

## RIESGO DE MERCADO

### LIMITES E INDICADORES DE GESTION

Verificación realizada con datos al 30/06/2017

#### A- Determinación de la cartera de Negociación

<b>Portafolio de Negocios:</b> <i>Valores nominales</i>	<b>6.042.289 *</b>	<b>Cartera de Negociacion:</b> <i>Valores nominales</i>	<b>6.031.400 *</b>
<b>Cartera a Valores Contables:</b>	<b>6.655.457 *</b>		

#### B- Determinación del Var

<b>Valor de la Cartera</b> <i>Calculada por el modelo</i>	<b>6.098.142 *</b>	<b>VaR 1 día</b>	<b>9.892 *</b>
<b>Coficiente de Riesgo:</b> <i>Var / Valor de la Cartera</i>	<b>0,16%</b>	<b>Limite de Riesgo:</b>	<b>&lt; a 4%</b>

#### C- Relación Riesgo Vs RPC

<b>Coficiente Comparativo:</b> <i>Var / RPC</i>	<b>0,67%</b>	<b>Limite Comparativo:</b>	<b>&lt; a 1%</b>
<b>Indice de Liquidez (LCR)</b>	<b>1,26</b>	<b>Limite de Liquidez:</b>	<b>&gt;= a 1</b>

\* Expresado en miles de pesos