

Inscrito en el RPMV en mérito de la Resolución N° 142-2022-SMV/10.2 de fecha 20 de diciembre de 2022

Información básica para el inversionista

1. Datos Generales del Programa

- i. Nombre: Renta Optimizada Dólares (en adelante, el “Programa”).
- ii. Tipo: Fondo Mutuo de Instrumentos de Deuda de Duración Flexible
- iii. Sociedad Administradora: Credicorp Capital S.A. Sociedad Administradora de Fondos.
- iv. Custodio: Banco de Crédito del Perú.
- v. Plazo de Vigencia: Seis (6) años

2. Inversiones del Fondo

2.1. El Objetivo de Inversión

El Programa es un Programa de Fondos Mutuos de Instrumentos de Deuda de Duración Flexible cuyos fondos tienen como estrategia de inversión buscar optimizar la rentabilidad tomando en cuenta la expectativa de evolución de las tasas de interés en dólares americanos invirtiendo como mínimo el 100% del activo total en instrumentos representativos de deuda. La duración de los portafolios de inversión de los fondos que se encuentren en el marco del presente Programa será no mayor al plazo de vigencia de cada uno de ellos desde el inicio de la etapa operativa.

Para lograr su objetivo, cada fondo invertirá indistintamente en el mercado local o internacional, únicamente en instrumentos con clasificación igual o superior a B- para instrumentos representativos de deuda en largo plazo y en instrumentos con clasificación igual o superior a CP3 en el corto plazo.

Los instrumentos representativos de deuda a ser incluidos en los fondos del Programa deberán estar expresados o coberturados en USD dólares americanos (mínimo 100% del activo total del fondo).

Los fondos de Programa no se encuentran sujetos a ninguna garantía de tercero. El nivel de operaciones de apalancamiento de los fondos del Programa será cero. Los fondos del Programa no realizarán operaciones de venta descubierta. Los fondos del Programa podrán invertir en instrumentos derivados solo con fines de cobertura de acuerdo con lo señalado en la sección 2.2. “Política de Inversiones” del presente Anexo del Reglamento de Participación.

2.2. Política de Inversiones

POLÍTICA DE INVERSIONES	% MIN	% MAX
	Del activo total	Del activo total
SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS Y PLAZOS		
Instrumentos representativos de deudas o pasivos	100%	100%
SEGÚN MONEDA		
Inversiones en moneda del valor cuota	0%	100%
Inversiones en moneda distinta del valor cuota	0%	100%
SEGÚN MERCADO		
Inversiones en el mercado local o nacional	0%	100%
Inversiones en el mercado extranjero o internacional	0%	100%
SEGÚN CLASIFICACIÓN DE RIESGO		
Inversiones con clasificación de riesgo local:		
Categoría AAA hasta BBB- en Largo Plazo	0%	100%
Categoría BB+ hasta B- en Largo Plazo	0%	100%
Categoría CP1 hasta CP3 en Corto Plazo	0%	100%
Categoría inferior a CP3 en Corto Plazo	0%	0%
Inversiones con clasificación de riesgo internacional		
Categoría AAA hasta BBB- para la deuda de Largo Plazo (*)	0%	100%
Categoría BB+ hasta B- para la deuda de Largo Plazo	0%	100%
Categoría CP1 hasta CP3 para la deuda de Corto Plazo	0%	100%
Categoría inferior a CP3 en Corto Plazo	0%	0%
Instrumentos con riesgo Estado Peruano	0%	100%
Instrumentos sin clasificación (**)	0%	0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS (***)		
Forwards de cobertura a la moneda del valor cuota	100%	100%
Forwards de cobertura a monedas distintas del valor cuota	0%	0%
Swaps de cobertura	0%	0%

(*) Menos para emisiones locales con clasificación internacional.

(**) Este rubro incluye los depósitos en entidades financieras del exterior.

(***) Se podrá contratar operaciones de forward sin fines de cobertura con el fin de liquidar anticipadamente una posición.

2.3. Indicador de comparación de rendimientos

El indicador de rendimiento (IR) o benchmark del Fondo será el rendimiento otorgado por la tasa del Depósito a Plazo en Dólares Americanos (tasas de interés pasivas ME) del Banco de Crédito del Perú a treientos sesenta (360) días.

$$IR = TDPUSD$$

Donde:

TDPUSD = Tasa del Depósito a Plazo en dólares americanos del Banco de Crédito del Perú a 360 días al final del periodo. (www.viabcp.com)

El riesgo y rendimiento de los instrumentos que forman parte de la cartera del FONDO, no necesariamente corresponden al riesgo y rendimiento de los instrumentos representados por el indicador de comparación de rendimientos (benchmark).