

J.P.Morgan

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 31 de Diciembre de 2014

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	26.065
Exposición al Riesgo de Moneda	0
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	26.065
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	27.001
Límite	
Patrimonio Efectivo	207.045
MARGEN DISPONIBLE	153.979
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	4.427
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	20
Límite	
999% Margen Acumulado	75.625
MARGEN DISPONIBLE	71.178
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	195
Límite	
10% Patrimonio Efectivo	20.704
MARGEN DISPONIBLE	20.510

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 31 de Diciembre 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 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