DocuSign Envelope ID: 7B779A6B-D12A-437B-85BA-678EB7B0967B

INFORME ANUAL DEL EJERCICIO ECONÓMICO 2021

ELABORADO POR EL COMITÉ DE VIGILANCIA

DEL

FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA

LIMA, 7 de abril de 2022

DocuSign Envelope ID: 7B779A6B-D12A-437B-85BA-678EB7B0967B

INFORME ANUAL DE LA GESTIÓN DEL COMITÉ DE VIGILANCIA DEL FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA

DESCRIPCIÓN DE LAS FUNCIONES DEL COMITÉ

El presente informe tiene por finalidad detallar la gestión que ha llevado a cabo el Comité de Vigilancia (el "Comité") durante el ejercicio económico 2021. A tales efectos, debemos partir por determinar cuál es la función del Comité respecto del FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA (el "Fondo").

Al respecto, el artículo 25 del Reglamento de Participación del Fondo (el "Reglamento") se describe las principales funciones del Comité, las cuales se transcriben a continuación:

"El Comité de Vigilancia tendrá las siguientes atribuciones:

a) Vigilar que la Sociedad Administradora cumplan, respecto del Fondo, con lo dispuesto en la Ley de Fondos de Inversión, el presente Reglamento y los términos de colocación;
b) Convocar a Asamblea General para dar cuenta de su gestión, cuando lo considere necesario;
c) Convocar a Asamblea General para someter a aprobación la transferencia del Fondo o su liquidación, o cuando lo considere que ello es necesario para proteger los intereses del Fondo cuando se lo soliciten titulares del veinticinco por ciento (25%) del total de las Cuotas suscritas con derecho a voto, exceptuando a las Personas Relacionadas con la Sociedad Administradora que sean titulares de Cuotas.
d) Participar con voz, pero sin voto en la Asamblea General o Asamblea Especial;
e) Revisar que el órgano o persona responsable de verificar el cumplimiento de las normas internas de conducta, cumpla con sus funciones;
f) Contratar los servicios necesarios para el cumplimiento de sus funciones, siempre que medie autorización de la Asamblea;
g) Resolver los conflictos de interés que se presenten respecto de las Inversiones del Fondo y demás asuntos que sean sometidos a su consideración;
h) Revisar los gastos y comisiones cobrados al Fondo;
i) Someter los estados financieros auditados anuales del Fondo para la aprobación de la Asamblea General;
j) Acceder a la siguiente información de carácter trimestral: (i) evolución del valor cuota; y, (ii) Estados Financieros del Fondo con explicación de las principales cuentas del Fondo;
k) Proponer a la Sociedad de Auditoría del Fondo para su elección en Asamblea General;
l) Convocar a Asamblea General en los casos señalados en el presente Reglamento;
m) Aprobar la contratación de Personas Relacionadas a la Sociedad Administradora para la presentación de servicios al Fondo que sean pagados con cargo a los recursos del Fondo;

DocuSign Envelope ID: 7B779A6B-D12A-437B-85BA-678EB7B0967B

n) Verificar que el Fondo únicamente se haga cargo de los gastos establecidos en el Reglamento, y;
o) Las demás que se establezcan en el presente Reglamento o le sean delegadas por la Asamblea General.

GESTIÓN DEL COMITÉ DURANTE EL EJERCICIO ECONÓMICO 2021

Habiéndose detallado las actividades que el Comité desarrolla dentro del Fondo y entendiendo su ámbito de actuación, corresponde ahora analizar la actuación del Comité a lo largo del ejercicio económico 2021.

1. Actividades realizadas:

1.1 El día 22 de noviembre de 2021 se realizó de forma virtual el primer Comité de Vigilancia del Fondo, el cual fue activado luego de haber finalizado el proceso de conversión del Fondo de oferta privada a oferta pública. Dentro de esta sesión se realizaron las siguientes actividades:

Elección del presidente del Comité de Vigilancia:

- De acuerdo con el Reglamento del Fondo los miembros del Comité designaron como presidente al señor Ricardo Temoche Arce y como vicepresidente la señora Zoila Patricia Mascaró Diaz.

