

Sensibilización parámetros backtest MI requerido

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 | 0 |

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 | 0 |

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 | 6 |

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 | 0 |