

FONDO DE FONDOS SURA CAPITAL ESTRATÉGICO II FMIV

30.04.21

SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTO	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
INSTRUMENTOS REPRESENTATIVOS DE PARTICIPACIÓN EN EL PATRIMONIO	44.89%	15.00%	50.00%
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	44.89%	15.00%	50.00%
INSTRUMENTOS REPRESENTATIVOS DE DEUDA	51.32%	50.00%	85.00%
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	51.32%	25.00%	85.00%
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%
	96.22%		
SEGÚN MONEDA (posición neta)	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Inversiones en moneda del valor cuota	52.18%	0.00%	100.00%
Inversiones en otras monedas	44.04%	0.00%	100.00%
	96.22%		
SEGÚN MERCADO	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Inversiones en el mercado local	28.88%	0.00%	100.00%
Inversiones en el mercado extranjero	67.34%	0.00%	100.00%
	96.22%		
SEGÚN CALIFICACIÓN DE RIESGO DE LOS INSTRUMENTOS DE DEUDA	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
MERCADO LOCAL: INSTRUMENTOS DE LARGO PLAZO	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-			
MERCADO LOCAL: INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO	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%
MERCADO LOCAL: ENTIDADES FINANCIERAS	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%
MERCADO INTERNACIONAL: INSTRUMENTOS DE LARGO PLAZO	0.00%		
No menor a BB-	0.00%	0.00%	0.00%
Menor a BB-	0.00%	0.00%	0.00%
MERCADO INTERNACIONAL: INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO	0.00%		
No menor a CP-2	0.00%	0.00%	25.00%
Menor a CP-2	0.00%	0.00%	0.00%
ESTADO PERUANO (GOBIERNO CENTRAL Y BCRP)	0.00%	0.00%	25.00%
INVERSIONES NO SUJETAS A CLASIFICACIÓN	0.00%	0.00%	25.00%
	0.00%		
INSTRUMENTOS DERIVADOS	Posición % Activo	Limite Mín. Regulatorio	Limite Máx. Regulatorio
Forwards a la moneda del valor cuota	23.30%	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%