

PCR sube la clasificación de riesgo de mercado de “PEC3” a “PEC2-” y ratificar las clasificaciones de riesgo fundamental en “PEAAf+”, de riesgo integral en “PEC2f+” y riesgo fiduciario en “PEAAf”, con perspectiva “Estable” a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Corto Plazo Soles FMIV

Lima (12 de setiembre de 2025): En comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió subir la clasificación de riesgo de mercado de “PEC3” a “PEC2-” y ratificar las clasificaciones de riesgo fundamental en “PEAAf+”, de riesgo integral en “PEC2f+” y riesgo fiduciario en “PEAAf”, con perspectiva “Estable” a las cuotas de participación del Fondo Credicorp Capital Conservador Corto Plazo Soles FMIV.

A diciembre de 2024, el portafolio del Fondo estuvo compuesto por 92 activos, en donde el 59.6% se encuentra conformado por instrumentos financieros de calificación “AAA”, 23.8% en instrumentos AA+/-” y un 16.6% en instrumentos de calificación “A+/-”. Según el tipo de instrumento, la cartera se encontró representada principalmente por depósitos a plazo, seguido de bonos corporativos y cuotas de participación en fondos.

Al corte de análisis, el Fondo alcanzó una duración promedio del portafolio de 0.8 años (279 días), por debajo de lo registrado en set-2024, manteniéndose dentro del límites establecidos por el Fondo. A diciembre 2024, 63.9% del fondo está en soles y 36.1% en dólares, sin embargo, esta exposición está cubierta al 100% mediante operaciones forwards, por lo que estaría cumpliendo el límite de 25% en otras monedas, considerando las coberturas mediante 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 2024, Credicorp SAF se encarga de la administración de sesenta y tres fondos mutuos¹ de inversión en valores. Asimismo, el patrimonio administrado por Credicorp Capital S.A. – SAF, se ubicó en S/ 15,523 MM (+47.6% vs dic-2023), lo que representa un 32.3% del patrimonio total del mercado peruano de fondos mutuos, ello debido a la adecuada estructura organizacional y fortalecimiento de las prácticas de buen gobierno corporativo. Es preciso resaltar que cuenta con el Banco de Crédito del Perú como custodio y con Credicorp Capital Perú S.A.A como principal accionista (99.99%).

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 (Perú) vigente del Manual de Clasificación de Riesgo, actualizado en Comité de Metodologías con fecha 18 de octubre de 2022.

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:

Solange Chipana

Analista

schipana@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

mlandauero@ratingspcr.com

¹ Información publicada por la SMV.