENTE MONGE A.
Gerente General