

Exposición al Riesgo de Mercado ⁽¹⁾

COLRVL

	Promedio	Límite	Máximo	Mínimo
2T-2024	1.498%	2.900%	1.518%	1.471%
1T-2024	0.984%		1.507%	0.023%

En promedio y con un 95% de confianza, si se mantiene la volatilidad histórica, el COLRVL no vería reducido su valor en más de 1.498% del valor del activo neto promedio del fondo.

Exposición al Riesgo de Crédito ⁽²⁾

	2T-2024	1T-2024
PE por Riesgo de Crédito	0.000%	0.000%

Exposición al Riesgo de Liquidez ⁽³⁾

	2T-2024	1T-2024
PE por Riesgo de Liquidez Implícito	0.542%	0.589%

Exposición al Riesgo Global ⁽⁴⁾

$$\text{Riesgo Global} = 1.498\% + 0.000\% + 0.542\% = \mathbf{2.040\%}$$

Valor que cumple con el Límite para el riesgo Global establecido para el COLRVL, 1.10 veces el límite autorizado para el riesgo de Mercado
[1.10*2.900% = 3.190%]

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 iliquidez del mercado.
- (4) Suma lineal de las exposiciones del Fondo a los riesgos de Mercado, Crédito y Liquidez.