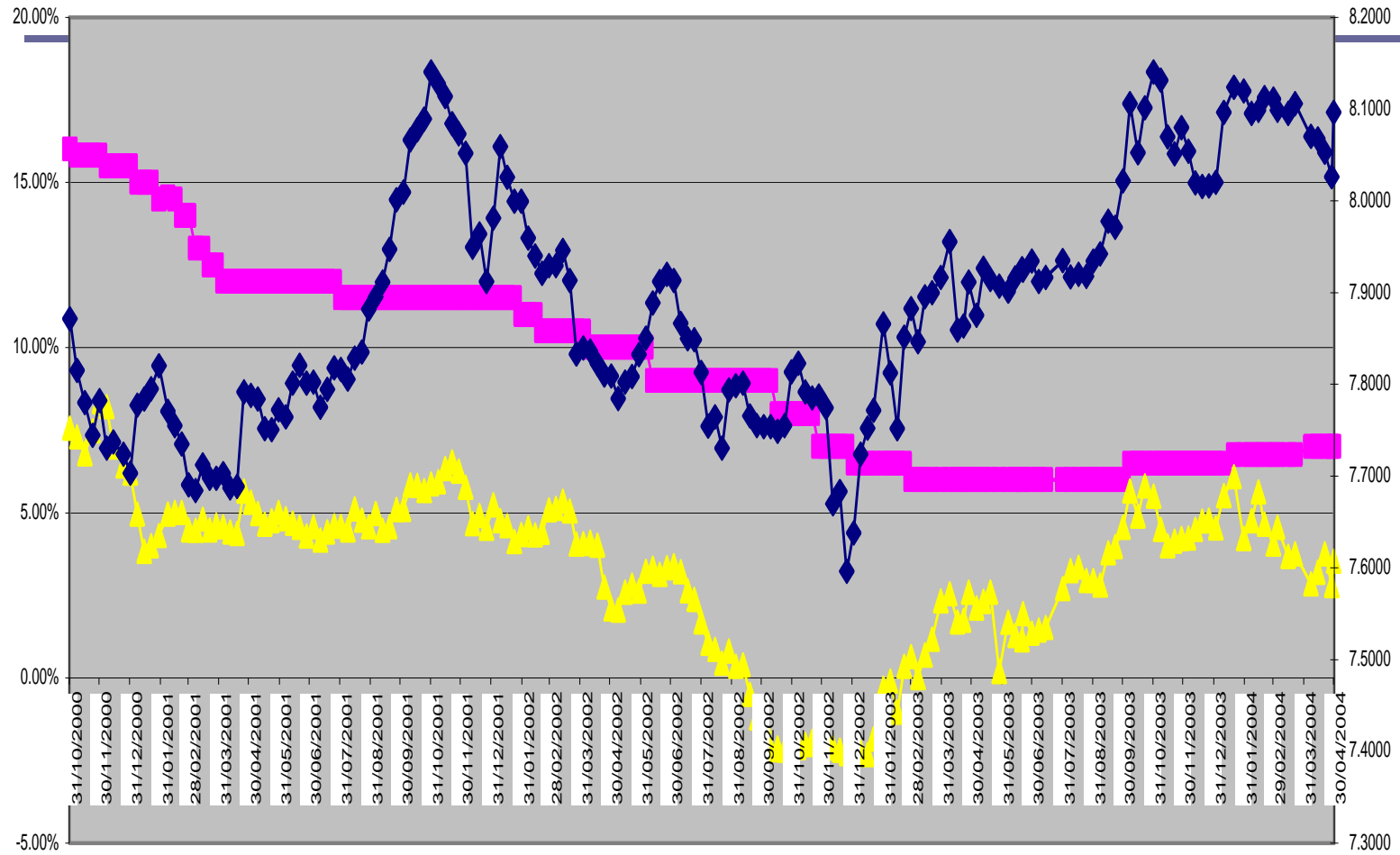
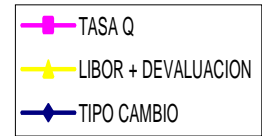


