

	Mes sensibilización	nov-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
Cutoff		4.3805	4.3805	4.3805	4.3805
Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico		-7.56%	15.12%	88.77%	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	20	10
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-91.57%	-106.82%	-213.63%	-91.55%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	2.80%	3.60%	8.00%	4.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%
	Holgura déficit crítico	-0.18%	-0.98%	-5.38%	-1.38%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	97.20%	96.40%	92.00%	96.00%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-6	-7	-14	-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	