

RIESGO DE MERCADO

LIMITES E INDICADORES DE GESTION

Verificación realizada con datos al 31/08/2016

A- Determinación de la cartera de Negociación

Portafolio de Negocios: <i>Valores nominales</i>	4.616.220	Cartera de Negociacion: <i>Valores nominales</i>	4.474.219
Cartera a Valores Contables:	3.831.751		
Coficiente de Aplicación:	92%	Limite de Aplicación:	> a 85%

B- Determinación del Var

Valor de la Cartera <i>Calculada por el modelo</i>	4.259.202	VaR 1 día	22.401
Coficiente de Riesgo: <i>Var / Valor de la Cartera</i>	0.53 %	Limite de Riesgo:	< a 4%

C- Relación Riesgo Vs RPC

Coficiente Comparativo: <i>Var / RPC</i>	1.91%	Limite Comparativo:	> a 1%
Indice de Liquidez (LCR)	1.39	Limite de Liquidez:	<= a 1