

## 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    | 30        |
| días pago    | 31        |

### 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>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>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> |