

PCR ratifica la clasificación de riesgo fundamental en “PEAA_f+”, de riesgo integral en “PEC2_f+”, riesgo de mercado en “PEC3-” y riesgo fiduciario en “PEAAA_f”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Soles FMIV

Lima (febrero 13, 2023): PCR decidió ratificar las clasificaciones de riesgo fundamental en “PEAA_f+”, de riesgo integral en “PEC2_f+”, riesgo de mercado en “PEC3-” y riesgo fiduciario en “PEAAA_f”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Soles FMIV, con fecha de información al 30 de setiembre del 2023.

El fondo invierte en bonos corporativos, depósitos a plazo, bonos soberanos, fondos y certificados de depósitos, en el mercado local y extranjero, buscando que la duración del portafolio se ubique entre 361 y 1,080 días como máximo. Es así como, el Fondo registró una duración promedio de 774 días, dentro de los límites de la política establecidos por el Fondo y mayor en 92 días a lo registrado el trimestre anterior.

Por otro lado, el patrimonio del Fondo alcanzó los S/ 314.6 MM, exhibiendo una reducción trimestral de 1.0% (-S/ 3.3 MM). El valor cuota se ubicó en S/ 188.2, presentando una rentabilidad anual de 8.7% (trimestral de 1.3%).

Las inversiones del Fondo están representadas en un 91.1% (jun-23: 90.7%) por instrumentos de alta calidad crediticia (“AAA, AA+/-”), lo que va acorde con el perfil de riesgo y características del Fondo; se evidencia un ligero incremento en las inversiones en instrumentos de dicha calidad crediticia y una disminución en las inversiones en instrumentos con calificación “A+/-” el cual se ubicó en 8.9% (jun-23: 9.3%), además presenta una inversión mínima en instrumentos sin rating (0.02%). Según el tipo de instrumento, las inversiones se encuentran principalmente distribuidas en bonos corporativos (52.2%), depósitos a plazo (31.9%), cuotas de participación (7.7%), bonos soberanos (6.9%) e instrumentos de corto plazo (1.3%).

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
mlandauero@ratingspcr.com