

Información al Público Sobre

La Exposición a los Riesgos de Mercado

Al 30 de Junio de 2019

Control y publicación de la Exposición a los Riesgos de Mercado

Conforme a las disposiciones contenidas en el Capítulo III.B.2.2 del Compendio de Normas Financieras del Banco Central de Chile y el Capítulo 12-21 de la Recopilación Actualizada de Normas de la Comisión para el Mercado Financiero, se realiza la publicación trimestral de Bank of China, Agencia en Chile, al 30 de Junio de 2019.

Política de Riesgo de Mercado

La gestión de riesgo de mercado de Bank of China, Agencia en Chile, cubre el riesgo de tasa de interés, el riesgo de tipo de cambio y el riesgo inflacionario de cualquier operación registrada en el balance general del banco sobre la base de su ámbito de negocios.

Bank of China, Agencia en Chile, realiza sus mediciones de riesgo mercado mediante la adopción del modelo estándar, cuyos criterios se encuentran establecidos en las normas del Banco Central de Chile y la Comisión para el Mercado Financiero.

El control y medición del riesgo mercado, son parte integrante de la política de gestión de riesgo de mercado, aprobada por el Comité Ejecutivo del Banco.

Estado Trimestral de Exposición a los Riesgos de Mercado

Cifras en Millones de pesos al 30-06-2019

Exposición a los riesgos de mercado según modelos normativos:

Conforme a las Normas Financieras capítulo III.B.2.2 del Banco Central de Chile y al capítulo 12-21 de la Recopilación Actualizada de Normas de la Comisión para el Mercado Financiero, el detalle de las métricas regulatorias respecto a los límites de riesgo mercado al cierre del mes de junio 2019 es el siguiente:

Limite N°1 (Uso de capital)

Exposición al riesgo de moneda de todo el balance	316.365.169
Exposición al riesgo de tasa de interés del libro negociación	0
Exposición a Riesgo de Mercado (ERM)	316.365.169
8% de activos ponderados por riesgos de créditos	1.143.593.127
ERM + 8% APRC	1.459.958.296
Limite Normativo Patrimonio Efectivo	32.987.096.568
Margen Disponible	31.527.138.272

Limite N°2 (Corto Plazo)

Exposición de corto plazo al riesgo de tasa de interés	580.439.018
Exposición al riesgo de reajustabilidad	45.295.190
Menor ingreso por comisiones sensible a las tasas de interés	0
Riesgo total de Corto Plazo	625.734.208
Límite interno de 999,9% (Ingresos Netos+ Reajustes + Comisiones Sensibles)	10.935.606.048
Margen Disponible	10.309.871.840

Limite N°3 (Largo Plazo)

Exposición de largo plazo al riesgo de tasa de interés	71.675.378
Patrimonio Efectivo	32.987.096.568
Límite interno 15 % del Patrimonio Efectivo	4.948.064.485
Margen Disponible	4.876.389.107