

RIESGO DE MERCADO

LIMITES E INDICADORES DE GESTION

Verificación realizada con datos al 30/12/2016

A- Determinación de la cartera de Negociación

Portafolio de Negocios: <i>Valores nominales</i>	5.993.509 *	Cartera de Negociacion: <i>Valores nominales</i>	5.618.377 *
Cartera a Valores Contables:	5.893.393 *		
Coefficiente de Aplicación:	91,24%	Limite de Aplicación:	> a 85%

B- Determinación del Var

Valor de la Cartera <i>Calculada por el modelo</i>	5.533.276 *	VaR 1 día	16.426 *
Coefficiente de Riesgo: <i>Var / Valor de la Cartera</i>	0,30%	Limite de Riesgo:	< a 4%

C- Relación Riesgo Vs RPC

Coefficiente Comparativo: <i>Var / RPC</i>	1,17%	Limite Comparativo:	> a 1%
Indice de Liquidez (LCR)	1,26	Limite de Liquidez:	<= a 1

* Expresado en miles de pesos