

### Exposición al Riesgo de Mercado <sup>(1)</sup>

#### I+GLOBV

	Promedio	Límite	Máximo	Mínimo
2T-2024	1.285%	3.000%	1.301%	1.271%
1T-2024	1.296%		1.306%	1.279%

En promedio y con un 95% de confianza, si se mantiene la volatilidad histórica, el **I+GLOBV** no vería reducido su valor en más de 1.285% del valor del activo neto promedio del fondo.

### Exposición al Riesgo de Crédito <sup>(2)</sup>

PE por Riesgo de Crédito

	2T-2024	1T-2024
	0.000%	0.000%

### Exposición al Riesgo de Liquidez <sup>(3)</sup>

PE por Riesgo de Liquidez Implícito

	2T-2024	1T-2024
	0.776%	0.728%

### Exposición al Riesgo Global <sup>(4)</sup>

Riesgo Global = 1.285% + 0.000% + 0.776% =

**2.061%**

Valor que **cumple** con el Límite para el riesgo Global establecido para el **I+GLOBV**, 1.10 veces el límite autorizado para el riesgo de Mercado  
[ 1.10\*3.000% = 3.300% ]

### Notas

- (1) Máxima minusvalía del precio de las acciones del fondo a lo largo de 1 día.
- (2) Monto con respecto al valor de la cartera que el fondo podría perder en el período de 1 año, si todos los títulos privados con la posición actual, probabilísticamente fueran degradados desde su posición actual crédito hasta una calificación menor que A.
- (3) Estimación de la pérdida esperada en condiciones de liquidez del mercado.
- (4) Suma lineal de las exposiciones del Fondo a los riesgos de Mercado, Crédito y Liquidez.