

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 Soles FMIV

Lima (14 de mayo de 2024): En comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió ratificar 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 Soles FMIV.

A diciembre del 2023, las inversiones del Fondo estuvieron compuestas en 91.0% (set-23: 91.1%) por instrumentos de alta calidad crediticia (“AAA, AA+/-”), lo que va acorde con el perfil de riesgo y características del Fondo; mientras que las inversiones en instrumentos con calificación “A+/-” se ubicó en 9.0% (set-23: 8.9%). Según el tipo de instrumento, las inversiones se encuentran distribuidas en bonos corporativos (52.7%), depósitos a plazo (26.2%), bonos soberanos (13.5%) y cuotas de participación de fondos de inversión (7.7%).

La duración promedio del portafolio, a diciembre 2023, se ubicó en 914 días, dentro de los límites de la política establecida por el Fondo y mayor en 141 días a lo registrado el trimestre anterior, por lo que la sensibilidad a la tasa de interés sigue siendo alta. En cuanto a los indicadores de liquidez, cabe destacar que el porcentaje de activos de rápida circulación fue de 39.6% ligeramente inferior al trimestre anterior. El riesgo de concentración de 10 partícipes aumentó al pasar de 25.0% a 28.0%.

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