

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 Marzo de 2013

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	11.304
Exposición al Riesgo de Moneda	0
Riesgo Gamma	0
Riesgo Vega	0
Exposición Riesgo de Mercado	11.304
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	12.728
Límite	
Patrimonio Efectivo	181.535
MARGEN DISPONIBLE	157.503
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	3.136
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	335
Límite	
999% Margen Acumulado	61.132
MARGEN DISPONIBLE	57.661
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	267
Límite	
10% Patrimonio Efectivo	18.153
MARGEN DISPONIBLE	17.886

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 Marzo 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 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

VICENTE MONGE A.
Gerente General

JPMORGAN MERCADO
15X6
12/04/13