

Sensibilización parámetros backtest MI requerido

TRADE

Participante	C1m
Tipo Fwd	USD/CLP
Nominal	1,000,000
Precio	731.70
días venc	32
días pago	31

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	1

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	10

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