

PCR ratifica la calificación de riesgo fundamental “*PEAAf*” con perspectiva “Estable” a las Cuotas de Participación del Fondo Sura Ultra Cash Dólares FMIV

Lima (abril 28, 2020): PCR acordó ratificar la calificación de riesgo fundamental a las cuotas de participación del Fondo Sura Ultra Cash Dólares FMIV en “*PEAAf*”, así como ratificar las calificaciones de riesgo de mercado en “*PEC2-*”, riesgo fiduciario en “*PEAAf+*” y riesgo integral en “*PEC2f*”. Las calificaciones consideran la calidad crediticia de los instrumentos invertidos, la liquidez adecuada para el horizonte de inversión del Fondo, la amplia experiencia del gestor, así como el respaldo del Grupo Sura, lo que permitió mantener los indicadores de riesgo acordes al apetito del Fondo.

Sura Ultra Cash Dólares es una alternativa de inversión que cotiza en dólares, dirigidos a personas naturales y jurídicas que tienen un perfil de riesgo conservador y que desean invertir en instrumentos representativos de deuda, principalmente de muy corto plazo, tanto en mercados locales como internacionales. La duración promedio del portafolio es de 90 días como máximo.

La calificación de riesgo fundamental promedio ponderado (RFPP) mantiene la puntuación de AA a septiembre de 2019, por su posición en activos de alta calidad crediticia. Adicionalmente, las inversiones están concentradas en entidades del sector financiero, mientras que la duración (96 días) se mantiene ligeramente fuera del rango establecido en su política de inversiones, sin embargo, ello fue regularizado a mar-20 acorde con el plazo regulatorio; Cabe precisar que el 92.0% de los activos invertidos son de rápida circulación, siendo holgado para satisfacer el riesgo de rescates.

Finalmente, el patrimonio del Fondo alcanzó los US\$ 175.3 MM, registrando un aumento trimestral de +5.8% (+ US\$ 9.6 MM). Asimismo, el valor de la cuota mantiene su tendencia creciente al trimestre evaluado, y obtuvo una rentabilidad trimestral nominal de 0.57% y anual de 2.54%, ambos superiores al del *benchmark* en +0.20 p.p. y +0.84 p.p., respectivamente.

Metodología fue utilizada para la determinación de esta calificación:
Metodología de calificación de riesgo de fondos de inversión (Perú).

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:

Julio Rioja Ruiz
Analista de Riesgo
jrioja@ratingspcr.com

Daicy Peña Ortiz
Analista Senior
dpena@ratingspcr.com

Oficina Perú

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