

## **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 del numeral 1.15 del capítulo III B.2.2 y el número 28 del Título I del capítulo 12-21 de la Recopilación Actualizada de Normas de la Comisión para el mercado financiero, se efectúa la publicación trimestral al 30 de Septiembre de 2022, 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 los Libros de Negociación y de Banca, para un determinado plazo o banda temporal.

Las posiciones en moneda extranjera y descalses de plazo están expuestos a diferentes factores de ajustes, sensibilidad y cambios de tasa.

Banco Security estima su exposición a riesgos de mercado de su libro de negociación en función de metodología estandarizada.

### **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 de Reajustabilidad.

**ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO**
**Conforme a Normas Financieras capítulo III B.2.2 del Banco Central de Chile:**

Exposición al Riesgo de Tasa de Interés, Monedas y Reajustabilidad

(Cifras en millones de pesos)

Información al 30 de Septiembre de 2022

<b>Exposición de corto plazo de riesgo de tasa de interés y reajustabilidad del libro banca (Cuadro 1, C40)</b>	
Exposición de Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	29.807
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	3.201
Comisiones Sensibles a Tasa de Interés (cifras últimos 12 meses acumulados)	191
<b>Limite:</b> 35% x Diferencia Ingresos y Gastos Intereses y Reajustes + Comisiones Sensibles a tasa interés	112.761
<b>Margen Disponible</b>	<b>79.562</b>
<b>Exposición de largo plazo de tasa de interés del libro banca</b>	
Exposición de Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	22.674
<b>Limite:</b> 25% x Patrimonio Efectivo	278.883
<b>Margen Disponible</b>	<b>256.209</b>

**ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO**

(Cifras en millones de pesos)

Información al 30 de Septiembre de 2022

<b>Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)</b>		
<b>Individual (Cuadro 2, R07)</b>		
APRM	APR	Capital
Riesgo General de Tasas	152.728	12.218
Riesgo Específico de Tasas	9	1
Riesgo de Moneda	6.990	559
Riesgo de Opciones		
Riesgo General de Acciones		
Riesgo Específico de Acciones		
<b>Total</b>	<b>159.727</b>	<b>12.778</b>

  

<b>Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)</b>		
<b>Consolidado</b>		
APRM	APR	Capital
Riesgo General de Tasas	156.755	12.540
Riesgo Específico de Tasas	11.419	913
Riesgo de Moneda	6.894	552
Riesgo de Opciones		
Riesgo General de Acciones	5.601	448
Riesgo Específico de Acciones	5.568	445
<b>Total</b>	<b>186.236</b>	<b>14.899</b>