

RC05 RELATIVO AL RIESGO DE MERCADO POR OPERACIONES CON ACCIONES Y SOBRE ACCIONES

SALDOS EN MILES DE PESOS

CONCEPTO	DESCRIPCIÓN	REPÚBLICA, AGENCIAS Y SUCURSALES	SOCIEDADES Y FONDOS DE INVERSION
	OPERACIONES CON "ACCIONES"		
50999	POSICIONES LARGAS:		
50050	Acciones a recibir, por compras y otras operaciones pendientes de liquidar		
50100	Tenencia de acciones		
50150	Préstamo, actuando como prestatario (operaciones ya concertadas, pendientes de liquidar)		
50200	Préstamo, actuando como prestamista		
50250	Contratos adelantados ("forwards") de compra, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase activa)		
50255	Futuros de compra, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase activa)		
50300	Emisión de opciones y títulos opcionales de venta, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase activa)		
50350	Tenencia de opciones y títulos opcionales de compra, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase activa)		
50400	Swaps, subyacente accionario a recibir (fase activa)		
50450	Reportos sobre acciones, actuando como reportador (operaciones fecha valor ya concertadas, pendientes de iniciar)		
50500	Reportos sobre acciones, actuando como reportado (acciones a recibir)		
50550	Tenencia de títulos de deuda con rendimiento referido al de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario		
50600	Tenencia de opciones sobre futuros de compra de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase activa)		
50650	Acciones a recibir por garantías otorgadas con transferencia de propiedad		
50900	Otras operaciones activas de acciones o con rendimiento referido al de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario		
50950	Suma de las Posiciones Brutas Largas		
51999	POSICIONES CORTAS:		
51050	Acciones a entregar, por ventas y otras operaciones pendientes de liquidar		
51150	Préstamo, actuando como prestamista (operaciones fecha valor ya concertadas, pendientes de liquidar.)		
51200	Préstamo, actuando como prestatario		
51250	Contratos adelantados ("forwards") de venta, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase pasiva)		
51255	Futuros de venta, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase pasiva)		
51300	Emisión de opciones y títulos opcionales de compra, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase pasiva)		
51350	Tenencia de opciones y títulos opcionales de venta, de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase pasiva)		
51400	Swaps, subyacente accionario a entregar (fase pasiva)		
51450	Reportos sobre acciones, actuando como reportado (operaciones fecha valor ya concertadas, pendientes de iniciar)		
51500	Reportos sobre acciones, actuando como reportador (acciones a entregar)		
51550	Emisión de títulos de deuda con rendimiento referido al de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario		
51600	Tenencia de opciones sobre futuros de venta de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario (fase pasiva)		
51650	Acciones a entregar por garantías recibidas con transferencia de propiedad		
51900	Otras operaciones pasivas de acciones o con rendimiento referido al de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario		
51950	Suma de las Posiciones Brutas Cortas		
	CIFRAS PARA CALCULAR LOS REQUERIMIENTOS DE CAPITAL:		
	POR RIESGO GENERAL DE MERCADO:		
52050	Suma de los montos que se compensan al determinar la posición neta de cada serie accionaria		
52100	Posición total larga		
52150	Posición total corta		

RC05 RELATIVO AL RIESGO DE MERCADO POR OPERACIONES CON ACCIONES Y SOBRE ACCIONES

SALDOS EN MILES DE PESOS

CONCEPTO	DESCRIPCIÓN	REPÚBLICA, AGENCIAS Y SUCURSALES	SOCIEDADES Y FONDOS DE INVERSIÓN
52200	Posición neta del portafolio (positiva)		
52250	Posición neta del portafolio (negativa)		
POR RIESGO ESPECÍFICO:			
53050	Coefficiente beta ponderado de la posición total larga		
53100	Coefficiente beta ponderado de la posición total corta		
53150	Número de series accionarias distintas (del portafolio)		
53200	Número de series accionarias distintas cotizadas en bolsa (del portafolio)		
53250	Número de emisoras en que se distribuyen las series accionarias distintas cotizadas en bolsa (del portafolio)		
53300	Coefficiente de diversificación		
POR RIESGO DE LIQUIDEZ:			
54050	Suma de las posiciones netas largas de acciones con poca liquidez		
54100	Suma de las posiciones netas cortas de acciones con poca liquidez		