

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 (14 de mayo de 2024): En comité de Clasificación de Riesgo, PCR ratificar las clasificaciones de riesgo integral en “PEC1f+”, riesgo fundamental en “PEAA”, 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

A diciembre del 2023, la cartera de inversiones está compuesto por 93 instrumentos. A detalle, el 83.2% del portafolio corresponde a inversiones con clasificación “AAA”, 14.3% con clasificación de “AA”; y el 2.4% restante corresponde a instrumentos “A+/-”, lo cual es compatible con el perfil de riesgo del Fondo. En cuanto al portafolio por tipo de instrumento, el 87.5% de las inversiones se destinaron a depósitos a plazo, el 7.7% bonos corporativos, 2.5% certificados de depósitos y el 1.9% restante en cuotas de participación en fondos de inversión.

La duración promedio del portafolio, a diciembre del 2023, fue de 191 días (set-2023: 178 días), manteniéndose dentro del rango establecido por el Fondo. Por el lado del riesgo de tipo de cambio, el 2.9% del portafolio está invertido en moneda distinta al valor cuota. Cabe resaltar que el fondo tiene permitido coberturar sus operaciones con contratos forwards.

Credicorp Capital S.A SAF posee la experiencia y el *know how* del mercado de fondos mutuos por más de 20 años que permiten posicionarse como líder del segmento, manteniendo una adecuada administración y control de riesgos. Al 31 de diciembre de 2023, Credicorp SAF se encarga de la administración de sesenta y seis fondos mutuos de inversión en valores; además, el patrimonio administrado por Credicorp Capital S.A. – SAF, se ubicó en S/ 10,518 MM.

La 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:

Alejandra Zelada

Analista

azelada@ratingspcr.com

Oficina Perú

Edificio Lima Central Tower

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

T (511) 208-2530

Michael Landauro Abanto

Analista Senior

mlandauro@ratingspcr.com