

**PCR ratifica la clasificación de riesgo fundamental en “<sub>PE</sub>AAf+”, de riesgo integral en “<sub>PE</sub>C2f+”, riesgo de mercado en “<sub>PE</sub>C3” y riesgo fiduciario en “<sub>PE</sub>AAAf”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Corto Plazo Dólares FMIV**

**Lima (09 de agosto de 2024):** En comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió ratificar las clasificaciones de riesgo fundamental en “<sub>PE</sub>AAf+”, de riesgo integral en “<sub>PE</sub>C2f+”, riesgo de mercado en “<sub>PE</sub>C3” y riesgo fiduciario en “<sub>PE</sub>AAAf”, con perspectiva estable a las cuotas de participación del Fondo Credicorp Capital Conservador Corto Plazo Dólares FMIV.

A diciembre de 2023, la cartera de inversiones del Fondo está compuesta por 59 instrumentos y 36 emisores. Asimismo, según la estructura del portafolio por tipo de instrumento, las inversiones del Fondo estuvieron conformadas por 67.2% en depósitos a plazo, 22.8% en bonos corporativos y 10.0% en cuotas de participación en fondos de inversión. Entre los principales emisores se encuentran el Banco de Crédito del Perú (16.0%), BCI Miami (8.9%), Itaú CorpBanca (8.8%) excediendo ligeramente los límites establecidos por el regulador (SMV) mientras que, por Grupo Económico, el 26.2% del portafolio está invertido en subsidiarias del Grupo Credicorp, el 15.6% en el Grupo Itaú y un 5.6% en Scotiabank.

El Fondo alcanzó una duración promedio del portafolio de 0.6 años (204 días) manteniéndose dentro de los límites establecidos por el Fondo. Adicionalmente, el 78.8% de las inversiones se encuentra en moneda del valor cuota (dólar) por lo que se encuentra expuestos al alza sostenida al tipo de cambio; por lo que, el Fondo mantiene forwards de moneda con el fin de aminorar el riesgo cambiario.

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)