



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 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 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 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.

Exposiciones a los Riesgos

Las Exposición al Riesgo de Mercado se determinará sobre los siguientes riesgos:
Riesgo de Tasa de Interés
Riesgo de Moneda
Riesgo de Reajustabilidad.

BBVA

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasas de Interés	73.116.-
Exposición al Riesgo de Moneda	2.545.-
Exposición de Riesgo de Mercado	75.661.-
8% Activos Ponderados por Riesgo de Crédito	470.367.-
Límite Patrimonio Efectivo	776.363.-
Margen Disponible	230.335.-
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	11.108.-
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	7.834.-
Menor Ingreso Comisiones	16.-
Límite 40% Margen Acumulado	68.423.-
Margen Disponible	49.465.-
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	93.962.-
Límite 35% Patrimonio Efectivo	271.727.-
Margen Disponible	177.765.-