

PCR ratifica la clasificación de riesgo fundamental en “PEAAf+”, de riesgo integral en “PEC1f+”, riesgo de mercado en “PEC1” y riesgo fiduciario en “PEAAAf”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Liquidez Soles FMIV

Lima (febrero 13, 2023): PCR decidió ratificar las clasificaciones de riesgo fundamental en “PEAAf+”, de riesgo integral en “PEC1f+”, riesgo de mercado en “PEC1” y riesgo fiduciario en “PEAAAf”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Liquidez Soles FMIV, con fecha de información al 30 de setiembre del 2023.

El fondo invierte en instrumentos de deuda en mercado local como internacional a corto plazo, buscando que la duración del portafolio se ubique entre 90 y 360 días. Es así como, el Fondo alcanzó una duración promedio de 178 días (+9 días vs junio 2023), manteniéndose dentro del rango establecido por el Fondo.

Por otro lado, el patrimonio se ubicó en S/ 1,637 MM, mostrando un incremento trimestral de 12.2% (S/ +178.0 MM) e interanual de 7.3% (S/ +111.6 MM). El valor cuota del Fondo presentó una rentabilidad trimestral de 1.8% y anual de 7.1%.

A la fecha de corte, el portafolio se compone con el 86.6% de las inversiones en depósitos a plazo, el 9.5% en bonos corporativos, 2.1% en certificados de depósitos y 2.1% en cuotas de participación en fondos de inversión. Asimismo, en cuanto a la calidad del portafolio, el 78.9% (jun-23: 73.7%) del portafolio corresponde a inversiones de clasificación “AAA”, mientras que el 19.2% (jun-23: 24.0%) con clasificación de “AA+/-”; compatible con el perfil conservador del Fondo. El 1.9% restante corresponde a instrumentos “A+/-” (jun-23: 2.2%).

Metodología utilizada para la determinación de esta calificación:

La opinión contenida en el informe se ha basado en la aplicación rigurosa de la metodología de calificación de riesgo de fondos de inversión vigente aprobada en Sesión 04 de Comité de Metodologías con fecha 09 de julio 2016.

Información Regulatoria:

La clasificación de riesgo del valor constituye únicamente una opinión profesional sobre la calidad crediticia del valor y/o de su emisor respecto al pago de la obligación representada por dicho valor. La clasificación otorgada o emitida por PCR no constituye una recomendación para comprar, vender o mantener el valor y puede estar sujeta a actualización en cualquier momento. Asimismo, la presente clasificación de riesgo es independiente y no ha sido influenciada por otras actividades de la Clasificadora.

Información de Contacto:

Ines Vidal

Analista

ividal@ratingspcr.com

Oficina Perú

Edificio Lima Central Tower

Av. El Derby 254, Of. 305 Urb. El Derby

T (511) 208-2530

Michael Landauro

Analista Senior

mlandauro@ratingspcr.com