

CONSOLIDADO
PORTAFOLIOS DE INVERSIONES
DE FONDOS MUTUOS

*DE MUY CORTO PLAZO
Y DE CORTO PLAZO*

MAY2020



			BBVA PERÚ SOLES CONTINENTAL FM	BBVA S.MONETAR.	Credicorp Capital Conservador Corto Plazo Soles FMIV	IF Cash Soles	IF Oportunidad Soles	SURA CORTO PLAZO SOLES FONDOS SURA SAF
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	6.8%	41.4%	48.1%	47.7%	43.9%	31.8%
A	0.0%	100.0%	6.8%	41.4%	48.1%	47.7%	43.9%	26.8%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	5.0%
C+ a C-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos locales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.2%	4.3%	1.5%
Inversiones con clasificaciones de riesgo internacional:					16.0%			
Corto plazo:	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	36.5%	35.9%	0.0%
CP-1	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-2	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	15.7%	11.4%	0.0%
CP-3	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	8.4%	9.2%	0.0%
CP-4	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	12.3%	15.2%	0.0%
CP-5	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Largo plazo:	0.0%	100.0%	0.0%	2.0%	5.7%	5.8%	8.7%	44.5%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.3%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	0.0%	2.0%	3.4%	0.0%	1.4%	4.6%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	2.1%	5.8%	7.3%	39.9%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	0.0%	2.0%	10.3%	0.0%	0.0%	0.0%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.8%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	0.0%	2.0%	4.5%	0.0%	0.0%	0.0%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	5.0%	0.0%	0.0%	0.0%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos con riesgo del Estado Peruano	0.0%	100.0%	85.5%	0.0%	0.0%	2.7%	2.0%	0.0%
Instrumentos internacionales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.5%	0.0%	0.0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Forwards	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	16.0%	54.4%	58.7%	47.8%
Swaps	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Opciones	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
DURACIÓN DEL PORTAFOLIO	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Duración del Portafolio	0.0	1.00	0.65	0.71	0.77	0.74	0.81	0.63

			BBVA DÓLARES MONETARIO CONTINENTAL FM	CRED. CONSER. CORTO PLAZO \$ CREDIFONDO SAF	DIVISO CONSERVADOR DÓLARES DIVISO FONDOS SAF S.A.	IF CASH	IF LIBRE DISPONIBILIDAD INTERFONDO	IF OPORTUNIDAD INTERFONDO	SURA CORTO PLAZO DÓLARES FONDOS SURA SAF
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	47.3%	21.1%	23.6%	27.9%	41.9%	18.7%	18.5%
A	0.0%	100.0%	47.3%	21.1%	23.6%	27.9%	41.9%	18.7%	18.5%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C+ a C-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos locales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	15.1%	0.0%	0.0%	0.6%	5.8%
Inversiones con clasificaciones de riesgo internacional:				69.3%					
Corto plazo:	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	25.5%	50.5%	43.0%	0.0%
CP-1	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-2	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.3%	0.0%	0.0%
CP-3	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	10.2%	18.0%	15.4%	0.0%
CP-4	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	15.3%	31.3%	27.6%	0.0%
CP-5	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Largo plazo:	0.0%	100.0%	48.9%	31.3%	0.0%	40.8%	0.0%	36.7%	70.2%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	9.6%	2.6%	0.0%	2.8%	0.0%	1.1%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	35.2%	18.5%	0.0%	4.1%	0.0%	1.3%	7.6%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	4.1%	10.2%	0.0%	29.6%	0.0%	33.6%	62.6%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	4.3%	0.0%	0.7%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	42.1%	36.8%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	2.7%	5.4%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	35.2%	19.9%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	4.1%	11.6%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos con riesgo del Estado Peruano	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos internacionales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	1.2%	0.0%	5.3%	7.6%	0.0%	0.0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Forwards	0.0%	100.0%	0.0%	1.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Swaps	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Opciones	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
DURACIÓN DEL PORTAFOLIO	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Duración del Portafolio	0.00	1.00	0.35	1.00	0.71	0.88	0.25	0.86	0.54

