

## 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 -8.54% 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	-10.37	-8.59	-9.05	-7.84	-7.91	-8.54

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

Index\N	40.0	80.0	425.145	850.291	1275.437
% Aciertos	-10.37	-8.59	-9.05	-7.84	-7.91

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: -10.925% asociado al nodo (Numero de observacion: N) = 160.0.

Caida minima: -8.371% asociado al nodo (Numero de observacion: N) = 100.0.

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

% Deficiencia del modelo:  $(\text{Backtesting}_t / \text{Alerta} - 1) * 100$ :

Index\N	40.0	80.0
Actual vs Alerta	-2.14	-1.85

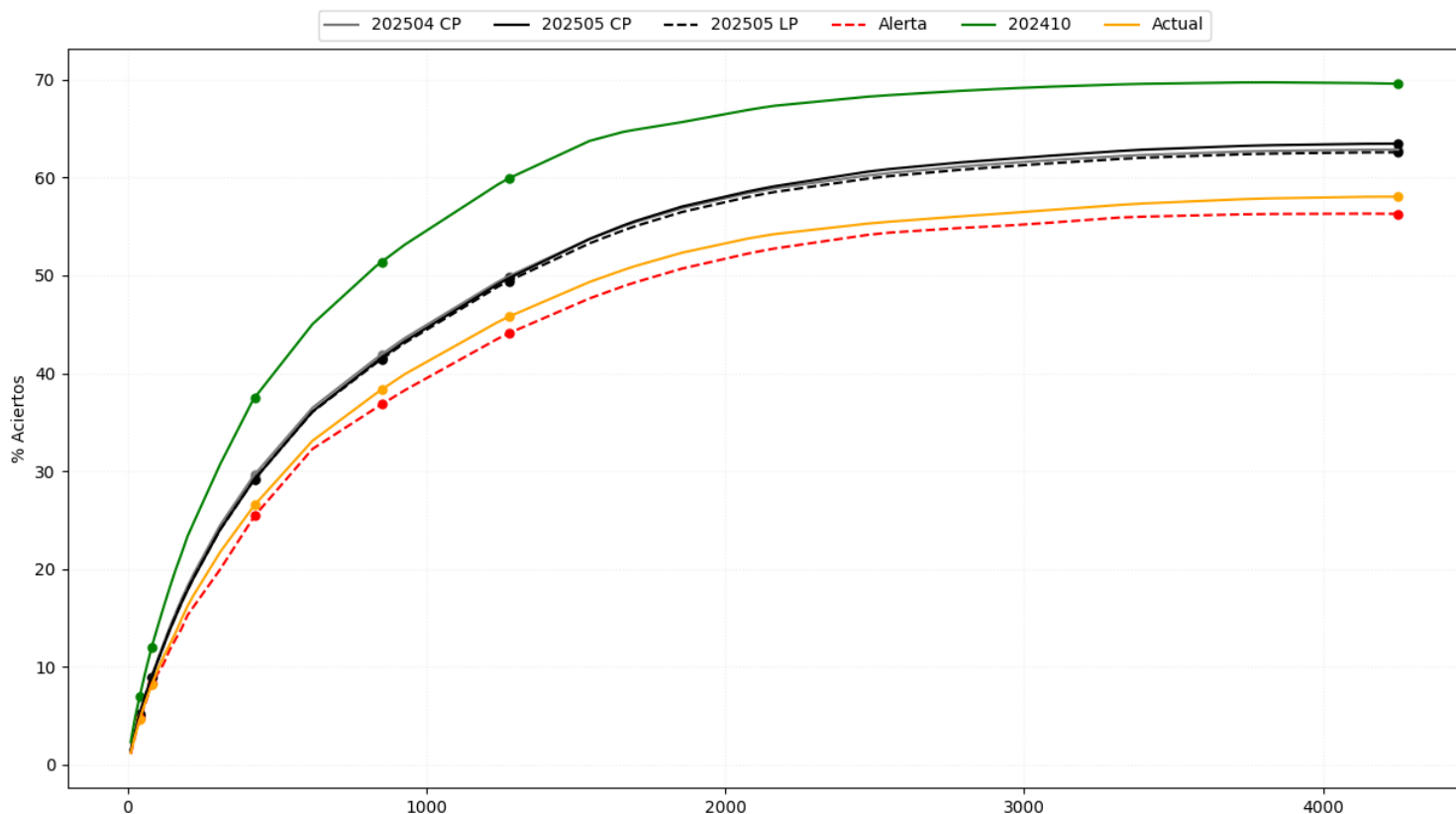
Diagnostico del modelo:

