

## **DECLARACIÓN DE RESPONSABILIDAD**

“El presente documento contiene información veraz y suficiente respecto al desarrollo del negocio de Fondos SURA SAF S.A.C. y a la administración de los Fondos Mutuos que representa, durante el año 2022.

El firmante se hace responsable por los daños que pueda generar la falta de veracidad o insuficiencia del contenido de la presente Memoria, dentro del ámbito de su competencia, de acuerdo con los dispositivos legales aplicables.”<sup>1</sup>

Antonio Cevallos Barriga  
Gerente General

Lima, 28 de marzo de 2023

---

<sup>1</sup> De conformidad con lo dispuesto en el Anexo L del Reglamento de Fondos Mutuos de Inversión en valores y sus sociedades administradoras, aprobado mediante Resolución CONASEV N° 0068-2010, y la Ley General de Sociedades, Ley 26887.”

---

Señores accionistas,

*El año 2022 fue un período en que los activos globales se vieron impactados por el avance de la inflación y el inicio del conflicto bélico entre Rusia y Ucrania. De hecho, la mayor persistencia en los indicadores de precios llevó a los principales bancos centrales a reducir fuertemente el estímulo a sus economías, mientras que las tensiones en Europa del este presionaron al alza los precios de las materias primas, haciendo temer por la escasez de dichos productos. En este escenario, tanto los activos de renta variable como de renta fija se vieron afectados de manera importante, en respuesta al escenario de riesgos de recesión y alta inflación que afectó a los mercados.*

*Dado el panorama explicado, en materia de escenario económico se estima que el crecimiento global iría de menos a más en el 2023. Por un lado, los riesgos de una posible recesión global se mantienen presentes para la primera parte del año, mientras que las perspectivas hacia fines del período estarán condicionadas por la persistencia que termine mostrando la inflación, la evolución de los conflictos geopolíticos y la respuesta que puedan generar los bancos centrales frente a dicho escenario. De todos modos, es posible que la inflación continúe con su tendencia de desaceleración hacia fines del 2023, en la medida que los precios de materias primas se han estabilizado, las presiones de oferta comienzan a ceder y la desaceleración de la economía global pueda encauzar las presiones sobre el mercado laboral.*

*En este contexto, de corto plazo las perspectivas siguen favoreciendo a los activos de refugio financiero en la medida que las altas tasas en los mercados de deuda contrastan con las preocupaciones sobre el crecimiento de utilidades tras el escenario descrito. Sin embargo, de registrar una recesión acotada y de corta duración que pueda contener las presiones sobre la inflación, el escenario en materia de activos de riesgo puede variar hacia los próximos trimestres en caso de que las perspectivas comiencen a mejorar en períodos venideros.*

*Dentro de las principales regiones desarrolladas, las bolsas de Estados Unidos registraron una pérdida de doble dígito después de haber obtenido ganancias por tres años consecutivos. La fortaleza del mercado laboral, traducido en una tasa de desempleo que se encuentra en niveles mínimos, el encarecimiento del sector servicios y el conflicto bélico no resuelto en Europa Emergente fueron algunos de los factores que terminaron por impactar negativamente al principal índice estadounidense, S&P 500, que finalizó el 2022 como retroceso de -19.4%.*

*En lo que respecta a Europa Desarrollada, el índice Stoxx Europe 600 registró una pérdida ligeramente menor, de -18.06% en dólares, debido al impacto negativo que generó la escasez de energía en la región, lo que generó una erosión del poder adquisitivo de los salarios en términos reales y presionó que el Banco Central Europeo y el Banco de Inglaterra inicien un ciclo alcista en las tasas de interés con el objetivo de contener el avance de la inflación, indicador que registró máximos no vistos en 40 años.*

*En cuanto a los mercados emergentes, a inicios del 2022, el consenso apuntaba a un mejor desempeño de estas economías ante el buen impulso que registraron los precios de los commodities. No obstante, el avance aún sostenido de los casos de contagio de*

---

*Covid-19 generó que algunos países de Asia Emergente —en especial China— implementen políticas punitivas para controlar el avance de la enfermedad, lo cual generó incertidumbre acerca del crecimiento económico mundial. Si bien el 2023 comienza con valorizaciones atractivas para los mercados emergentes en general, la región no quedará ajeno a la contracción en las utilidades de las compañías que se espera a nivel global. Las expectativas de crecimiento de utilidades se podrían seguir corrigiendo a la baja, en la medida que las condiciones macro financieras se sigan deteriorando.*

