

PCR decide ratificar las clasificaciones de Riesgo fundamental en “PEAf”, Riesgo de mercado en “PE2”, Riesgo integral en “PEC2f” y Riesgo fiduciario en “PEAf+”, con perspectiva “estable”, al Fondo de Inversión Senior Loans BDC Soles 2

Lima (18 de noviembre de 2025): En Comité de Clasificación de Riesgo, PCR decidió ratificar la calificación de Riesgo Integral en “PEM2f”, Riesgo Fundamental en “PEAf”, Riesgo de Mercado en “PEM2” y Riesgo Fiduciario en “PEAf+” del Fondo de Inversión Senior Loans BDC Soles 2 con perspectiva Estable; con información no auditada al 30 de junio de 2025. La decisión se fundamenta en la evaluación del perfil de riesgo del Fondo, el apetito por riesgo y el know-how aplicado en la evaluación y seguimiento de las inversiones, considerando además la exposición al riesgo de mercado, los primeros resultados positivos de rentabilidad y el monitoreo activo del portafolio respaldado por garantías.

El Fondo de inversión “Senior Loans BDC Soles 2” (el Fondo) busca generar valor para sus partícipes a través de la inversión en Préstamos Corporativos o Acreencias Comerciales o Bonos Privados, de mediano y largo plazo, con tasas fijas, denominados en moneda nacional. El Fondo se encuentra inscrito en el RPMV de la SMV bajo Régimen Simplificado y se encuentra próximo a iniciar operaciones. El Fondo tendrá una vigencia de 10 años, dividido en 2 periodos: i) Periodo de inversión hasta 3 años, prorrogable hasta 2 años adicionales. ii) Periodo de desinversión de 7 años, prorrogable de hasta 3 años adicionales.

Al cierre de la evaluación, el 100% de las inversiones del Fondo se concentra en Perú. La única empresa del portafolio presenta rating local “A+” y pertenece al sector Bienes Raíces. El Fondo mantendrá un monitoreo activo mediante un semáforo de compañías, donde se revisarán y evaluarán las obligaciones financieras de forma trimestral a partir de diciembre de 2025. Además, se destacan las garantías reales y cartas fianzas que las respaldan.

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 Comité de Metodologías con fecha 18 de octubre 2022.

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 constituye una evaluación sobre el riesgo involucrado y una opinión sobre la calidad crediticia. 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:

Solange Chipana
Analista Financiero
schipana@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