

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 descalces 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

Exposición de corto plazo de riesgo de tasa de interés y reajustabilidad del libro banca (Cuadro 1, C40)	
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
Limite: 35% x Diferencia Ingresos y Gastos Intereses y Reajustes + Comisiones Sensibles a tasa interés	112.761
Margen Disponible	79.562
Exposición de largo plazo de tasa de interés del libro banca	
Exposición de Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	22.674
Limite: 25% x Patrimonio Efectivo	278.883
Margen Disponible	256.209

ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO

(Cifras en millones de pesos)

Información al 30 de Septiembre de 2022

Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)		
Individual (Cuadro 2, R07)		
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		
Total	159.727	12.778

Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)		
Consolidado		
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
Total	186.236	14.899