

		Mes sensibilización		Dec-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	1	2	6	4					
	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	0.40%	0.80%	2.40%	1.60%					
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%					
	Holgura déficit crítico	2.22%	1.82%	0.22%	1.02%					
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251					
	Margin Period of Risk	3	3	3	3					
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.20%	97.60%	98.40%					
	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	1	2	1	2				
		Cutoff	4.3805	4.3805	4.3805	4.3805				
Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico		-7.56%	-15.12%	68.77%	15.41%					
Déficit de cobertura crítico		1.75%	1.75%	1.75%	1.75%					
Déficit de cobertura observado		0.40%	0.80%	0.40%	0.80%					
Factor Decaimiento (Lambda)		98.50%	98.50%	98.50%	98.50%					
Holgura déficit crítico		1.35%	0.95%	1.35%	0.95%					
Lookback Period		1251	1251	1251	1251					
Margin Period of Risk		3	3	3	3					
Nivel de cobertura obtenido		99.60%	99.20%	99.60%	99.20%					
N° de excesos: Diferencia vs Base		-	-	5	2					
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	3	2	6	4					
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523					
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-30.52%	0.01%	0.03%	0.02%					
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%					
	Déficit de cobertura observado	1.20%	0.80%	2.40%	1.60%					
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%					
	Holgura déficit crítico	1.42%	1.82%	0.22%	1.02%					
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251					
	Margin Period of Risk	5	5	5	5					
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.20%	97.60%	98.40%					
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-2	-	-	-					
	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	9	21	10					
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523					
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-91.57%	-106.82%	-228.89%	-91.55%					
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%					
	Déficit de cobertura observado	2.80%	3.60%	8.40%	4.00%					
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%					
	Holgura déficit crítico	-0.18%	-0.98%	-5.78%	-1.38%					
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251					
	Margin Period of Risk	3	3	3	3					
	Nivel de cobertura obtenido	97.20%	96.40%	91.60%	96.00%					
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-6	-7	-15	-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	1	2	6	4					
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523					
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.01%	0.01%	0.03%	0.02%					
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%					
	Déficit de cobertura observado	0.40%	0.80%	2.40%	1.60%					
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%					
	Holgura déficit crítico	2.22%	1.82%	0.22%	1.02%					
	Lookback Period	1000	100	1000	100					
	Margin Period of Risk	3	3	3	3					
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.20%	97.60%	98.40%					
	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					