

	Mes sensibilización	oct-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	1	9	5
	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%	0.40%	3.60%	2.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	2.22%	2.22%	-0.98%	0.62%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.60%	96.40%	98.00%
	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	1	1	4
Cutoff		4.3805	4.3805	4.3805	4.3805
Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico		-7.56%	-7.56%	46.09%	30.68%
Déficit de cobertura crítico		1.75%	1.75%	1.75%	1.75%
Déficit de cobertura observado		0.40%	0.40%	1.60%	0.80%
Factor Decaimiento (Lambda)		98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
Holgura déficit crítico		1.35%	1.35%	0.15%	0.95%
Lookback Period		1251	1251	1251	1251
Margin Period of Risk		3	3	3	3
Nivel de cobertura obtenido		99.60%	99.60%	98.40%	99.20%
N° de excesos: Diferencia vs Base		-	-	5	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	3	1	11	4
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-30.52%	0.01%	-30.47%	15.29%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	1.20%	0.40%	4.40%	1.60%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	1.42%	2.22%	-1.78%	1.02%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	5	5	5	5
	Nivel de cobertura obtenido	98.80%	99.60%	95.60%	98.40%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-2	-	-2	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	8	20	13
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-106.83%	-106.83%	-167.83%	-122.07%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	3.20%	3.20%	8.00%	5.20%
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%
	Holgura déficit crítico	-0.58%	-0.58%	-5.38%	-2.58%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	96.80%	96.80%	92.00%	94.80%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-7	-7	-11	-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	1	1	9	5
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.01%	0.01%	0.05%	0.03%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	0.40%	0.40%	3.60%	2.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	2.22%	2.22%	-0.98%	0.62%
	Lookback Period	1000	100	1000	100
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.60%	96.40%	98.00%
	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	