

	Mes sensibilización	oct-24			
	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	3	0	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	0.40%	1.20%	0.00%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	2.22%	1.42%	2.62%	2.62%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	98.80%	100.00%	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	1	1	0	0
	Cutoff	4.3805	4.3805	4.3805	4.3805
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-7.60%	-3.00%	0.00%	0.00%
	Déficit de cobertura crítico	1.75%	1.75%	1.75%	1.75%
	Déficit de cobertura observado	0.40%	0.40%	0.00%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	1.35%	1.35%	1.75%	1.75%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.60%	100.00%	100.00%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-	-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	1	0	0	0
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.00%	45.80%	0.00%	0.00%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	0.40%	0.00%	0.00%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	2.22%	2.62%	2.62%	2.62%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	5	5	5	5
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	100.00%	100.00%	100.00%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	-	3	-	-
	Percentil VaR	99.00%	99.00%	99.00%	99.00%
	Valor crítico N(0,1)	2.5758	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	4	4	12	0
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	-45.80%	-15.20%	-183.10%	0.00%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	1.60%	1.60%	4.80%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	88.50%	88.50%	88.50%	88.50%
	Holgura déficit crítico	1.02%	1.02%	-2.18%	2.62%
	Lookback Period	1251	1251	1251	1251
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	98.40%	98.40%	95.20%	100.00%
	N° de excesos: Diferencia vs Base	3	-1	-12	-
	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	0	0
	Cutoff	6.5523	6.5523	6.5523	6.5523
	Diferencia vs base: holgura como participación en déficit crítico	0.00%	30.50%	0.00%	0.00%
	Déficit de cobertura crítico	2.62%	2.62%	2.62%	2.62%
	Déficit de cobertura observado	0.40%	0.40%	0.00%	0.00%
	Factor Decaimiento (Lambda)	98.50%	98.50%	98.50%	98.50%
	Holgura déficit crítico	2.22%	2.22%	2.62%	2.62%
	Lookback Period	1000	1000	1000	1000
	Margin Period of Risk	3	3	3	3
	Nivel de cobertura obtenido	99.60%	99.60%	100.00%	100.00%
	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