

## **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 1.15 del capítulo III B.2.2 y el número 28 del Título I del capítulo 12-21 de la Recopilación Actualizada de Normas de la Comisión para el mercado financiero, se efectúa la publicación trimestral al 31 de Marzo de 2023, 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.

Banco Security estima su exposición a riesgos de mercado de su libro de negociación en función de metodología estandarizada.

### **Exposiciones a los Riesgos:**

La Exposición al Riesgo de Mercado se determinará sobre los siguientes riesgos:

- Riesgo de Tasa de Interés.
- Riesgo de Moneda.
- Riesgo de Reajustabilidad.

**ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO**

**Conforme a Normas Financieras capítulo III B.2.2 del Banco Central de Chile:**

Exposición al Riesgo de Tasa de Interés, Monedas y Reajustabilidad

(Cifras en millones de pesos)

Información al 31 de Marzo de 2023

<b>Exposición de corto plazo de riesgo de tasa de interés y reajustabilidad del libro banca (Cuadro 1, C40)</b>	
Exposición de Corto Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	33.890
Exposición al Riesgo de Reajustabilidad	247
Comisiones Sensibles a Tasa de Interés (cifras últimos 12 meses acumulados)	222
<b>Limite:</b> 35% x Diferencia Ingresos y Gastos Intereses y Reajustes + Comisiones Sensibles a tasa interés	135.068
<b>Margen Disponible</b>	<b>100.709</b>
<b>Exposición de largo plazo de tasa de interés del libro banca</b>	
Exposición de Largo Plazo al Riesgo de Tasa de Interés	27.029
<b>Limite:</b> 25% x Patrimonio Efectivo	300.565
<b>Margen Disponible</b>	<b>273.536</b>

**ESTADO TRIMESTRAL DE EXPOSICIÓN A LOS RIESGOS DE MERCADO**

(Cifras en millones de pesos)

Información al 31 de Marzo de 2023

<b>Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)</b>		
<b>Individual (Cuadro 2, R07)</b>		
APRM	APR	Capital
Riesgo General de Tasas	197.739	15.819
Riesgo Específico de Tasas	9	1
Riesgo de Moneda	1.245	100
Riesgo de Opciones		
Riesgo General de Acciones		
Riesgo Específico de Acciones		
<b>Total</b>	<b>198.994</b>	<b>15.920</b>

  

<b>Activos Ponderados por Riesgo de Mercado (APRM)</b>		
<b>Consolidado</b>		
APRM	APR	Capital
Riesgo General de Tasas	200.446	16.036
Riesgo Específico de Tasas	12.625	1.010
Riesgo de Moneda	1.606	128
Riesgo de Opciones		
Riesgo General de Acciones	226	18
Riesgo Específico de Acciones	193	15
<b>Total</b>	<b>215.096</b>	<b>17.208</b>