

## RIESGO DE MERCADO

### LIMITES E INDICADORES DE GESTION

Verificación realizada con datos al 31/03/2018

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

<b>Portafolio de Negocios:</b>	<b>5.317.416 *</b>	<b>Cartera de Negociación:</b>	<b>5.060.310 *</b>
<i>Valores nominales</i>		<i>Valores nominales</i>	
<b>Cartera a Valores Contables:</b>	<b>4.980.853 *</b>		

#### B- Determinación del Var

<b>Valor de la Cartera</b>	<b>5.304.721 *</b>	<b>VaR 1 día</b>	<b>6.011 *</b>
<i>Calculada por el modelo</i>			
<b>Coficiente de Riesgo:</b>	<b>0,11%</b>	<b>Limite de Riesgo:</b>	<b>&lt; a 4%</b>
<i>Var / Valor de la Cartera</i>			

#### C- Relación Riesgo Vs RPC

<b>Coficiente Comparativo:</b>	<b>0,32%</b>	<b>Limite Comparativo:</b>	<b>&lt; a 1%</b>
<i>Var / RPC</i>			
<b>Coficiente de Liquidez Ácida</b>	<b>1,32</b>	<b>Limite de Liquidez:</b>	<b>&gt;= a 1</b>

\* Expresado en miles de pesos