

GESTIÓN DE PRUEBAS DE RESISTENCIA

Resolución General N°757/2018 CNV

Sociedad Gerente:

**Itaú Asset Management S.A. Sociedad Gerente
de Fondos Comunes de Inversión**

Fondo Money Market:

Fondo Goal Pesos

Información al 22/06/2023

1) Riesgo de Liquidez

Se define al riesgo de liquidez a la falta de capacidad de afrontar los rescates de forma masiva. En caso de presentarse necesidades de liquidez y por decisión conjunta del Portfolio y CEO de Itaú Asset Management, se activará el plan de contingencia.

Para ello se clasifica la cartera de acuerdo al tiempo de realización de activos:

- Liquidez inmediata: Cuentas corrientes remuneradas, Plazos fijos tradicionales a menos de un día del vencimiento, cauciones y Plazos fijos precancelables en condiciones de precancelarse.
- Liquidez en hasta una semana: Plazos fijos con vencimiento menor a 7 días y Plazos fijos precancelables en condiciones de precancelarse en un plazo menor a 7 días.
- Liquidez mayor a una semana: Plazos fijos tradicionales con vencimiento mayor a 7 días y Plazos fijos precancelables sin condición de precancelarse en un plazo mayor a 7 días.

GOAL PESOS	146.428.883.160,07	100,00%
Liquidez 1 Semana	104.287.403.534,67	71,22%
Liquidez Inmediata	86.916.882.986,75	59,36%
Liquidez 1 Semana	17.370.520.547,92	11,86%
Plazos Fijos	17.370.520.547,92	11,86%
Liquidez + 1 Semana	42.141.479.625,40	28,78%
Plazos Fijos	35.061.479.452,10	23,94%
Otros	7.080.000.173,30	4,84%

2) Riesgo de Mercado

El VaR fue calculado de acuerdo a los requisitos de la RG 757/2018 CNV.

- i) Un nivel de confianza del 95%
- ii) Un período de muestra de un año como mínimo.
- iii) Un horizonte temporal para el que se estime la pérdida máxima de un día.

Dicho VaR asciende a 0,000164367493985365.

3) Riesgo de Concentración

A continuación, se detallan los niveles de concentración de los principales cuotapartistas:

- i) Principales 20 cuotapartistas:

TOP 20	
Cuotapartista	% PN
Cuotapartista 1	9,82%
Cuotapartista 2	4,03%
Cuotapartista 3	3,03%
Cuotapartista 4	2,63%
Cuotapartista 5	2,25%
Cuotapartista 6	2,11%
Cuotapartista 7	2,10%
Cuotapartista 8	1,96%
Cuotapartista 9	1,84%
Cuotapartista 10	1,82%
Cuotapartista 11	1,81%
Cuotapartista 12	1,70%
Cuotapartista 13	1,53%
Cuotapartista 14	1,50%
Cuotapartista 15	1,49%
Cuotapartista 16	1,40%
Cuotapartista 17	1,36%
Cuotapartista 18	1,33%
Cuotapartista 19	1,24%
Cuotapartista 20	1,20%

- ii) Concentración del patrimonio en los 10,20 y 50 principales cuotapartistas:

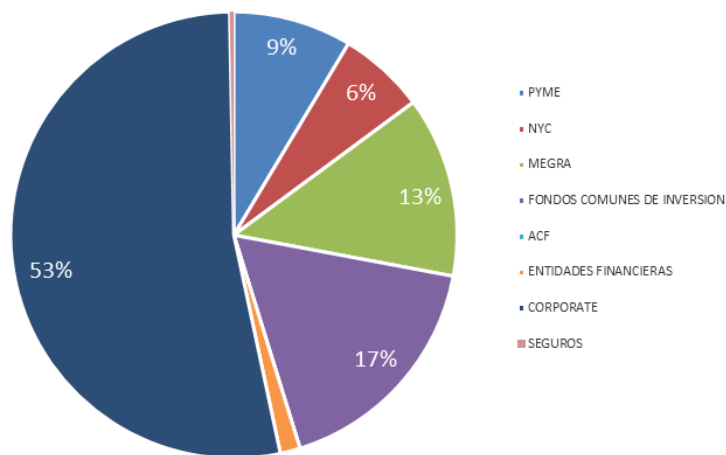
	TOP 10	TOP 20	TOP 50
% PN	31,59%	46,15%	68,50%

iii) Dispersión por tipo de Persona:

Total Inversiones Personas Físicas (A)	1,97%
Total Inversiones Personas Jurídicas (B)	98,03%

iv) Dispersión por segmento de inversión:

Concentración de Inversores por Segmento



4) Riesgo de Crédito:

Al 22 de junio de 2023, la cartera del Fondo Goal Pesos estaba constituida por Depósitos a la Vista, Depósitos a Plazo en Entidades Financieras y Cauciones Bursátiles.

La concentración por Banco es inferior al 20%.

La cartera posee activos considerados de alta calidad crediticia.