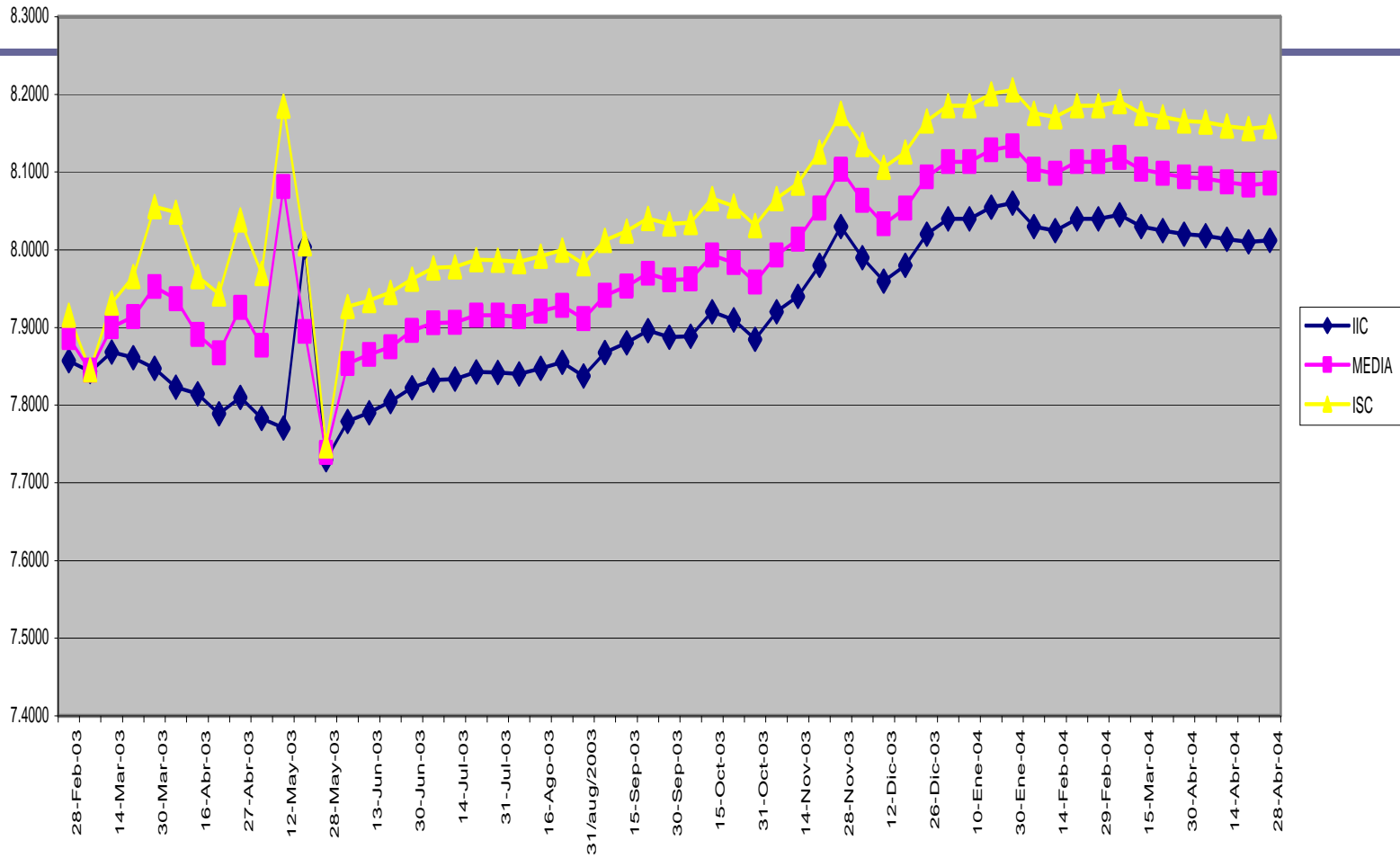
**INDEPENDENCIA-OBJETIVIDAD-
PROFESIONALISMO-EQUILIBRIO-
CONFIDENCIALIDAD-CONFIANZA**

