



GESTIÓN DE PRUEBAS DE RESISTENCIA
Resolución General N°757/2018 CNV

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

Fondo Money Market: Fondo Goal Pesos
Información al 30/09/2024

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, Caucciones 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	362,834,320,168.76	100.00%
Liquidez 1 Semana	246,633,531,379.62	67.97%
Liquidez Inmediata	240,411,860,146.75	66.26%
Liquidez 1 Semana	6,221,671,232.87	1.71%
Plazos Fijos	6,221,671,232.87	1.71%
Liquidez + 1 Semana	116,200,788,789.14	32.03%
Plazos Fijos	92,377,908,904.11	25.46%
Plazos Fijos		
Precancelables	10,081,164,383.50	2.78%
Otros	13,741,715,501.53	3.79%

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 0.07209%.

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	10.81%
Cuotapartista 2	5.41%
Cuotapartista 3	4.05%
Cuotapartista 4	3.01%
Cuotapartista 5	2.82%
Cuotapartista 6	2.36%
Cuotapartista 7	2.31%
Cuotapartista 8	2.10%
Cuotapartista 9	2.05%
Cuotapartista 10	1.79%
Cuotapartista 11	1.76%
Cuotapartista 12	1.69%
Cuotapartista 13	1.63%
Cuotapartista 14	1.59%
Cuotapartista 15	1.55%
Cuotapartista 16	1.47%
Cuotapartista 17	1.36%
Cuotapartista 18	1.34%
Cuotapartista 19	1.17%
Cuotapartista 20	1.15%



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

	TOP 10	TOP 20	TOP 50
% PN	36.70%	51.41%	70.08%

iii) Dispersión por tipo de Persona:

Total Inversiones Personas Físicas (A)	6.70%
Total Inversiones Personas Jurídicas (B)	93.30%

4) Riesgo de Crédito:

Al 30 de septiembre 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 cartera posee activos considerados de alta calidad crediticia. Al menos un 95% de las inversiones corresponde a emisores con calificación A1+.