

Mes sensibilización		jun-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	3	2	8	0	
	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	1.20%	0.80%	3.20%	0.00%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	1.42%	1.82%	-0.58%	2.62%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.20%	96.80%	100.00%	
	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	3	2	3	0
		Cutoff	4.3805	4.3805	4.3805	4.3805
Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico		-22.68%	-15.12%	53.65%	0.00%	
Déficit de cobertura crítico		1.75%	1.75%	1.75%	1.75%	
Déficit de cobertura observado		1.20%	0.80%	1.20%	0.00%	
Factor Decaimiento (Lambda)		98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
Holgura déficit crítico		0.55%	0.95%	0.55%	1.75%	
Lookback Period		1251	1251	1251	1251	
Margin Period of Risk		3	3	3	3	
Nivel de cobertura obtenido		98.80%	99.20%	98.80%	100.00%	
N° de excesos: Diferencia vs Base		-	-	5	-	
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	4	3	7	0	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-15.25%	-15.25%	15.31%	0.00%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	1.60%	1.20%	2.80%	0.00%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	1.02%	1.42%	-0.18%	2.62%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	5	5	5	5	
	Nivel de cobertura obtenido	98.40%	98.80%	97.20%	100.00%	
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-1	-1	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	8	6	14	6	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-76.29%	-61.04%	-91.53%	-91.57%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	3.20%	2.40%	5.60%	2.40%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%	
	Holgura déficit crítico	-0.58%	0.22%	-2.98%	0.22%	
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	96.80%	97.60%	94.40%	97.60%	
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-5	-4	-6	-6	
	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	3	2	8	0	
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523	
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.02%	0.01%	0.04%	0.00%	
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%	
	Déficit de cobertura observado	1.20%	0.80%	3.20%	0.00%	
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%	
	Holgura déficit crítico	1.42%	1.82%	-0.58%	2.62%	
	Lookback Period	1000	100	1000	100	
	Margin Period of Risk	3	3	3	3	
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.20%	96.80%	100.00%	
	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	