*En el ámbito local, el 2022 estuvo caracterizado por una exacerbación desmesurada del ruido político y una breve ruptura del orden constitucional que terminó con la destitución del presidente de la República. Esto generó volatilidad en el desempeño de los activos locales y el tipo de cambio, así como un cambio de perspectiva, de neutral a negativa, en la calificación crediticia por parte de Fitch Ratings; no obstante, los fundamentos de las cuentas macroeconómicas se mantienen sólidas, con una perspectiva de crecimiento de 2.8% nominal del producto bruto interno.*

*La Bolsa de Valores de Lima (BVL) logró borrar las pérdidas incurridas durante el año y obtuvo un rendimiento positivo en el Índice General de +1.04% en soles y +5.95% en dólares, donde los retornos fueron mixtos a nivel sectorial. Por un lado, aquellos que obtuvieron un rendimiento positivo fueron: Servicios Públicos (+41.14%), Consumo (+7.45%) y Financiero (+5.41%); mientras que los sectores Industrial (-5.06%) y Minería (-4.43%) mostraron retornos negativos.*

*Finalmente, para el 2023, se espera que la actividad global presente un desempeño más contenido, en la medida que los estímulos monetarios y fiscales se moderan y las bases de comparación se normalicen. Ante ello, no se descarta un escenario de eventual recesión en Estados Unidos y Europa, economías que podrían registrar crecimientos muy por debajo de su nivel potencial, pero con mejores perspectivas de recuperación hacia el término del presente año.*

*Antonio Cevallos Barriga*  
*Gerente General*

*Lima, 28 de marzo del 2023*

---

## CONTENIDO

|                                                          |     |
|----------------------------------------------------------|-----|
| DECLARACIÓN DE RESPONSABILIDAD .....                     | 1   |
| INFORMACIÓN GENERAL .....                                | 5   |
| DIRECTORIO.....                                          | 7   |
| PLANA GERENCIAL .....                                    | 8   |
| LA EMPRESA DURANTE EL 2022 .....                         | 10  |
| INDICADORES FINANCIEROS.....                             | 13  |
| PROCEDIMIENTO DE SELECCIÓN DE LA SOCIEDAD AUDITORA ..... | 14  |
| RIESGOS NO FINANCIEROS .....                             | 14  |
| BUEN GOBIERNO CORPORATIVO Y CUMPLIMIENTO.....            | 15  |
| MARKETING .....                                          | 16  |
| SOSTENIBILIDAD .....                                     | 18  |
| CONTINGENCIAS SIGNIFICATIVAS .....                       | 19  |
| FONDOS MUTUOS .....                                      | 20  |
| FONDOS DE INVERSIÓN .....                                | 117 |

## **INFORMACIÓN GENERAL**

Fondos SURA SAF S.A.C. es una sociedad anónima cerrada, que se constituyó mediante Escritura Pública de fecha 7 de diciembre de 2004 otorgada ante el Notario de Lima Dr. Eduardo Laos de Lama, inscrita en la Partida N° 11717377 del Registro de Personas Jurídicas de la Oficina Registral de Lima y Callao el 19 de enero de 2005.

Tiene como objeto social administrar fondos de inversión y fondos mutuos de inversión en valores, así como la prestación de los servicios de asesoría financiera, estructuración y administración de cartera, pudiendo desempeñar todas las demás actividades conexas o relacionadas con la administración de fondos, asesoría financiera, estructuración y administración de cartera, así como realizar todos los actos y celebrar todos los contratos permitidos a las sociedades anónimas cerradas.

Mediante Resolución CONASEV N° 007-2005-EF/94.10, la Superintendencia de Mercado de Valores – SMV (antes CONASEV), autoriza su funcionamiento para administrar de fondos mutuos de inversión en valores. Posteriormente mediante Resolución N° 018-2008-EF/94.01.1, se amplía la autorización para actuar como sociedad administradora de fondos de inversión en valores.

