

## FONDO DE FONDOS SURA CAPITAL ESTRATÉGICO I FMIV

31.08.20

SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTO	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
<b>INSTRUMENTOS REPRESENTATIVOS DE PARTICIPACIÓN EN EL PATRIMONIO</b>	<b>12.72%</b>	0.00%	15.00%
Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles y/o de fondos de fondos y/o de fondos mutuos internacionales y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF	12.72%	0.00%	15.00%
<b>INSTRUMENTOS REPRESENTATIVOS DE DEUDA</b>	<b>85.92%</b>	85.00%	100.00%
Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o de fondos mutuos flexibles y/o de fondos de fondos y/o de fondos mutuos Internacionales	85.92%	75.00%	100.00%
Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)	0.00%	0.00%	0.00%
Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario y hasta 1080 días calendario)	0.00%	0.00%	0.00%
Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario y hasta 360 días calendario)	0.00%	0.00%	25.00%
Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)	0.00%	0.00%	25.00%
	<b>98.63%</b>		
SEGÚN MONEDA (posición neta)	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Inversiones en moneda del valor cuota	40.25%	0.00%	100.00%
Inversiones en otras monedas	58.38%	0.00%	100.00%
	<b>98.63%</b>		
SEGÚN MERCADO	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Inversiones en el mercado local	40.25%	0.00%	100.00%
Inversiones en el mercado extranjero	58.38%	0.00%	100.00%
	<b>98.63%</b>		
SEGÚN CALIFICACIÓN DE RIESGO DE LOS INSTRUMENTOS DE DEUDA	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
<b>MERCADO LOCAL: INSTRUMENTOS DE LARGO PLAZO</b>	0.00%		
Desde AAA hasta A-	0.00%	0.00%	25.00%
Desde BBB+ hasta BBB-	0.00%	0.00%	25.00%
Menor a BBB-			
<b>MERCADO LOCAL: INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO</b>	0.00%		
CP-1	0.00%	0.00%	25.00%
Desde CP-2 hasta CP-3	0.00%	0.00%	25.00%
Menor a CP-3	0.00%	0.00%	0.00%
<b>MERCADO LOCAL: ENTIDADES FINANCIERAS</b>	0.00%		
Desde A+ hasta B+	0.00%	0.00%	25.00%
Desde B hasta B-	0.00%	0.00%	25.00%
Menor a B-	0.00%	0.00%	0.00%
<b>MERCADO INTERNACIONAL: INSTRUMENTOS DE LARGO PLAZO</b>	0.00%		
No menor a BB-	0.00%	0.00%	0.00%
Menor a BB-	0.00%	0.00%	0.00%
<b>MERCADO INTERNACIONAL: INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO</b>	0.00%		
No menor a CP-2	0.00%	0.00%	25.00%
Menor a CP-2	0.00%	0.00%	0.00%
<b>ESTADO PERUANO (GOBIERNO CENTRAL Y BCRP)</b>	0.00%	0.00%	25.00%
<b>INVERSIONES NO SUJETAS A CLASIFICACIÓN</b>	0.00%	0.00%	25.00%
	<b>0.00%</b>		
INSTRUMENTOS DERIVADOS	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Forwards a la moneda del valor cuota	0.00%	0.00%	100.00%
Forwards distintas del valor cuota	0.00%	0.00%	50.00%
Swap	0.00%	0.00%	0.00%
Futuros	0.00%	0.00%	0.00%
Opciones	0.00%	0.00%	0.00%