

## INFORME DE METRICAS

### CAMBIO ESTRUCTURAL EN LOS DATOS O ENTORNO EN EL CORTO PLAZO

Calculando el cambio porcentual entre el ultimo Backtesting generado vs la ventana corta con 2 periodos...

El movimiento en el corto plazo corresponde al -1.4% bajo la visual de todo el set de datos, el cual se atribuye a negocio

Y el movimiento de la metrica atribuible al modelo (en los nodos de ordenamiento de interes) es:

| Index\N    | 40.0  | 80.0  | 425.145 | 850.291 | 1275.437 | 4251.458 |
|------------|-------|-------|---------|---------|----------|----------|
| % Aciertos | -2.69 | -0.83 | 2.85    | -0.35   | -0.2     | -1.4     |

% Deterioro sobre los nodos en los cuales se hace seguimiento:

| Index\N    | 40.0  | 80.0  | 425.145 | 850.291 | 1275.437 |
|------------|-------|-------|---------|---------|----------|
| % Aciertos | -2.69 | -0.83 | nan     | -0.35   | -0.2     |

Evaluando los nodos con tendencia decreciente sobre el comparativo del ultimo Backtesting contra la ventana corta de 2 periodos

Y ubicando los cortes de deterioro..

Caida maxima: -0.121% asociado al nodo (Numero de observacion: N) = 120.0.

Caida minima: -0.121% asociado al nodo (Numero de observacion: N) = 120.0.

Calculando el cambio porcentual entre el ultimo Backtesting generado vs el nivel de la alerta permitido y evaluando alertas de deterioro...

No hubo alerta generada

Diagnostico del modelo:

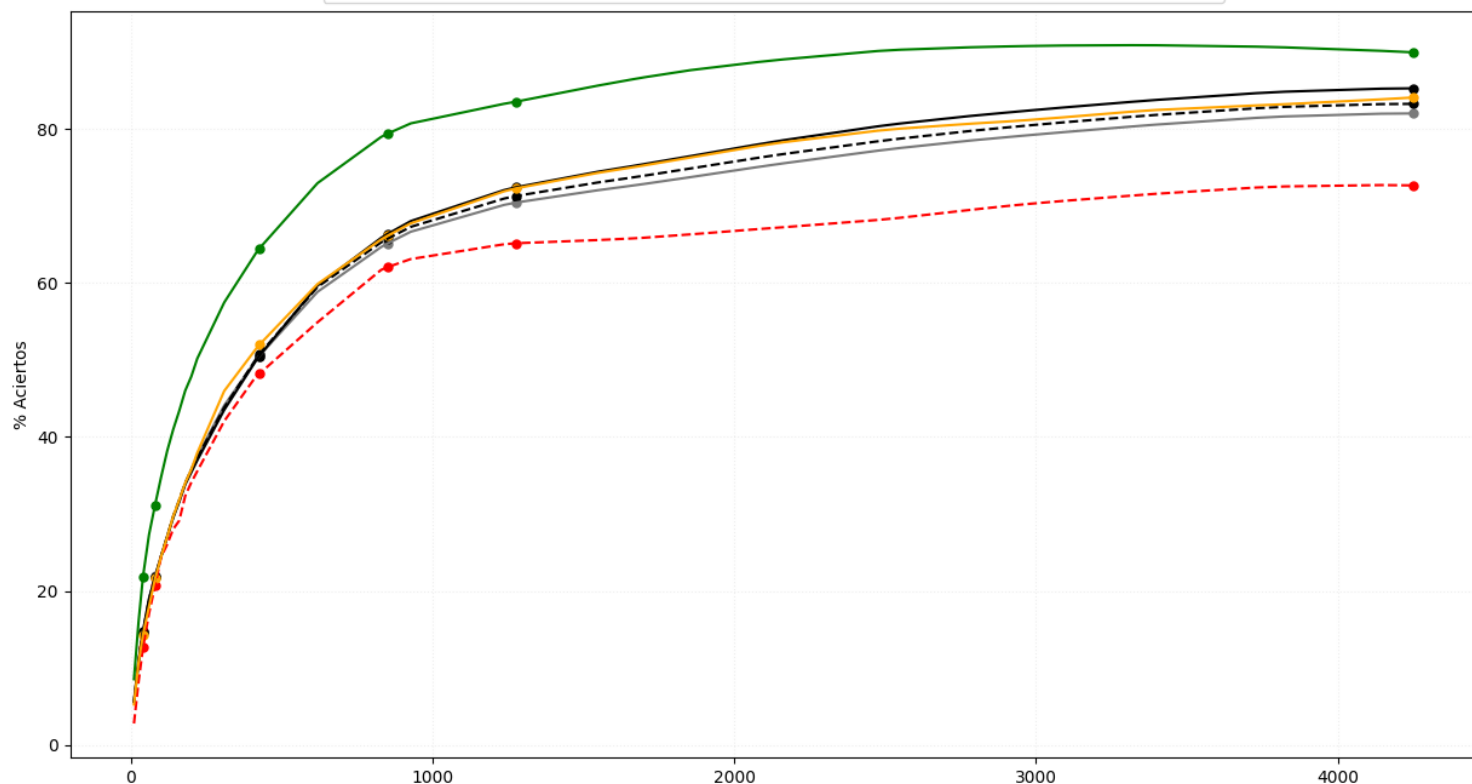
Alerta Nivel Medio por cambio estructural de los datos en corto plazo. Revisar factores macro o novedades en negocio

