

ANEXO 13

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN

(Cifras en miles de pesos a septiembre 2020 con carácter preliminar)

1 ACTIVOS EN RIESGO

MERCADO

Concepto	Importe de posiciones equivalentes	Requerimientos por Pérdidas Inesperadas
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	\$18,816,245	\$1,505,300
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	\$40,672	\$3,254
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	\$5,212,105	\$416,968
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general	\$5,265,821	\$421,266
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	\$36,572	\$2,926
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general	\$85,031	\$6,802
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	\$618	\$49
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	\$0	\$0
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupo de acciones	\$0	\$0

CRÉDITO

Concepto	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento por Pérdidas Inesperadas
Grupo I (ponderados al 0%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 0%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 50%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 100%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 120%)	\$0	\$0
Grupo II (ponderados al 150%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 20%)	\$107,300	\$8,584
Grupo III (ponderados al 23%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 50%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 100%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 115%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 120%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 138%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 150%)	\$0	\$0
Grupo III (ponderados al 175%)	\$0	\$0
Grupo IV (ponderados al 0%)	\$0	\$0
Grupo IV (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo V (ponderados al 10%)	\$0	\$0
Grupo V (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo V (ponderados al 50%)	\$0	\$0
Grupo V (ponderados al 115%)	\$0	\$0
Grupo V (ponderados al 150%)	\$0	\$0
Grupo VI (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo VI (ponderados al 50%)	\$33,639	\$2,691
Grupo VI (ponderados al 75%)	\$65,626	\$5,250
Grupo VI (ponderados al 100%)	\$1,132,696	\$90,616
Grupo VII (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 23%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 50%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 57.5%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 100%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 115%)	\$0	\$0

Grupo VII (ponderados al 120%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 138%)	\$0	\$0
Grupo VII (ponderados al 150%)	\$70,254	\$5,620
Grupo VII (ponderados al 172.5%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 0%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 20%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 23%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 50%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 57%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 100%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 115%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 120%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 138%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 150%)	\$0	\$0
Grupo VIII (ponderados al 172.5%)	\$0	\$0
Grupo IX (ponderados al 125%)	\$497,708	\$39,817
Grupo X (ponderados al 100%)	\$1,748,440	\$139,875
Grupo XI (ponderados al 1250%)	\$3,628,203	\$290,256

OPERACIONAL

Los activos ponderados sujetos a riesgo operacional al cierre de septiembre 2020 ascienden a \$2,242,106.

2 GESTIÓN

Dentro del Marco de Administración Integral de Riesgos se contempla el Perfil de Riesgo Deseado que el FOVI está dispuesto a asumir de acuerdo a sus estrategias para alcanzar sus objetivos institucionales.

La gestión del Perfil de Riesgo Deseado está integrada por cuatro ejes, uno de nivel estratégico (Vigilancia de Capital), bajo injerencia del Comité Técnico de FOVI y tres gestionados por el Comité de Riesgos y la Administración del Fondo (Aseguramiento de Liquidez, Mitigación de Pérdidas Económicas y Optimización Operacional).

Los objetivos de la gestión del patrimonio y liquidez en el Fondo se describen a continuación:

- Vigilancia de Capital: el Fondo deberá contar con Patrimonio suficiente para cubrir los pasivos contingentes aún en situaciones extremas. Para ello, establece que el Índice de Solvencia de FOVI (valor presente del Patrimonio remanente) sea mayor a cero.
- Aseguramiento de Liquidez: se deberá cumplir con los niveles de liquidez necesarios para hacer frente a los compromisos de FOVI.