

Mes sensibilización		mar-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	6	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%	2.40%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	1.42%	1.82%	0.22%	2.62%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.20%	97.60%	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
	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%	23.12%	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	-	-	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	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%	-15.23%	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	10	6	10	3
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-106.82%	-61.04%	-61.01%	-45.79%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	4.00%	2.40%	4.00%	1.20%
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%
	Holgura déficit crítico	-1.38%	0.22%	-1.38%	1.42%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	96.00%	97.60%	96.00%	98.80%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-7	-4	-4	-3
	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	6	0
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.02%	0.01%	0.03%	0.00%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	1.20%	0.80%	2.40%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	1.42%	1.82%	0.22%	2.62%
	Lookback Period	1000	100	1000	100
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.20%	97.60%	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