

**PCR ratifica la clasificación de riesgo fundamental en “PEAAf”, riesgo integral en “PEC2f”, riesgo de mercado en “PEC3-” y riesgo fiduciario en “PEAAf” con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Dólares FMIV**

**Lima (febrero 13, 2023):** PCR decidió ratificar las clasificaciones riesgo fundamental en “PEAAf”, riesgo integral en “PEC2f”, riesgo de mercado en “PEC3-” y riesgo fiduciario en “PEAAf” con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Dólares FMIV, con fecha de información al 30 de setiembre del 2023.

El Fondo invierte en bonos, depósitos a plazo y fondos, tanto en el mercado local como en el extranjero, el cual busca que la duración del portafolio se ubique entre 361 y 1,080 días. En consecuencia, presentó una duración promedio de 606 días, consistente con el perfil de duración del Fondo11, menor a lo registrado el trimestre anterior (-69 días vs jun-23).

El patrimonio del Fondo totalizó en US\$ 145.7 MM, mostrando una reducción trimestral de 1.2% (-US\$ 1.8 MM) y una disminución interanual de 14.0% (-US\$ 23.7 MM). El valor cuota se ubicó en US\$ 248.1, registrando un rendimiento trimestral de 0.9% y anual de 5.5%.

Las inversiones del Fondo estuvieron conformadas en un 78.2% (jun-23: 78.5%) por instrumentos de alta calidad crediticia (“AAA, AA+/-”), mientras que la inversión en instrumentos de calificación “A+/-” se ubicó en 21.8% (jun23: 21.4%). En cuanto a los tipos de instrumentos, el portafolio está compuesto por bonos corporativos (49.8%), depósitos a plazo (41.6%) y cuotas de participación en fondos (8.6%), sumando así una total de 55 activos. Los principales mercados destino de las inversiones son Perú con un 40.0% de participación, seguido por Colombia con 16.4% y Chile 10.9%.

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](mailto: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](mailto:mlandauro@ratingspcr.com)