**DOCUMENTACIÓN DE
ANÁLISIS**

TASA DE PARIDAD



INTERVALO DE CONFIANZA INFERIOR Y SUPERIOR DEL TIPO DE CAMBIO

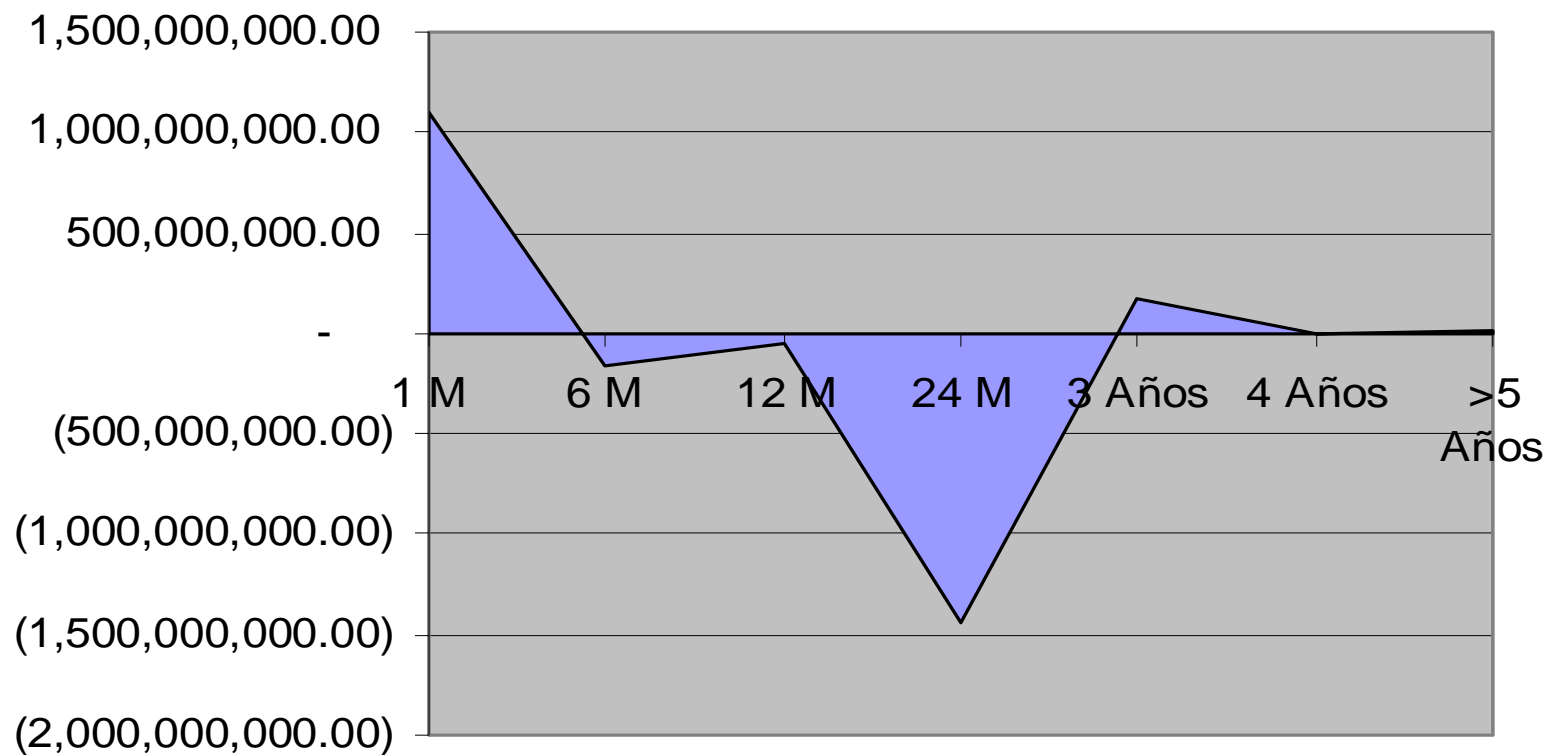


RIESGO DE TASA DE INTERES

DURATION GAP ANALYSIS

FIXED INCOME PORTFOLIO
MANAGEMENT

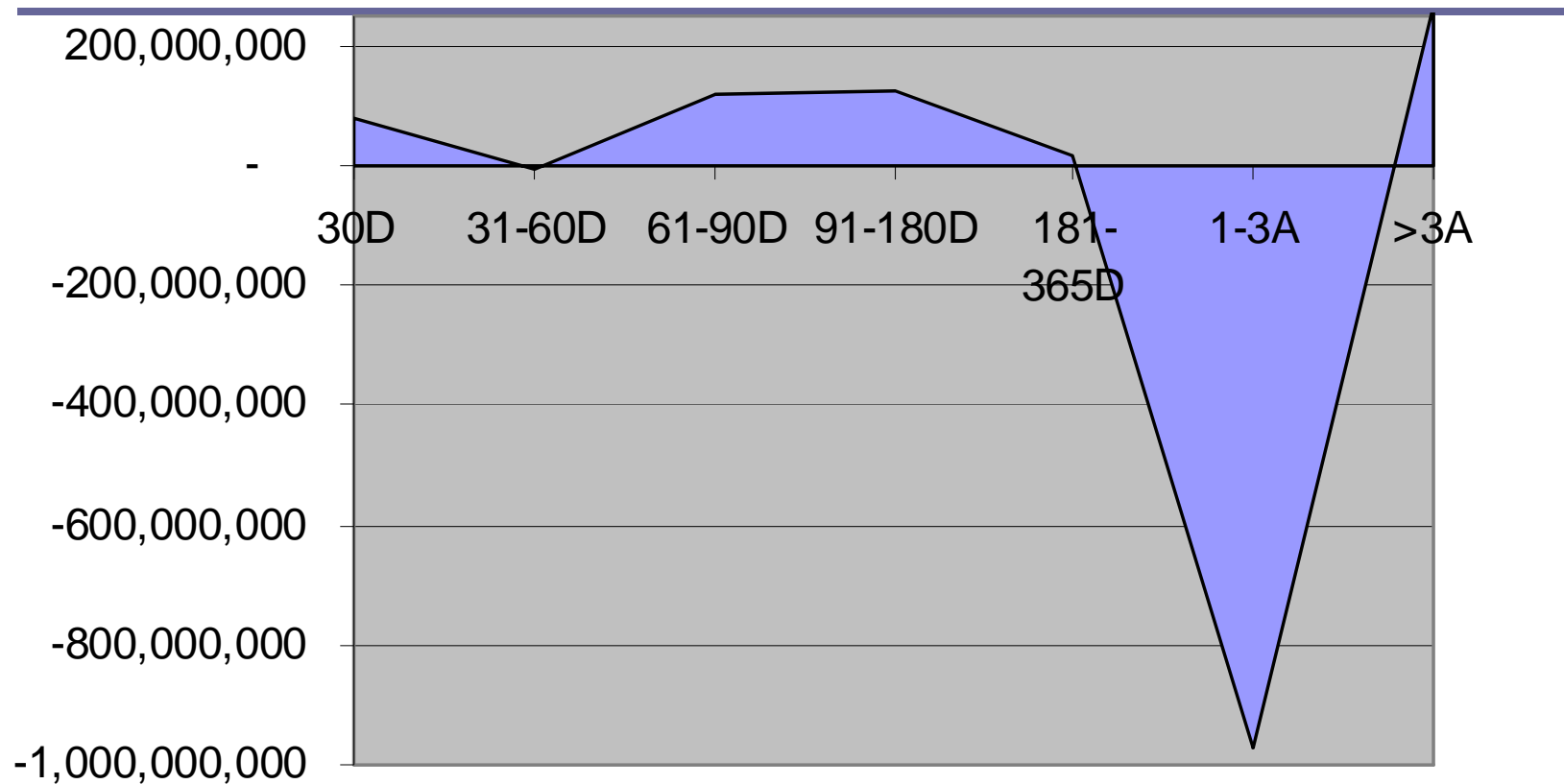
Duration Gap – Banco “X” Q’s



RIESGO DE LIQUIDEZ

MATURITY GAP ANALYSIS

Maturity Gap – Banco “X” Q’s



RIESGO DE TIPO DE CAMBIO

VALUE AT RISK ANALYSIS

Value at Risk – FX

Portfolio	219,643,327
NIVEL DE CONF	99.00%
desvio	0.069629%
VAR	355,777.63
Port. Neto de Pérdida	219,287,837.66
FD	0.98

