

ANEXO N° 4

FORMATO DE FORMULARIO DE INGRESO DE INFORMACION DE
BACK TESTING /STRESS TESTING

VaR

ANEXO

1. Back Testing

A.	N° de observaciones fuera del VaR proyectado	<input type="text"/>
B.	N° de meses de calculo del VaR (acumulado)	<input type="text"/>
C.	A/B (en %)	<input type="text"/>
D.	Adjuntar nota de texto explicando diferencias entre el VaR proyectado y los resultados reales obtenidos por la cartera	<input type="text"/>

2. Stress Testing

A. Test de Stress Básico

Factores de riesgo a sensibilizar	Disminución de valor por cartera
Caída del 20% en el valor de los bienes raíces	<input type="text"/>
Incremento de 100 puntos básicos en todas las tasas de interés	<input type="text"/>
Caída del 30% en el valor de los instrumentos de renta variable	<input type="text"/>
Total	<input type="text"/>

Test de Stress Adicional

La compañía deberá adjuntar cuadro explicativo de los factores de riesgo sensibilizados

B.

ACEPTAR **CANCELAR**