



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 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 31 de Diciembre de 2006

	MM\$
Exposición al Riesgo de Tasa de Interés	18.304.-
Exposición al Riesgo de Moneda	576.-
Exposición al Riesgo de Mercado	18.881.-
8% Activos Ponderados por Riesgo Crédito	92.203.-
Límite	
Patrimonio Efectivo	278.329.-
MARGEN DISPONIBLE	167.245.-
Exposición Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	9.114.-
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	2.383.-
Menor Ingreso Comisiones	0.-
Límite	
30 % Margen Acumulado	29.512.-
MARGEN DISPONIBLE	18.016.-
Exposición Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	15.331.-
Límite	
30% Patrimonio Efectivo	83.554.-
MARGEN DISPONIBLE	68.223.-