A finales del 2011, Fondos SURA SAF experimentó una operación financiera de gran envergadura, la cual determinó una nueva conformación de sus accionistas principales. En efecto, en operaciones simultáneas ING Group transfirió el 80% de las acciones de su propiedad en ING Wealth Management S.A., que fuera el accionista mayoritario de ING Fondos SAF S.A.C., a favor de Grupo de Inversiones Suramericana Holanda B.V., con lo cual Grupo de Inversiones Suramericana se convirtió en el accionista mayoritario de Fondos SURA SAF S.A.C. (antes ING Fondos SAF S.A.C.). Ante esta nueva conformación, en enero de 2012 se procedió a realizar formalmente el cambio de nuestra denominación social pasando a llamarse desde ese momento “Fondos SURA SAF S.A.C.”.

Asimismo, el 01 de marzo de 2015, entró en vigencia el proceso de fusión y absorción entre Sura Asset Management Perú S.A. y de Wealth Management Perú S.A.; así con fecha 30 de marzo de 2015, Pensiones Sura Perú transfiere la propiedad de la totalidad de sus acciones a Activos Estratégicos Sura AM Colombia S.A. S.; por lo tanto, Sura Asset Management Perú S.A. y Activos Estratégicos Sura AM Colombia S.A. S. se convirtieron en nuevos accionistas de Fondos Sura SAF S.A.C. Posteriormente, con fecha 19 de enero del 2021, la Junta decidió modificar el Estatuto Social e incluir al Directorio como órgano societario, cumpliendo así con lo dispuesto por las Normas sobre la organización de entidades que requieren autorización de la SMV, Resolución SMV N° 039-2016-SMV-01.

### **COMPOSICIÓN ACCIONARIA**

El capital social suscrito y pagado de Fondos SURA SAF al 31 de diciembre de 2022 es de S/ 51'873,949 (cincuenta y un millones ochocientos setenta y tres mil novecientos cuarenta y nueve y 00/100 Soles), representado por 51'873,949 acciones ordinarias de un valor nominal de S/ 1.00 (un sol) cada una. Los accionistas de la sociedad son:

| <b>Accionista</b>                              | <b>N° de acciones</b> | <b>Porcentaje (%)</b> | <b>Nacionalidad</b> |
|------------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|
| Sura Asset Management Perú S.A.                | 51'872,389            | 99,9                  | Perú                |
| Activos Estratégicos Sura A.M. Colombia S.A.S. | 1,560                 | 00,1                  | Colombia            |
| <b>Total</b>                                   | <b>51'873,949</b>     | <b>100%</b>           |                     |

---

## **ACCIONES CON DERECHO A VOTO**

De conformidad con lo establecido en el artículo 5 de los Estatutos de la Sociedad, todas las acciones tienen derecho a voto y confieren a sus titulares los mismos derechos y obligaciones.

| <b>Tenencia</b> | <b>Número de Accionistas</b> | <b>Porcentaje de participación %</b> |
|-----------------|------------------------------|--------------------------------------|
| Menor al 1%     | 1                            | 0.01                                 |
| Entre 1% - 5%   | 0                            | 0                                    |
| Entre 5% - 10%  | 0                            | 0                                    |
| Mayor al 10%    | 1                            | 99.99                                |
| <b>Total</b>    | <b>2</b>                     | <b>100</b>                           |

## **ACCIONES DE INVERSIÓN**

Fondos SURA SAF no registra acciones de inversión.

## **GRUPO ECONÓMICO**

Fondos SURA SAF forma parte del grupo económico “Grupo Empresarial SURA”, grupo multilatinista listado en la Bolsa de Valores de Colombia, el cual se encuentra compuesto de la siguiente manera:

| <b>Integrante</b>                   | <b>Objeto Social</b>                                                                | <b>Dirección</b>                              | <b>Teléfono</b> |
|-------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------|
| AFP Integra                         | Planes de pensiones                                                                 | Av. Canaval y Moreyra 522 – San Isidro – Perú | 4119191         |
| Sociedad Agente de Bolsa SURA S.A.  | Actividades Bursátiles                                                              | Av. Canaval y Moreyra 532 – San Isidro – Perú | 4400000         |
| Sociedad Titulizadora SURA S.A.     | Actividad fiduciaria                                                                | Av. Canaval y Moreyra 532 – San Isidro – Perú | 4400000         |
| SURA Asset Management Perú          | Invertir en acciones, participaciones y valores mobiliarios de empresas en general. | Av. Canaval y Moreyra 522 – San Isidro – Perú | 6123202         |
| Grupo Inversiones Suramericana S.A. | Holding                                                                             | Colombia                                      | Página Web      |
| SURA Asset Management S.A.          | Intermediación Financiera                                                           | Colombia                                      | 3177800         |

## **OFICINA PRINCIPAL**

Al 31 de diciembre del 2022, la empresa cuenta con una Oficina Principal ubicada en Av. Canaval y Moreyra N° 532, San Isidro Lima, teléfono 4400000.

