

## Sensibilización parámetros backtest MI requerido

### TRADE

Participante	C1m
Tipo Fwd	USD/CLP
Nominal	1,000,000
Precio	719.10
días venc	30
días pago	29

### 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>2</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>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>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>2</b>