

Exposición al Riesgo de Mercado ⁽¹⁾

I+CORP

	Promedio	Límite	Máximo	Mínimo
2T-2024	0.038%	0.500%	0.095%	0.027%
1T-2024	0.033%		0.037%	0.032%

En promedio y con un 95% de confianza, si se mantiene la volatilidad histórica, el **I+CORP** no vería reducido su valor en más de 0.038% del valor del activo neto promedio del fondo.

Exposición al Riesgo de Crédito ⁽²⁾

PE por Riesgo de Crédito

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

Exposición al Riesgo de Liquidez ⁽³⁾

PE por Riesgo de Liquidez Implícito

2T-2024	1T-2024
0.030%	0.033%

Exposición al Riesgo Global ⁽⁴⁾

$$\text{Riesgo Global} = 0.038\% + 0.000\% + 0.030\% = \boxed{0.068\%}$$

Valor que **cumple** con el Límite para el riesgo Global establecido para el **I+CORP**, 1.10 veces el límite autorizado para el riesgo de Mercado
 [$1.10 \cdot 0.500\% = 0.550\%$]

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.