---

## **DIRECTORIO**

**Eduardo Elías Dupuy** - Presidente del Directorio  
Director Independiente

Bachiller en Ingeniería Industrial por la Pontificia Universidad Católica del Perú. Experiencia como docente en cursos de finanzas e inversiones, en el programa de bachillerato y maestría de la UPC y en seminarios en Mercado de capitales de la Universidad del Pacífico. Tiene 30 años de experiencia como administrador de fondos, dirección en empresas de retail, marcas y comercio internacional, en la industria textil. Inició su carrera manejando fondos en los mercados de capitales para AFP Integra por USD 800mm y posteriormente gerenciando empresas en el sector retail textil por 11 años. En los últimos 11 años ha fundado y participado en directorios de empresas en el rubro de exportación textil, marcas en Estados Unidos y gestión de activos en el mercado de capitales. En este período también fue miembro de los directorios de AFP Horizonte, Seguros SURA y SURA Asset Management Perú, así como de Corporación Jeruth.

**Rodrigo Velásquez Uribe** - Director Independiente

Licenciado en la carrera de Ingeniería Mecánica de la Universidad Pontificia Boliviana. Director de AFP Integra desde enero de 2012, hasta la fecha, Director de Protección S.A. y otras Juntas Directivas. Anteriormente se desempeñó como Presidente de la Gerencia General de Banca de Inversión Bancolombia, Presidente de Fabricato, Vicepresidente de Corfinsura y docente en varias universidades. Actualmente es miembro del Directorio de AFP Integra y Protección S.A.

**Federico Suarez Mesa** - Director

Ingeniero Administrador y especialización en Finanzas Corporativas en la Escuela de Ingeniería de Antioquia, Máster en Administración de Negocios del ISEAD Business School y recientemente finalizó un programa de Alta Gerencia en IE Business School. Tiene 23 años de experiencia en distintas empresas del sector financiero desempeñándose en áreas como estudios económicos, inversiones y comerciales. Previo a entrar a Sura Asset Management, trabajó en Valores Bancolombia durante más de 14 años hasta mayo del año 2017 momento desde el cual se ha venido desempeñado en Sura como Head Regional del Negocio de Inversiones SURA.

**Carolina Rossi**<sup>2</sup> - Director

Actuaria recibida en la Universidad de Buenos Aires, Argentina, con más de 25 años de experiencia en temas actuariales para compañías de seguros y en gestión de riesgos para diferentes negocios del sector financiero. Certificado por el Comité de Conocimientos en el Mercado de Valores de Chile como Directivo.

**Esteban López Vargas**<sup>3</sup> - Director

---

<sup>2</sup> Desde el 26 de enero de 2022

<sup>3</sup> Hasta el 26 de enero de 2022

## PLANA GERENCIAL

### **Gerente General: Antonio Cevallos Barriga**

Posee una amplia experiencia en Estrategias de Inversión en Renta Variable nacional e internacional y Wealth Management. Previo a unirse a SURA, fue Gerente de Desarrollo de Negocios Perú de BlackRock (2017-2021). Además, diseñó el asset allocation para los portafolios de renta variable local e internacional como Estratega de Inversiones en AFP Integra (2013-2016), elaboró estrategias de inversión en renta variable local e internacional en BBVA AFP Horizonte (2012-2013) y trabajó como Portfolio Manager en Pacífico Seguros (1996-2000). Es economista, graduado de la Universidad del Pacífico y posee un Máster en Finanzas de London Business School.

### **Vicepresidente de Adquisiciones - Real Estate: Ivan Carmelo Zarate Aima**

Posee más de 15 años de experiencia administrando fondos de inversión, portafolios inmobiliarios y de productos. Previo a ingresar a Fondos SURA en el año 2017, estuvo a cargo de la gestión del portafolio inmobiliario de Seguros SURA (2013-2017), Analista senior de inversiones inmobiliarias en InVita Seguros (2011-2013). Previo a ello se desempeñó en Movistar Perú (2008-2011). Ingeniero Industrial de la Universidad Nacional de Ingeniería (UNI), con MBA de IE España (2023); maestría en Marketing de Centrum/ EADA – España y Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico. Cuenta con un Diplomado Profesional Certificate en Real Estate Finance and Development del Massachusetts Institute of Technology (MIT), CAIA charterholder y nivel 1 del CFA aprobado.