Alerta Grave/Fuerte por cambio estructural de los datos en el corto plazo

esto es porque el ultimo backtesting esta por debajo que las alerta

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

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



## INFORME DE METRICAS

### DETERIORO MAXIMO EN LAS METRICAS

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

Nº Δ LD	Actual vs Initial	Actual vs $\mu$ 2 periods	Actual vs $\mu$ 3 periods
40.0	-33.98	-10.37	-11.12
80.0	-32.2	-8.59	-8.5
425.145	-29.25	-9.05	-9.09
850.291	-25.42	-7.84	-7.53
1275.437	-23.61	-7.91	-7.4
1700.583	-21.47	-8.28	-7.41
2125.729	-19.56	-8.25	-7.33
2550.874	-18.91	-8.85	-7.74
2976.02	-18.39	-8.95	-7.81
3401.166	-17.58	-8.75	-7.54
3826.312	-17.01	-8.59	-7.33
4251.458	-16.59	-8.54	-7.24

Analizando el drawdown en los nodos de interes...

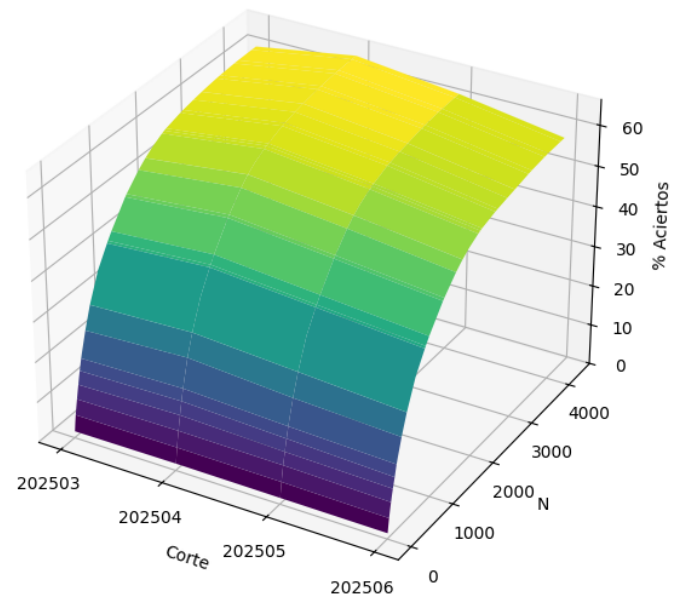
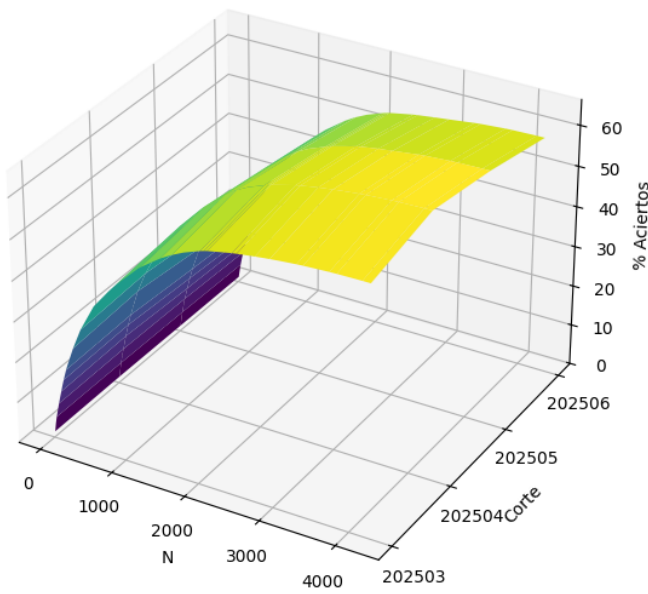
Alerta: Drawdown superior al restringido -15% en algun nodo de interes

