

**PCR mantiene la calificación de riesgo fundamental a “*PEAAA*”, riesgo integral en “*PEC2f+*”, riesgo de mercado en “*PEC3*” y riesgo fiduciario en “*PEAAf+*” con perspectiva “Estable”
Cuotas de Participación del Fondo Sura Corto Plazo Dólares FMIV**

Lima (24 de junio, 2024): En comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió ratificar la clasificación de riesgo de mercado en “*PEC3*”, riesgo fiduciario en “*PEAAf+*”, riesgo integral en “*PEC2f+*”, y la clasificación del riesgo fundamental en “*PEAAA*” con perspectiva ‘estable’; con información no auditada al 31 de marzo de 2024. Las calificaciones consideran la calidad crediticia de los instrumentos invertidos, la liquidez adecuada para el horizonte de inversión del Fondo y la amplia experiencia del gestor Fondos Sura SAF S.A.C, lo que permitió mantener los indicadores de riesgo acordes al apetito del Fondo.

Sura Corto Plazo Dólares FMIV es una alternativa de inversión en dólares americanos, a través de instrumentos representativos de deuda, principalmente de corto plazo, tanto en mercados locales como internacionales.

A marzo 2024, el Patrimonio del Fondo totalizó en US\$ 41.4 MM, presentando un aumento de 10.4% (+US\$ 3.9 MM) de forma trimestral, como resultado principalmente del aumento de capital en 9.0% (US\$ 2.6 MM) y resultados acumulados en 17.1% (US\$ 1.9 MM). En línea con lo mencionado, el número de cuotas en circulación aumentó en 9.0% (+25,817 cuotas) respecto al trimestre previo, situándose en 311,462 cuotas; mientras el número de partícipes se ubicó en 693, monto superior en 26 partícipes respecto al trimestre previo. El valor cuota alcanzó los US\$ 132.9, con una rentabilidad anual de 5.1%, ubicándose por encima de su *benchmark* anual asociado (3.9%); en esa línea, la rentabilidad trimestral del valor cuota fue de 1.2%, en línea a la rentabilidad trimestral del *benchmark* (0.9%).

A marzo 2024, la cartera de activos en los que invierte el Fondo estuvo concentrada en un 74.3% (dic-2023: 80.1%) en instrumentos de calidad crediticia “AAA”, complementado por un 25.7% en instrumentos con calificación “AA+/-”. Las inversiones del Fondo estuvieron compuestas por depósitos a plazo (71.1%) y bonos corporativos (28.9%). Adicionalmente, el Fondo invirtió principalmente en el sector financiero (87.7%), mientras que la diferencia corresponde a sectores de energía (4.4%), gobierno (3.5%), comercio (2.5%) y telecomunicaciones (1.8%). En términos de diversificación por emisor, el portafolio se encuentra conformado por 54 instrumentos, segmentado en 29 emisores, donde los 3 emisores más representativos son: BTG Pactual Chile (14.4%), Banco Interamericano de Finanzas (8.5%), Itaú Corpbanca (8.1%). Por su lado, la duración promedio del Fondo se ubicó en 0.7 años (256 días), levemente por encima de lo registrado a dic-2023 (0.6 años). Finalmente, a marzo 2024, las suscripciones totalizaron los US\$ 9.2 MM, monto superior en +US\$ 5.0 MM respecto al trimestre anterior (dic-2023: US\$ 4.3 MM), mientras los rescates fueron US\$ 5.8 MM, mayores en 2.7% (+US\$ 0.2 MM); en consecuencia, las SNR fueron US\$ 3.4 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 información empleada en la presente clasificación proviene de fuentes oficiales; sin embargo, no garantizamos la confiabilidad e integridad de la misma, por lo que no nos hacemos responsables por algún error u omisión por el uso de dicha información. La clasificación otorgada o emitida por PCR constituyen una evaluación sobre el riesgo involucrado y una opinión sobre la calidad crediticia, y la misma no implica recomendación para comprar, vender o mantener un valor; ni una garantía de pago del mismo; ni estabilidad de su precio 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

Michael Landauro
Analista Senior
mlandauro@ratingspcr.com

Oficina Perú

Edificio Lima Central Tower - Av. El Derby 254, Of. 305 Urb. El Derby, T (511) 208-2530