Presentación Plataforma de Crédito:

- Los miembros del Comité tuvieron una reunión explicativa con el equipo de Crédito y Deuda Privada de SURA, durante este espacio se presentó la experiencia y el posicionamiento de Fondos SURA SAF dentro de la región y la importancia de la plataforma de Inversión con presencia en Chile, México, Colombia, Perú Uruguay y Argentina de la cual hace parte.
- Se revisaron aspectos específicos de la estrategia de inversión que maneja Fondos SURA SAF con los instrumentos de deuda corporativa y en concreto los relacionados al Fondo de Inversión Factor SURA.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones

- Este fondo inicio operaciones a través de oferta privada en enero de 2020, sin embargo, a partir de junio de 2021 se oficializó operativamente la conversión del Fondo Privado a Fondo Público. Con este proceso se activa las actividades de supervisión Comité de Vigilancia
- Se revisó el avance en términos de evolución de valor cuota, rentabilidad e incremento de activos administrados que ha tenido el Fondo desde enero del 2020. Se destaca que a corte de octubre de 2021 el Fondo presenta un AUM de PEN 53 millones y una rentabilidad acumulada del valor cuota de 4.91%.

DocuSign Envelope ID: 7B779A6B-D12A-437B-85BA-678EB7B0967B

- Se revisaron los llamados de capital que se han realizado desde el inicio de operaciones, destacando la apertura de una nueva clase de cuotas “Clase B” que se concretó en el mes de mayo de 2021 para inversionista institucionales.
- Se revisaron las distribuciones trimestrales de intereses acumulados que se han realizado. A la fecha la última distribución tuvo lugar el 19 de octubre 2021, por un monto de PEN 498,908
- De igual forma se revisaron las ventanas de liquidez semestrales. En el mes de setiembre el Fondo tuvo su segunda ventana donde brindó liquidez a sus inversionistas por un monto de PEN 4.54 MM

Estado del portafolio:

- A corte de octubre de 2021 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.
- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por un monto de PEN 48.3 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BBB- internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas emisoras. Se destaca que el Fondo maneja una estrategia de Confirming donde la relación la tiene directamente con el pagador.

Otros temas:

- De acuerdo con las facultades otorgadas por la Asamblea de Participes del 31 de julio, se aprobó designar como auditores externos del Fondo para el periodo 2021 a la firma “Paredes, Burga & Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada”, representantes de Ernst and Young

1.2 Mediante sesión virtual de Comité de Vigilancia de fecha 30 de marzo de 2022 se revisaron los resultados del cuarto trimestre del año 2021, respecto a:

Información general:

- Se revisó el número de partícipes, cuotas suscritas, valor cuota, patrimonio neto y conformación de comités vigentes a 31 de diciembre de 2021.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones:

- Se revisaron los estados financieros no auditados del Fondo al cierre del cuarto trimestre de 2021. Las principales cifras en miles de pesos peruanos son: Activo PEN 66,076.97 Pasivo PEN 248.94 Patrimonio PEN 65,828.03 Utilidad neta PEN 2,086.24
- Se revisó la evolución del valor cuota del Fondo desde el inicio de operaciones, junto con el incremento de los activos administrados. Durante

DocuSign Envelope ID: 7B779A6B-D12A-437B-85BA-678EB7B0967B

el cuarto trimestre se realizaron llamados a capital adicional por PEN 16.7MM.

- Se revisó el cronograma de distribución de resultados y las ventanas de liquidez del Fondo. Durante el cuarto trimestre se distribuyó intereses acumulados por un monto de PEN 683,905.

Estado del portafolio:

- A corte de diciembre de 2021 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.
- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por PEN 64.4 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BBB- internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas emisoras.

COMENTARIOS FINALES A LA GESTIÓN DEL EJERCICIO ECONÓMICO 2021

Debemos recalcar que el Comité de Vigilancia tuvo una actuación activa en el 2021, mediante las sesiones del Comité, actuando en todo momento con diligencia y buena fe.

DocuSigned by:
CEB33E54FCB5444...
Ricardo Temoche Arce
Presidente

DocuSigned by:
0392A2EC183D424...
Zoila Patricia Mascaró Diaz
Vicepresidente

DocuSigned by:
3BF8A3E056B44F2...
George Ode Segebre
Miembro Titular