

PCR ratifica la calificación de riesgo fundamental “*PEAAA*” con perspectiva ‘Estable’ Cuotas de Participación del Fondo Credicorp Capital Conservador Mediano Plazo Dólares.

Lima (enero 31, 2019): PCR acordó ratificar las clasificaciones vigentes de Credicorp Conservador Mediano Plazo Dólares debido a los siguientes argumentos:

El portafolio del Fondo se compone, principalmente, de inversiones en instrumentos de deuda con horizonte de mediano plazo y con alta calidad crediticia (AAA, AA+/-, CP1+/-)¹; representando el 89.1% del total de las inversiones. El Fondo invierte principalmente en Bonos Corporativos (56%), depósitos a plazo (40.5%) y Fondos de Terceros (3.5%). Asimismo, se considera la adecuada diversificación del portafolio tanto por emisor como por instrumento.

Por otro lado, el Fondo mantiene una adecuada exposición a las variaciones de las tasas de interés; siendo la duración promedio y modificada de 874 días y 2.28 respectivamente, ambas se encuentran dentro de los límites establecidos en su política². Por otro lado, el fondo no mantiene una exposición al riesgo de tipo de cambio, al mantener el 100% de sus inversiones en dólares.

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. El presente informe se encuentra publicado en la página web de PCR (<https://www.ratingspcr.com/index.php/clasificacion-de-riesgos-peru-2018>) donde se puede consultar adicionalmente documentos como el código de conducta, la metodología de clasificación respectiva y las clasificaciones vigentes.”

¹ Rating a escala local.

² Hasta de 360 a 1080 días.