### **Funcionario de Cumplimiento Normativo y Control Interno: Roberto Andrade Russi**

Licenciado en Economía por la Universidad de Lima. Anteriormente se desempeñó como Gerente de Proyectos en Arkin Software S.A. (2014-2015), Funcionario de Control Interno de Compass Group S.A.B. S.A. (2008-2013), Consultor Funcional en Goldstone Info Systems (2004 – 2008), Sub Gerente de Liquidaciones en la Entidad de Deposito de Valores de Bolivia S.A. (2002-2004), Sub Gerente de Compensación y Liquidación de CAVALI S.A. ICLV (1997-2002), y Jefe de Operaciones Especiales en la Bolsa de Valores de Lima (1992-1997).

### **Vicepresidente de Renta Fija: José Antonio Block Granda<sup>4</sup>**

### **Director de Crédito: Armando Vidal Gastañaga<sup>5</sup>**

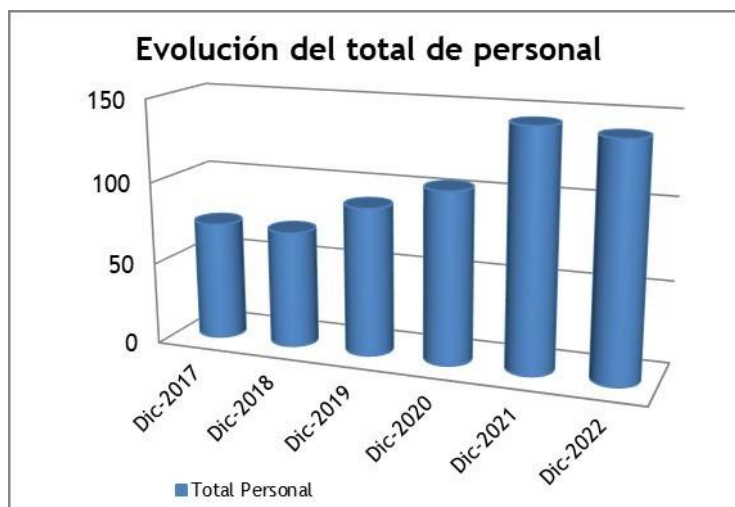
## ORGANIZACIÓN

| <b>Evolución del Personal</b>     | <b>Dic.17</b> | <b>Dic.18</b> | <b>Dic.19</b> | <b>Dic.20</b> | <b>Dic.21</b> | <b>Dic.22<br/>[*]</b> |
|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------------|
| Gerencia General                  | 1             | 1             | 1             | 1             | 1             | 1                     |
| Gerencias                         | 1             | 1             | 2             | 2             | 3             | 1                     |
| Subgerencias                      | 2             | 2             | 1             | 1             | 1             | 1                     |
| Plana Administrativa              | 33            | 36            | 40            | 47            | 69            | 69                    |
| Administrativos / Otros de Ventas | 16            | 14            | 15            | 17            | 22            | 24                    |
| Fuerza de Ventas                  | 19            | 17            | 31            | 36            | 48            | 44                    |
| <b>Total Personal</b>             | <b>72</b>     | <b>71</b>     | <b>90</b>     | <b>104</b>    | <b>144</b>    | <b>140</b>            |
|                                   |               |               |               |               |               |                       |
| Fuerza de Ventas part time        | 41            | 89            | 78            | 78            | 78            | 55                    |
| <b>Total Fuerza de Ventas</b>     | <b>60</b>     | <b>106</b>    | <b>109</b>    | <b>114</b>    | <b>126</b>    | <b>99</b>             |

<sup>4</sup> Hasta el 02 de marzo 2022

<sup>5</sup> Hasta el 15 de julio de 2022

[\*] Comprende la cantidad de trabajadores al 31 de diciembre de 2022.



