

PCR acordó asignar la clasificación de riesgo integral de “PEC2+f”, riesgo fundamental de “PEAAf”, riesgo de mercado en “PEC2+” y riesgo fiduciario en “PEAAf” con perspectiva “Estable” a las cuotas de participación del Fondo Mutuo IF Libre Disponibilidad Soles FMIV

Lima (julio 21, 2022): PCR acordó asignar la clasificación de riesgo integral de “PEC2+f”, riesgo fundamental de “PEAAf”, riesgo de mercado en “PEC2+” y riesgo fiduciario en “PEAAf” con perspectiva “Estable” a las cuotas de participación del Fondo Mutuo IF Libre Disponibilidad Soles FMIV, con información no Auditada al 31 de marzo de 2022. La clasificación se fundamenta en los siguientes argumentos:

El fondo invierte únicamente en instrumentos representativos de deuda o pasivos predominantemente en soles (mínimo 75%). Asimismo, podrá invertir tanto en el mercado local como en el extranjero hasta 100% de su activo total manteniendo una duración del portafolio flexible. El fondo busca lograr un rendimiento superior al promedio simple de las tasas de interés anual para los depósitos de ahorro en soles de los cuatro primeros bancos locales. El patrimonio administrado a la fecha totalizó en S/ 1,128.0 MM reflejando una contracción interanual de 23.4% derivado de la contracción de las cuotas en circulación de 24.2%. El valor cuota de cerró en S/ 118.5 para la serie A y en S/ 118.7 para la serie B, presentando una rentabilidad anualizada de 1.2% ubicándose por debajo de su benchmark asociado (2.92%).

A la fecha de análisis, el fondo presenta una concentración de portafolio de 65.4% de sus inversiones en entidades financieras locales e internacionales de alta calidad (“AAA” y “AA+/-”), mostrando una ligera caída con respecto al trimestre pasado, sin embargo, considerando los instrumentos con calificación “A+/-” de 23.9% del portafolio, la participación asciende al 89.4%, porcentaje superior al mostrado en el trimestre pasado (Dic-21: 86.7%). El 10.6% restante se corresponde con instrumentos sin calificación de riesgo compuesto principalmente por cuotas de participación de fondos de inversión y pagarés.

Metodología

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 de contacto:

Información de Contacto:

Michael Landauro

Analista Senior

M mlandauro@ratingspcr.com

Daicy Peña

Analista Senior

M dpena@ratingspcr.com

Oficina País

Av. El Derby 254, Of. 305 Urb. El Derby, Lima-Perú

T (511) 208-2530

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 constituyen una evaluación sobre el riesgo involucrado y una opinión sobre la calidad crediticia, y 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.