



CITIBANK N.A. (Agencia en 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 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 30 de Septiembre de 2006, 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.

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.

Información al 30 de Septiembre de 2006

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasa de Interés	19.455.-
Exposición al Riesgo de Moneda	2.958.-
Exposición al Riesgo de Mercado	22.413.-
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	91.729.-
Límite	
Patrimonio Efectivo	278.677.-
MARGEN DISPONIBLE	164.535.-
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	16.016.-
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	2.730.-
Menor Ingreso Comisiones	453.-
Límite	
30 % Margen Acumulado	32.037.-
MARGEN DISPONIBLE	12.838.-
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	19.667.-
Límite	
30% Patrimonio Efectivo	83.513.-
MARGEN DISPONIBLE	63.846.-