El ultimo Backtesting tiene peores metricas que su nivel medio en el corto plazo  
aunque el backtesting no esta por debajo de la alerta

Sin modelo el deterioro hubiese sido peor. Revisar las condiciones de mercado y  
estrategia

EVOLUCION DE METRICAS: SP  
% Aciertos con 2 periodo de retraso de información durante la predicción

202504 CP 202505 CP 202505 LP Alerta 202410 Actual



## INFORME DE METRICAS

### DETERIORO MAXIMO EN LAS METRICAS

Alerta: Drawdown superior al restringido -15% en algunos nodos de la curva de ordenamiento:

| Nº Δ SP | Actual vs Initial | Actual vs $\mu$ 2 periods | Actual vs $\mu$ 3 periods |
|---------|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| 40.0    | -34.57            | -2.69                     | -2.0                      |
| 80.0    | -30.74            | -0.83                     | -0.83                     |
| 425.145 | -19.41            | 0.0                       | 0.0                       |
| 850.291 | -16.7             | -0.35                     | 0.0                       |

Analizando el drawdown en los nodos de interes...

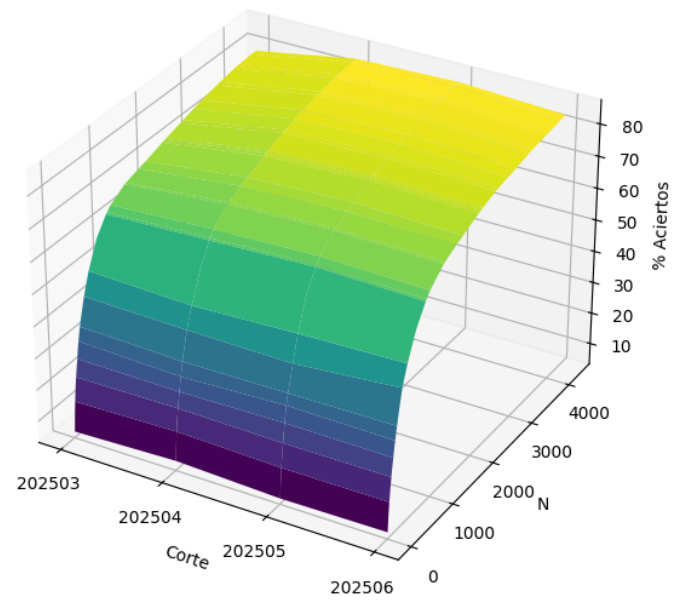
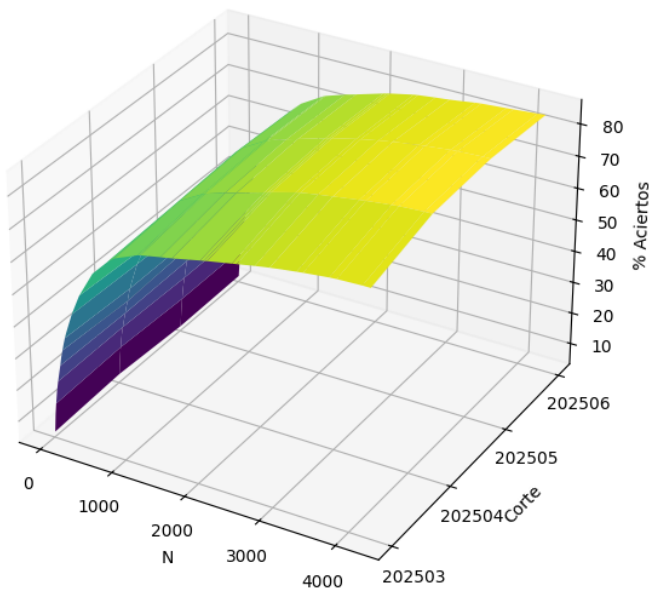
Alerta: Drawdown superior al restringido -15% en algun nodo de interes