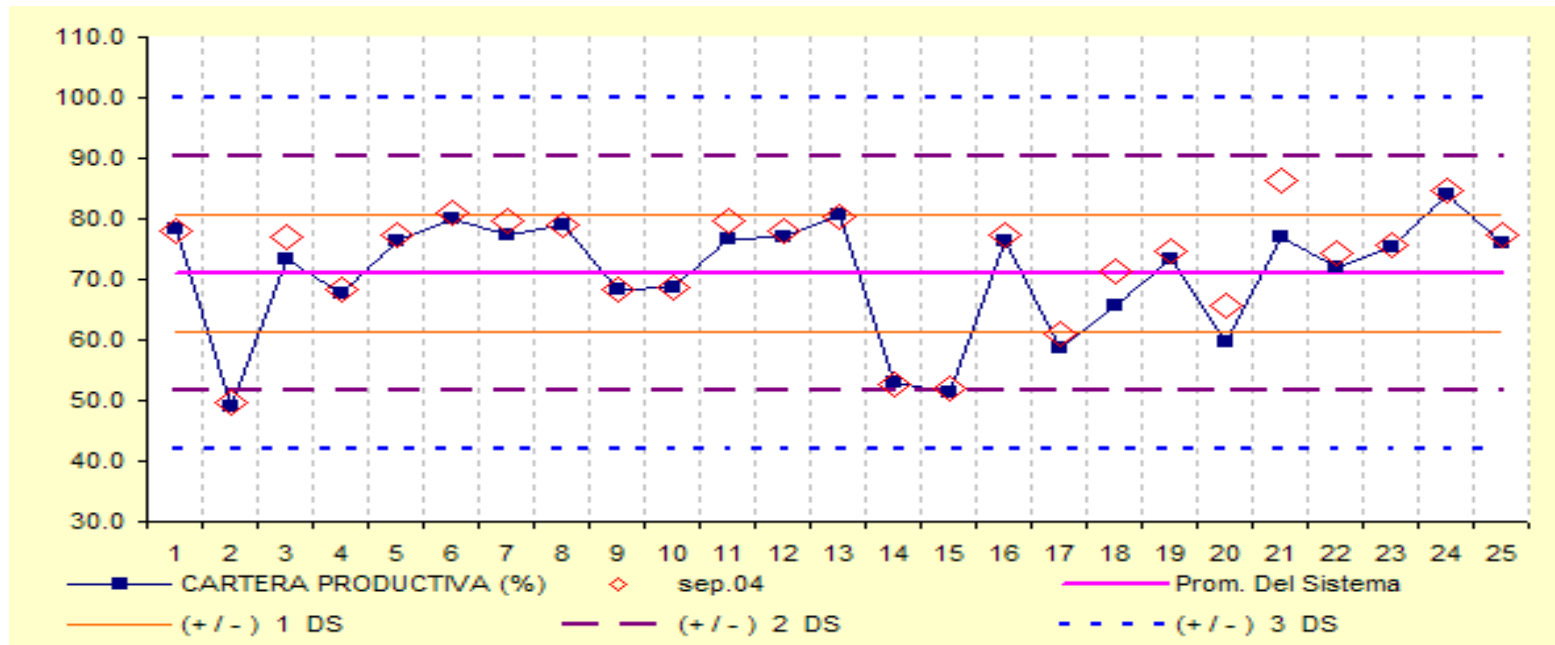
Posición Abierta = Q 219,643,327

Tasa Revaluación = 8.08495

VaR = 1 Día – 99% - Q. 355,777

VaR Mes anterior 1 Día = Q.284,517

BANCOS DEL SISTEMA NACIONAL INSTITUCIONAL



Riesgos Crediticios Institucionales

SECTOR ELÉCTRICO

Comparación

Nivel de Riesgo - Margen Financiero