Analizar el reporte para evaluar la recalibracion del modelo

N\% Δ LD	Actual vs Initial	Actual vs $\mu$ 2 periods	Actual vs $\mu$ 3 periods
40.0	-33.98	-10.37	-11.12
80.0	-32.2	-8.59	-8.5
425.145	-29.25	-9.05	-9.09
850.291	-25.42	-7.84	-7.53
1275.437	-23.61	-7.91	-7.4

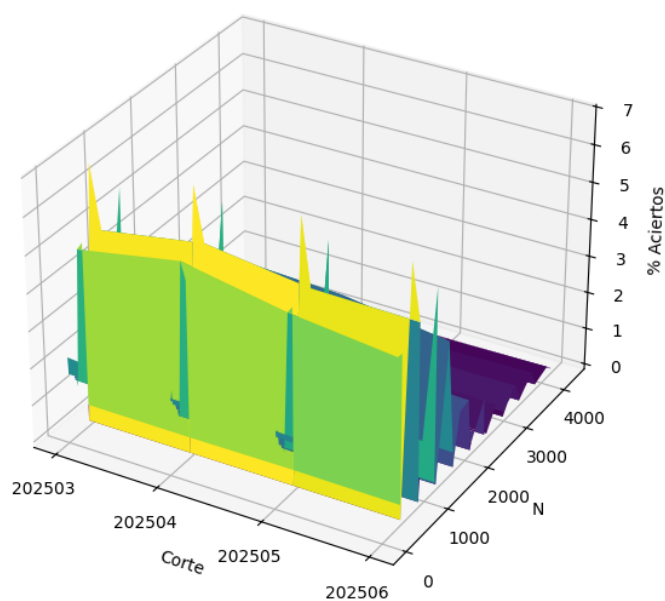
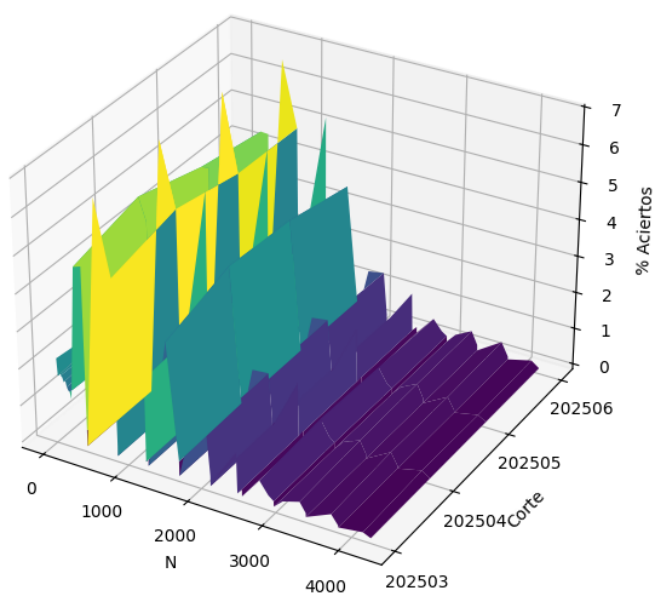
# EVOLUCION DE METRICAS: LD

Backtesting: % Aciertos.  
Rezago De Informacion: 2 cortes



# EVOLUCION DE METRICAS: LD

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



# EVOLUCION DE METRICAS: LD

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

