

Mes sensibilización		ago-23				
Portafolio utilizado: todos los trades agrupados por tipo de contrato (largos y cortos)		Largo USD/CLP	Corto USD/CLP	Largo CLF/CLP	Corto CLF/CLP	
Modelo Base	Cantidad de Excesos	0	0	10	3	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	0.00%	0.00%	4.00%	1.20%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	2.62%	2.62%	-1.38%	1.42%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	100.00%	100.00%	96.00%	98.80%	
	Percentil VaR	99.00%	99.00%	99.00%	99.00%	
	Valor crítico N(0,1)	2.5758	2.5758	2.5758	2.5758	
	Ventana Backtest (días)	250	250	250	250	
	Shock alza nivel de confianza 99.5% en vez de 99%	Cantidad de Excesos	0	0	4	0
		Cutoff	4.3805	4.3805	4.3805	4.3805
Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico		0.00%	0.00%	61.36%	45.80%	
Déficit de cobertura crítico		1.75%	1.75%	1.75%	1.75%	
Déficit de cobertura observado		0.00%	0.00%	1.60%	0.00%	
Factor Decaimiento (Lambda)		98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
Holgura déficit crítico		1.75%	1.75%	0.15%	1.75%	
Lookback Period		1251	1251	1251	1251	
Margin Period of Risk		3	3	3	3	
Nivel de cobertura obtenido		100.00%	100.00%	98.40%	100.00%	
N° de excesos: Diferencia vs Base		-	-	6	3	
Percentil VaR		99.00%	99.00%	99.00%	99.00%	
Valor crítico N(0,1)		2.807	2.807	2.807	2.807	
Ventana Backtest (días)		250	250	250	250	
Shock días VaR 5D en vez de 3D	Cantidad de Excesos	0	0	10	4	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.00%	0.00%	0.05%	-15.25%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	0.00%	0.00%	4.00%	1.60%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	2.62%	2.62%	-1.38%	1.02%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	5	5	5	5	
	Nivel de cobertura obtenido	100.00%	100.00%	96.00%	98.40%	
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-	-	-	-1	
	Percentil VaR	99.00%	99.00%	99.00%	99.00%	
	Valor crítico N(0,1)	2.5758	2.5758	2.5758	2.5758	
	Ventana Backtest (días)	250	250	250	250	
Shock reducción factor de decaimiento 88.5% en vez de 98.5%	Cantidad de Excesos	7	6	15	11	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-106.83%	-91.57%	-76.25%	-122.08%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	2.80%	2.40%	6.00%	4.40%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%	
	Holgura déficit crítico	-0.18%	0.22%	-3.38%	-1.78%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	97.20%	97.60%	94.00%	95.60%	
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-7	-6	-5	-8	
	Percentil VaR	99.00%	99.00%	99.00%	99.00%	
	Valor crítico N(0,1)	2.5758	2.5758	2.5758	2.5758	
	Ventana Backtest (días)	250	250	250	250	
Shock reducción lookback period 1000 en vez de 1251	Cantidad de Excesos	0	0	10	3	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.00%	0.00%	0.05%	0.02%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	0.00%	0.00%	4.00%	1.20%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	2.62%	2.62%	-1.38%	1.42%	
	Lookback Period	1000	100	1000	100	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	100.00%	100.00%	96.00%	98.80%	
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-	-	-	-	
	Percentil VaR	99.00%	99.00%	99.00%	99.00%	
	Valor crítico N(0,1)	2.5758	2.5758	2.5758	2.5758	
	Ventana Backtest (días)	250	250	250	250	