

PCR ratifica las clasificaciones de riesgo integral en “_{PE}C1f+”, riesgo fundamental en “_{PE}AA+”, riesgo de mercado en “_{PE}C1” y riesgo fiduciario en “_{PE}AAf”, con perspectiva “Estable” a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Liquidez Soles FMIV

Lima (12 de setiembre de 2025): En comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió ratificar las clasificaciones de riesgo integral en “_{PE}C1f+”, riesgo fundamental en “_{PE}AA+”, riesgo de mercado en “_{PE}C1” y riesgo fiduciario en “_{PE}AAf”, con perspectiva “**Estable**”, con información auditada al 31 de diciembre de 2024 a las cuotas de participación del fondo Credicorp Capital Conservador Liquidez Soles FMIV.

A diciembre del 2024, la cartera de inversiones está compuesto por 141 instrumentos. A detalle, el 76.0% del portafolio corresponde a inversiones de clasificación “AAA”, mientras que el 11.8% con clasificación de “AA+/-” y el 12.3% restante corresponde a instrumentos “A+/-”. Asimismo, el portafolio se encuentra compuesto principalmente por inversiones en depósitos a plazo, seguidas de bonos corporativos y cuotas de participación en fondos de inversión, concentrándose principalmente en el sector financiero.

La duración promedio del fondo fue de 0.7 años (240 días), sin variación con respecto a set-2024, manteniéndose dentro del rango establecido por el Fondo¹. Por el lado del riesgo de tipo de cambio, el 28.8% del portafolio se encuentra en inversiones en moneda distinta del valor cuota (dólares americanos), sin embargo esta exposición está cubierta al 100% mediante operaciones forwards por lo que estaría cumpliendo el límite de 10% 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 mutuos² 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

mlandauro@ratingspcr.com

¹ De 90 días hasta 1 año.

² Información publicada por la SMV.