

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	816.00
días venc	31
días pago	32

Modelo base

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	2

Shock alza nivel de confianza

Percen. VaR	99.5
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	2

Shock alza holding period

Percen. VaR	99
días VaR	5
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	0

Shock reducción factor de decaimiento

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.885
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	8

Shock acortamiento lookback period

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1000
Número de excesos de PL	2

TRADE

Participante	VUF6m
Tipo Fwd	CLF/CLP
Nominal	100,000
Precio	28,741.33
días venc	182
días pago	183

Modelo base

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	6

Shock alza nivel de confianza

Percen. VaR	99.5
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	2

Shock alza holding period

Percen. VaR	99
días VaR	5
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	3

Shock reducción factor de decaimiento

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.885
suma lambda	1
N° datos	1251
Número de excesos de PL	16

Shock acortamiento lookback period

Percen. VaR	99
días VaR	3
lambda (dec.)	0.985
suma lambda	1
N° datos	1000
Número de excesos de PL	6