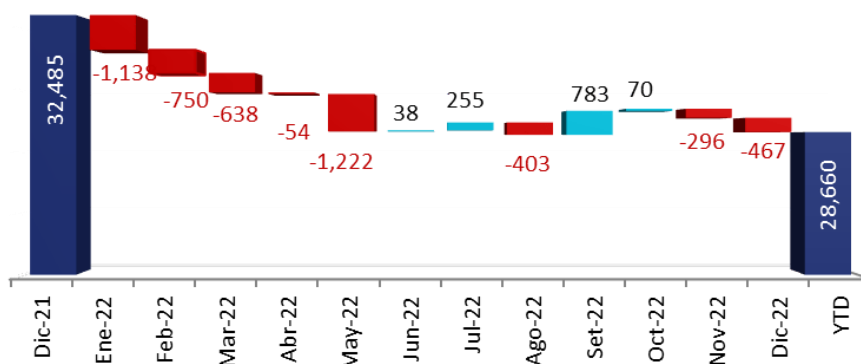
## LA EMPRESA DURANTE EL 2022

Durante el 2022, 58 fondos mutuos iniciaron colocación en el mercado peruano bajo las tipologías Corto Plazo (3), Flexibles (18), Deuda de Duración Flexible (5), Fondos de Fondos (17) y Estructurados (15); la mayor parte de ellos en dólares americanos y con inversiones subyacentes en activos internacionales.

Respecto a los activos bajo administración (AUM), la industria de fondos mutuos presentó en el 2022 en conjunto una reducción de - S/ 3,825 millones (-11.8%) respecto a diciembre del 2021; en línea con el comportamiento de la industria, Fondos SURA SAF S.A.C. también redujo su AUM en - S/ 245 millones (-6.2%) en el mismo periodo:

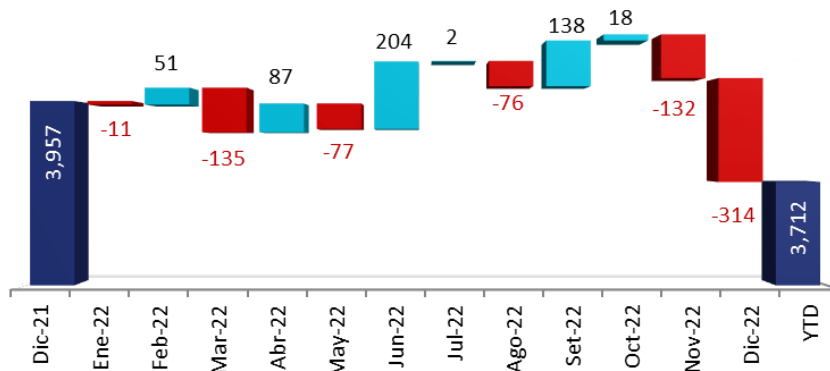
**Evolución AUM Industria FFMM YTD**

MM de Soles



**Evolución AUM Fondos Sura FFMM YTD**

MM de Soles



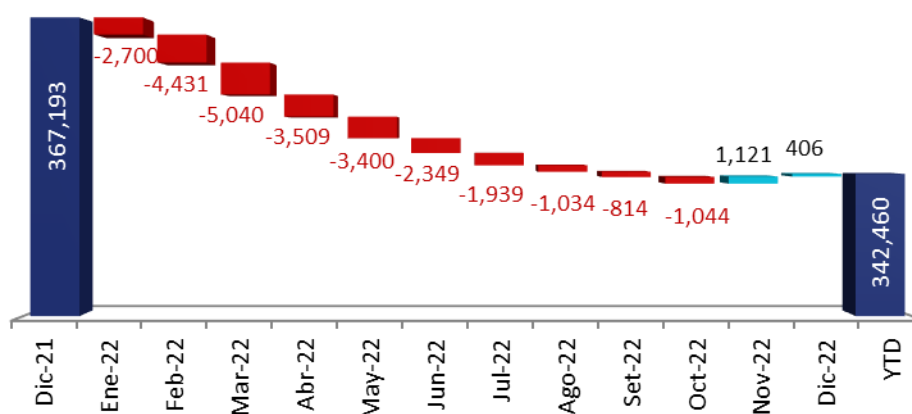
El mayor incremento en AUM respecto al 2021 se dio por los fondos de tipología Estructurados, los cuales terminaron el año con un crecimiento de S/ 807 millones.

