



## **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 31 de Diciembre de 2005, 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.

|                                                     |                  |
|-----------------------------------------------------|------------------|
|                                                     | MMS              |
| Exposición al Riesgo de Tasa de Interés             | 12.646.-         |
| Exposición al Riesgo de Moneda                      | 167.-            |
| <b>Exposición al Riesgo de Mercado</b>              | <b>12.813.-</b>  |
| 8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito            | 78.863.-         |
| <b>Límite</b><br>Patrimonio Efectivo                | 240.939.-        |
| <b>MARGEN DISPONIBLE</b>                            | <b>149.263.-</b> |
| Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés | 7.575.-          |
| Exposición al Riesgo de Reajustabilidad             | 1.509.-          |
| Menor Ingreso Comisiones                            | 458.-            |
| <b>Límite</b><br>30 % Margen Acumulado              | 28.702.-         |
| <b>MARGEN DISPONIBLE</b>                            | <b>19.160.-</b>  |
| Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés | 11.490.-         |
| <b>Límite</b><br>30% Patrimonio Efectivo            | 72.282.-         |
| <b>MARGEN DISPONIBLE</b>                            | <b>60.792.-</b>  |