

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

**Lima (14 de mayo de 2024):** PCR decidió asignar las clasificaciones de riesgo integral en “PEC2f”, riesgo fundamental en “PEAAf”, riesgo de mercado en “PEC3-” y riesgo fiduciario en “PEAAAf” con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Dólares FMIV.

A diciembre del 2023, el 79.1% (set-2023: 78.2%) estaba compuesta por instrumentos de alta calidad crediticia (“AAA, AA+/-”), mientras que el 0.9% por instrumentos de calificación “A+/-” (set-2023: 21.8%). Según el tipo de instrumento, el Fondo invierte en bonos corporativos (47.7%), depósitos a plazo (44.3%) y cuotas de participación en fondos (8.0%), haciendo un total de 64 activos de inversión.

La duración promedio del portafolio fue de 639 días (+33 días vs set-2023), manteniéndose dentro de sus límites. El riesgo de tipo de cambio del Fondo es bajo, ya que mantiene el 81.2% de sus inversiones en la moneda del valor cuota (dólares). En cuanto al riesgo de concentración, este se considera moderado, dado que, los 10 principales partícipes representan el 25.1% del patrimonio.

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