			BBVA CASH SOLES CONTINENTAL FM	CREDICORP CAPITAL CONSERVADOR LIQUIDEZ SOLES FMIV	DIVISO EXTRA CONSERV. SOLES DIVISO FONDOS SAF S.A.	IF EXTRA CONSERVADOR SOLES INTERFONDO	IF LIBRE DISPONIBILIDAD S/. INTERFONDO	SURA ULTRA CASH SOLES FONDOS SURA SAF
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	56.3%	88.3%	60.0%	80.9%	86.9%	59.0%
A	0.0%	100.0%	56.3%	88.3%	47.1%	80.9%	86.9%	48.8%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	12.9%	0.0%	0.0%	10.1%
C+ a C-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos locales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	11.5%	0.0%	0.0%	0.2%
Inversiones con clasificaciones de riesgo internacional:				11.7%				
Corto plazo:	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	19.1%	11.3%	0.0%
CP-1	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-2	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	19.1%	11.3%	0.0%
CP-3	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-4	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-5	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Largo plazo:	0.0%	100.0%	4.7%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	36.5%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	4.7%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	6.9%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	29.5%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	4.7%	11.7%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AAA	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	100.0%	4.7%	11.7%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
BB+ a BB-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos con riesgo del Estado Peruano	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos internacionales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Forwards	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	59.5%	53.7%	37.9%
Swaps	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Opciones	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
DURACIÓN DEL PORTAFOLIO	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Duración del Portafolio	0.00	1.00	0.23	0.39	0.222	0.13	0.13	0.16

			BBVA CASH DÓLARES CONTINENTAL FM	CREDICORP CAPITAL CONSERVADOR LIQUIDEZ DÓLARES FMIV	IF EXTRA CONSERVADOR INTERFONDO	SURA ULTRA CASH DÓLARES FONDOS SURA SAF
Entidades Financieras:	0.0%	100.0%	63.0%	60.8%	54.3%	42.6%
A	0.0%	100.0%	63.0%	60.8%	54.3%	42.6%
B+ a B-	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C+ a C-	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos locales sin clasificación	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.0%
Inversiones con clasificaciones de riesgo internacional:				39.2%		
Corto plazo:	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	35.1%	0.0%
CP-1	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-2	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
CP-3	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	18.8%	0.0%
CP-4	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	16.3%	0.0%
CP-5	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Largo plazo:	0.0%	100.0%	34.2%	0.0%	0.0%	54.9%
AAA	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	50.0%	13.0%	0.0%	0.0%	1.5%
BBB+ a BBB-	0.0%	50.0%	20.4%	0.8%	0.0%	10.7%
BB+ a BB-	0.0%	50.0%	0.8%	0.0%	0.0%	42.6%
B+ a B-	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Entidades Financieras	0.0%	100.0%	31.3%	39.2%	0.0%	0.0%
AAA	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
AA+ a AA-	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
A+ a A-	0.0%	50.0%	10.0%	12.1%	0.0%	0.0%
BBB+ a BBB-	0.0%	50.0%	20.4%	22.5%	0.0%	0.0%
BB+ a BB-	0.0%	50.0%	0.8%	4.6%	0.0%	0.0%
B+ a B-	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
C	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
D	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos con riesgo del Estado Peruano	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Instrumentos internacionales sin clasificación	0.0%	50.0%	0.0%	0.0%	10.5%	0.0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Forwards	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Swaps	0.0%	100.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Opciones	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
DURACIÓN DEL PORTAFOLIO	% MÍNIMO	% MÁXIMO	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN	POSICIÓN
Duración del Portafolio	0.00	0.25	0.23	0.32	0.15	0.16



DISCLAIMER

La información correspondiente al presente informe es suministrada por las Administradoras de Fondos asociadas a la Asociación de Administradoras de Fondos del Perú (en adelante AAF) para el periodo correspondiente e incluye los fondos operativos y pre operativos.

Los datos y cifras presentadas no incorporan información de FARO CAPITAL SOCIEDAD ADMINISTRADORA DE FONDOS S.A., EL DORADO ASSET MANAGEMENT SOCIEDAD ADMINISTRADORA DE FONDOS S.A., PROMOINVEST SOCIEDAD ADMINISTRADORA DE FONDOS S.A.A. debido a que no pertenecen a la Asociación a la fecha de elaboración y reporte del presente informe.

El informe ha sido elaborado por la AAF de forma descriptiva, sin que sea precisamente una recomendación de compra o venta de cuotas de Fondos Mutuos.

Por último, la AAF no asume responsabilidad por el mal uso de la información proporcionada o por su uso contra las indicaciones antes expuestas.