

RIESGO DE MERCADO

LIMITES E INDICADORES DE GESTION

Verificación realizada con datos al 29/09/2017

A- Determinación de la cartera de Negociación

Portafolio de Negocios: <i>Valores nominales</i>	6.016.289 *	Cartera de Negociación: <i>Valores nominales</i>	5.976.900 *
Cartera a Valores Contables:	6.103.800 *		

B- Determinación del Var

Valor de la Cartera <i>Calculada por el modelo</i>	5.947.927 *	VaR 1 día	11.102 *
Coefficiente de Riesgo: <i>Var / Valor de la Cartera</i>	0,61%	Limite de Riesgo:	< a 4%

C- Relación Riesgo Vs RPC

Coefficiente Comparativo: <i>Var / RPC</i>	0,69%	Limite Comparativo:	< a 1%
Coefficiente de Liquidez Ácida	1,48	Limite de Liquidez:	>= a 1

* Expresado en miles de pesos