Analizar el reporte para evaluar la recalibracion del modelo

| Nº Δ SP  | Actual vs Initial | Actual vs $\mu$ 2 periods | Actual vs $\mu$ 3 periods |
|----------|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| 40.0     | -34.57            | -2.69                     | -2.0                      |
| 80.0     | -30.74            | -0.83                     | -0.83                     |
| 425.145  | -19.41            | 0.0                       | 0.0                       |
| 850.291  | -16.7             | -0.35                     | 0.0                       |
| 1275.437 | -13.48            | -0.2                      | 0.0                       |

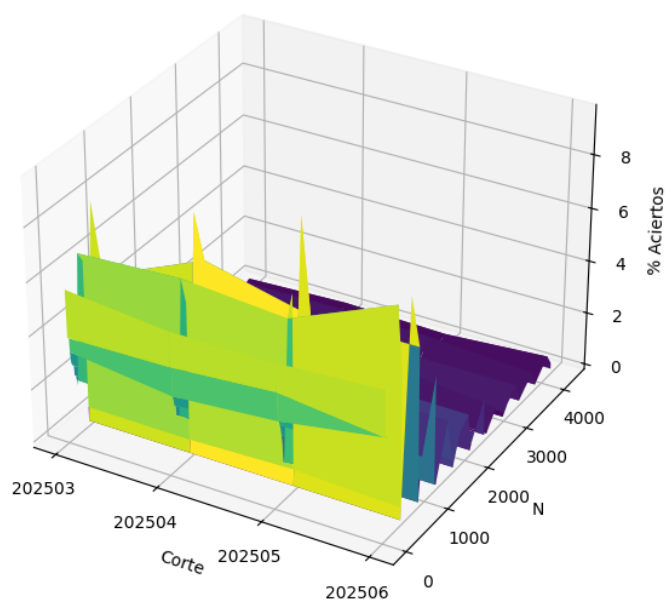
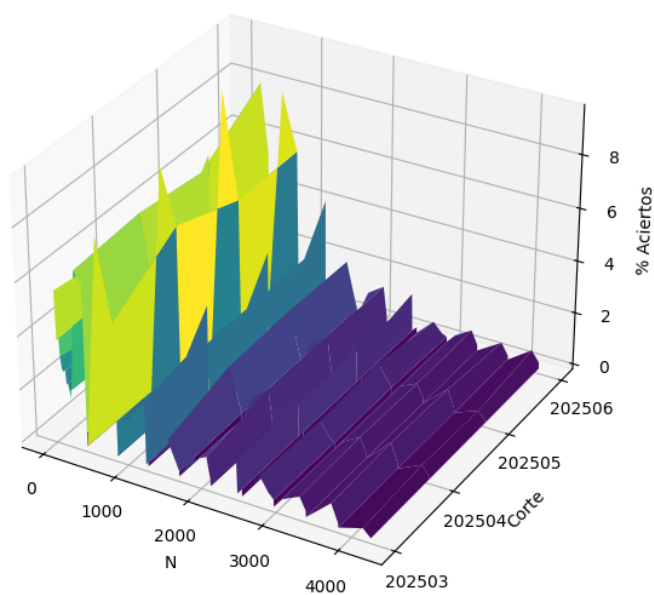
# EVOLUCION DE METRICAS: SP

Backtesting: % Aciertos.  
Rezago De Informacion: 2 cortes



### EVOLUCION DE METRICAS: SP

$\Delta$  Marginal/Pendiente del Ordenamiento: % Aciertos.  
Rezago De Informacion: 2 cortes



# EVOLUCION DE METRICAS: SP

$\Delta$  Backtesting/  $\Delta T$ : % Aciertos.  
Rezago De Informacion: 2 cortes

