

## Sensibilización parámetros backtest MI requerido

## SGIR 8.2.2 REG.07 Análisis de sensibilidad Backtest MI

### TRADE

Participante	C1m
Tipo Fwd	USD/CLP
Nominal	1,000,000
Precio	661.19
días venc	33
días pago	35

### 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>4</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 alza holding period

Percen. VaR	99
días VaR	5
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>17</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>4</b>

### TRADE

Participante	VUF6m
Tipo Fwd	CLF/CLP
Nominal	100,000
Precio	28,995.00
días venc	180
días pago	181

### 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>1</b>

### Shock alza holding period

Percen. VaR	99
días VaR	5
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
<b>Número de excesos de PL</b>	<b>1</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>11</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>