Sin embargo, las tipologías más impactadas durante el mismo periodo fueron los fondos Flexibles (-S/ 1,984 millones), Corto Plazo (-S/ 1,261 millones), Mediano Plazo (-S/ 785 millones) y Fondo de Fondos (-S/ 407 millones). En menor medida, los fondos Deuda Flexible, Renta Variable y Mixtos, los cuales también redujeron el AUM con -S/ 251 millones, -S/ 70 millones y -S/ 23 millones respectivamente:

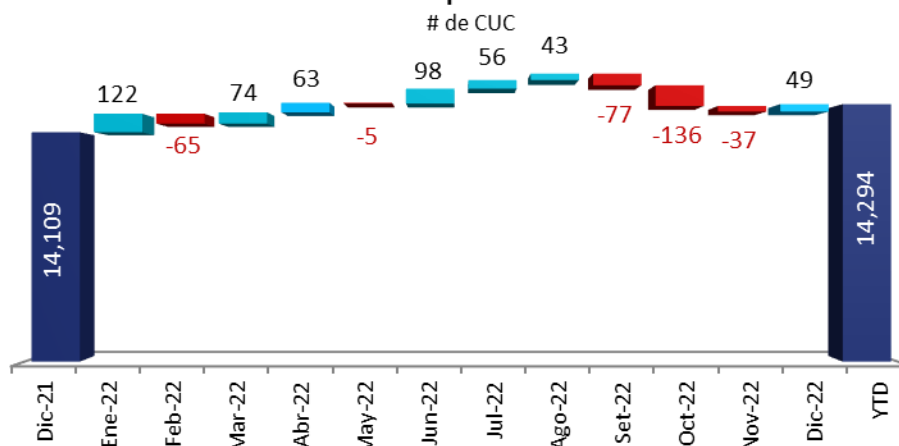
|                  | AUM           | MS    | MTD         | % Var.       | YTD           | % Var.        |
|------------------|---------------|-------|-------------|--------------|---------------|---------------|
| Corto Plazo      | 11,553        | 40.3% | -14         | -0.1%        | -1,261        | -9.8%         |
| Mediano Plazo    | 1,400         | 4.9%  | -43         | -3.0%        | -785          | -35.9%        |
| Flexibles        | 5,608         | 19.6% | -397        | -6.6%        | -1,984        | -26.1%        |
| Deuda Flexible   | 2,898         | 10.1% | -116        | -3.9%        | -251          | -8.0%         |
| Mixtos           | 128           | 0.4%  | -4          | -3.4%        | -23           | -15.4%        |
| Renta Variable   | 200           | 0.7%  | -11         | -5.2%        | -70           | -26.0%        |
| Fondo de Fondos  | 5,841         | 20.4% | -82         | -1.4%        | -407          | -6.5%         |
| Estructurados    | 850           | 3.0%  | 131         | 18.2%        | 807           | 1904.9%       |
| ETF              | 183           | 0.6%  | 70          | 61.8%        | 149           | 436.9%        |
| <b>INDUSTRIA</b> | <b>28,660</b> |       | <b>-467</b> | <b>-1.6%</b> | <b>-3,825</b> | <b>-11.8%</b> |

Respecto al número de partícipes, la industria mostró una fuga constante desde el mes de enero producto del panorama político y la incertidumbre que generaba. Este comportamiento continuó hasta octubre mostrando una ligera recuperación durante los dos últimos meses del año de tal forma que se cerró el 2022 con 342,460 partícipes, -6.7% respecto a diciembre 2021. Fondos SURA SAF se vio impactado durante los meses de febrero (-65), mayo (-5), setiembre (-77), octubre (-136) y noviembre (-37); a pesar de ello, registró un crecimiento respecto al año anterior cerrando diciembre con 14,294 (+1.3%).

**Evolución Partícipes Industria FFMM YTD**  
# de CUC



### Evolución Partícipes Fondos Sura YTD



La preferencia de los partícipes estuvo orientada hacia los fondos de Deuda Flexible, Estructurados y Fondo de Fondos, los mismos que crecieron 4,278 (+10.3%), 4,159 (+1,657%) y 3,305 (+10%) partícipes respectivamente.

