



## GESTIÓN DE PRUEBAS DE RESISTENCIA

### Resolución General N°757/2018 CNV

**Sociedad Gerente:** Macro Fondos S.A. Sociedad Gerente de Fondos Comunes de Inversión

**Fondo Money Market:** Fondo Goal Pesos

**Información al 30/06/2024**

#### 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 Macro Fondos, 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.

<b>GOAL PESOS</b>	<b>472.424.244.012,87</b>	<b>100,00%</b>
<b>Liquidez 1 Semana</b>	277.323.236.957,21	<b>58,70%</b>
Liquidez Inmediata	251.192.141.066,76	53,17%
<b>Liquidez 1 Semana</b>	26.131.095.890,45	<b>5,53%</b>
Plazos Fijos	26.131.095.890,45	5,53%
<b>Liquidez + 1 Semana</b>	195.101.007.055,66	<b>41,30%</b>
Plazos Fijos	104.778.691.780,98	22,18%
Plazos Fijos Precancelables	71.839.589.039,29	15,21%
Otros	18.482.726.235,39	3,91%

## 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 0,00124867681607741.

## 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	16,69%
Cuotapartista 2	7,30%
Cuotapartista 3	5,32%
Cuotapartista 4	3,82%
Cuotapartista 5	3,04%
Cuotapartista 6	2,88%
Cuotapartista 7	2,66%
Cuotapartista 8	2,61%
Cuotapartista 9	2,49%
Cuotapartista 10	2,38%
Cuotapartista 11	1,72%
Cuotapartista 12	1,53%
Cuotapartista 13	1,47%
Cuotapartista 14	1,08%
Cuotapartista 15	1,04%
Cuotapartista 16	1,04%
Cuotapartista 17	1,03%
Cuotapartista 18	0,99%
Cuotapartista 19	0,92%
Cuotapartista 20	0,88%

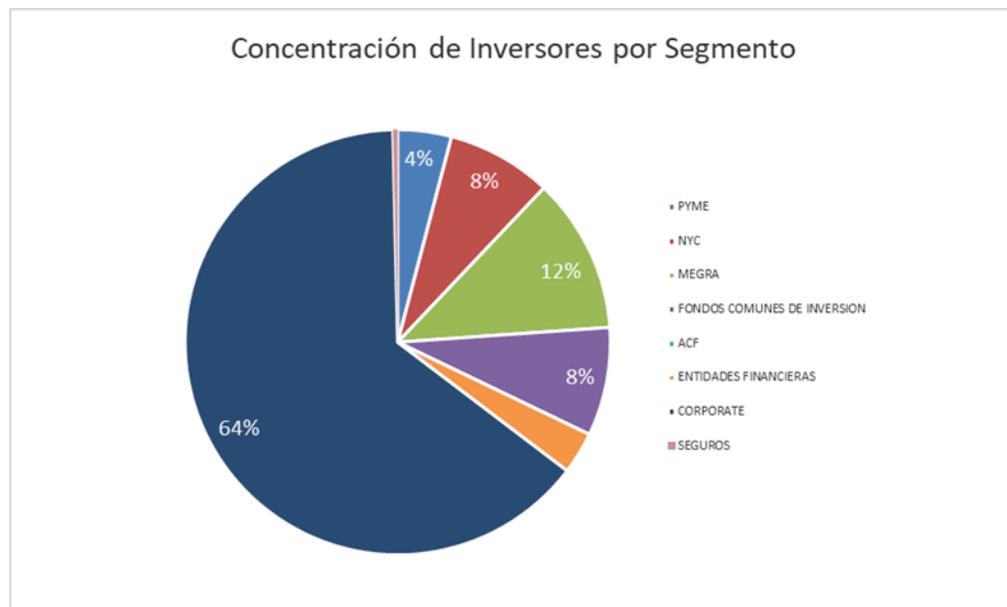
ii) Concentración del patrimonio en los 10,20 y 50 principales cuotapartistas:

	TOP 10	TOP 20	TOP 50
% PN	49,19%	60,91%	77,55%

iii) Dispersión por tipo de Persona:

Total Inversiones Personas Físicas (A)	3,29%
Total Inversiones Personas Físicas (B)	96,71%

iv) Dispersión por segmento de inversión:



#### 4) Riesgo de Crédito:

Al 30 de junio de 2024, 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.