

## Sensibilización parámetros backtest MI

[SGIR 8.2.2 REG.07 Análisis de sensibilidad Backtest MI](#)

Participante	C1m
Tipo Fwd	USD/CLP
Nominal	1.000.000
Precio	661,19
días venc	33
días pago	35
Trade	reporte

### Modelo base

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0,985
suma lambda	1
N° datos	1251
<b>Número de excesos de PL</b>	<b>5</b>

### Shock alza nivel de confianza

Percen. VaR	99,5
días VaR	3
lambda (dec.)	0,985
suma lambda	1
N° datos	1251
<b>Número de excesos de PL</b>	<b>0</b>

### Shock reducción factor de decaimiento

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0,885
suma lambda	1
N° datos	1251
<b>Número de excesos de PL</b>	<b>19</b>

### Shock acortamiento lookback period

Percen. VaR	99
días VaR	3

lambda (dec.)	0,985
suma lambda	1
N° datos	1000
<b>Número de excesos de PL</b>	<b>5</b>