



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 2007, 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 2007

MM\$

Exposición al Riesgo de Tasa de Interés	30.428
Exposición al Riesgo de Moneda	175
Exposición al Riesgo de Mercado	30.603
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	128.071
Límite	
Patrimonio Efectivo	327.218
MARGEN DISPONIBLE	168.544
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	14.721
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	286
Menor Ingreso Comisiones	-
Límite	
30 % Margen Acumulado	35.356
MARGEN DISPONIBLE	20.349
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	20.878
Límite	
30% Patrimonio Efectivo	98.194
MARGEN DISPONIBLE	77.316