

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 19/09/2023

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	213,842,560,994.64	100.00%
Liquidez 1 Semana	161,681,895,533.78	75.61%
Liquidez Inmediata	141,085,320,191.34	65.98%
Liquidez 1 Semana	20,596,575,342.44	9.63%
Plazos Fijos	20,596,575,342.44	9.63%
Liquidez + 1 Semana	52,160,665,460.86	24.39%
Plazos Fijos	42,322,438,356.16	19.79%
Otros	9,838,227,104.70	4.60%

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 0.000773843975038172.

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	9.10%
Cuotapartista 2	5.98%
Cuotapartista 3	4.03%
Cuotapartista 4	3.69%
Cuotapartista 5	3.05%
Cuotapartista 6	2.84%
Cuotapartista 7	2.70%
Cuotapartista 8	2.67%
Cuotapartista 9	2.40%
Cuotapartista 10	1.83%
Cuotapartista 11	1.76%
Cuotapartista 12	1.65%
Cuotapartista 13	1.47%
Cuotapartista 14	1.46%
Cuotapartista 15	1.46%
Cuotapartista 16	1.42%
Cuotapartista 17	1.35%
Cuotapartista 18	1.32%
Cuotapartista 19	1.32%
Cuotapartista 20	1.30%

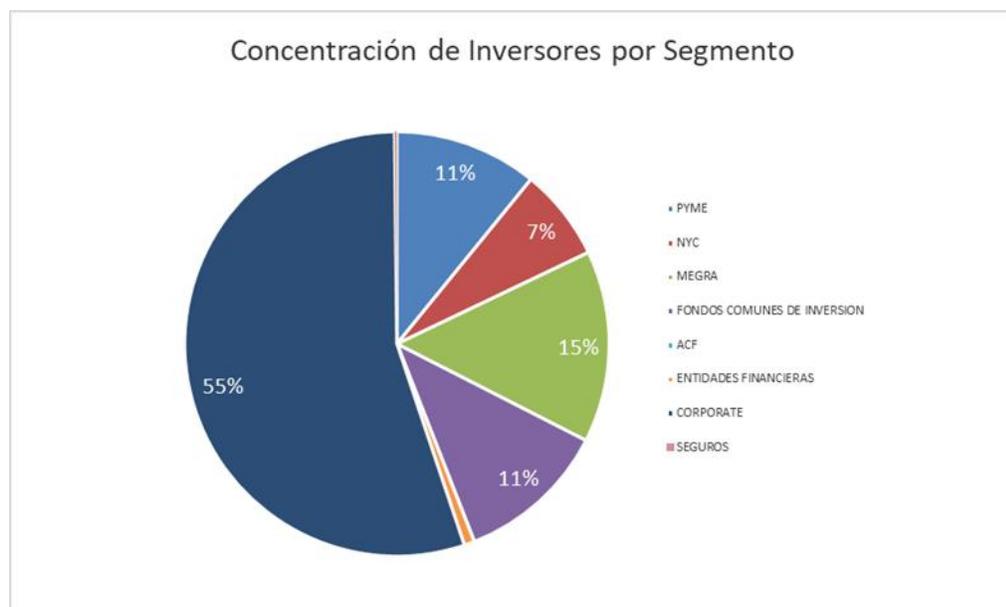
- ii) Concentración del patrimonio en los 10,20 y 50 principales cuotapartistas:

	TOP 10	TOP 20	TOP 50
% PN	38.30%	52.80%	77.54%

iii) Dispersión por tipo de Persona:

Total Inversiones Personas Físicas (A)	1.86%
Total Inversiones Personas Físicas (B)	98.14%

iv) Dispersión por segmento de inversión:



4) Riesgo de Crédito:

Al 19 de septiembre 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.