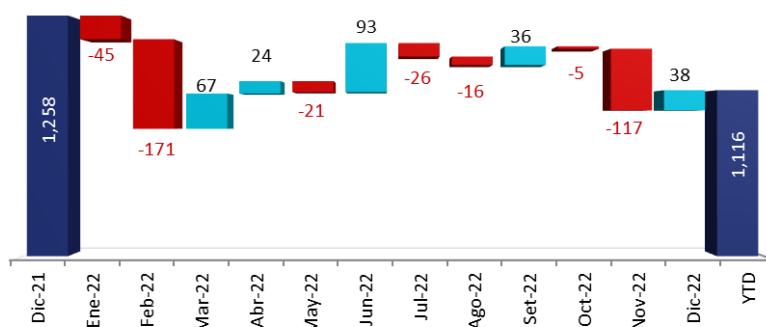
|                  | PART.          | MS    | MTD        | % Var.      | YTD            | % Var.       |
|------------------|----------------|-------|------------|-------------|----------------|--------------|
| Corto Plazo      | 161,756        | 47.2% | 1,241      | 0.8%        | -15,641        | -8.8%        |
| Mediano Plazo    | 26,900         | 7.9%  | -305       | -1.1%       | -6,051         | -18.4%       |
| Flexible         | 59,329         | 17.3% | -1,575     | -2.6%       | -14,249        | -19.4%       |
| Deuda Flexible   | 45,822         | 13.4% | 74         | 0.2%        | 4,278          | 10.3%        |
| Mixtos           | 3,179          | 0.9%  | -14        | -0.4%       | -349           | -9.9%        |
| Renta Variable   | 4,627          | 1.4%  | 23         | 0.5%        | -185           | -3.8%        |
| Fondo de Fondos  | 36,436         | 10.6% | 420        | 1.2%        | 3,305          | 10.0%        |
| Estructurados    | 4,410          | 1.3%  | 542        | 14.0%       | 4,159          | 1657.0%      |
| ETF              | 1              | 0.0%  | 0          | 0.0%        | 0              | 0.0%         |
| <b>INDUSTRIA</b> | <b>342,460</b> |       | <b>406</b> | <b>0.1%</b> | <b>-24,733</b> | <b>-6.7%</b> |

En resumen, el año 2022 no fue un año muy auspicioso para la industria de fondos mutuos dada la coyuntura política; ello se vio reflejado en el decrecimiento en AUM (-11.8%) y el número de partícipes (-6.7%).

Nuestro enfoque en brindar un servicio de asesoría alineada a las expectativas de nuestros clientes hizo que tuviéramos un crecimiento en partícipes (+1.3%) así como una recuperación de estos para los últimos meses del año. Así, al final del año registramos una participación de mercado de 13% en AUM y de 4.2% en número de partícipes.

Respecto a los fondos de inversión, Fondos SURA SAF S.A.C. presentó una reducción de - S/ 142 millones (-11.3%) en AUM durante el 2022. Ello corresponde a la administración de 4 fondos de inversión públicos y 9 fondos de inversión privados al cierre de diciembre 2022.

Evolución AUM Fondos Sura FI YTD  
MM de Soles



## INDICADORES FINANCIEROS

Cifras en Soles

| Al 31 de diciembre                    | 2022<br>S/. (000.) | 2021<br>S/. (000.) | Diferencia<br>S/. (000.) | Diferencia<br>% |
|---------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------|-----------------|
| <b>Ingresos Operacionales Totales</b> | 45,837             | 47,624             | -1,787                   | -4%             |
| <b>Egresos Operacionales</b>          | -45,738            | -42,711            | -3,027                   | 7%              |
| <b>Resultado Operativo</b>            | 99                 | 4,913              | -4,814                   | -98%            |
| <b>Resultado del Ejercicio</b>        | -2,809             | 6,352              | -9,161                   | -144%           |
| <b>Patrimonio Neto</b>                | 45,467             | 48,276             | -2,809                   | -6%             |

Al 31 de diciembre de 2022 los indicadores de la sociedad muestran una situación adecuada, con un nivel de liquidez que le permitirá cumplir con sus obligaciones de corto plazo:

|                                         |        |
|-----------------------------------------|--------|
| Ratio de Liquidez Prueba ácida          | 0.05   |
| Ratio Activo Corriente/Pasivo Corriente | 6.64   |
| Ratio Pasivos Totales/Patrimonio        | 24.28% |

Al cierre del año 2022, Fondos SURA SAF S.A.C. obtuvo resultados negativos por -S/ 2,809 (miles). El patrimonio de Fondos Sura SAF S.A.C. culminó el año en S/ 45,467 (miles).

---

## **PROCEDIMIENTO DE SELECCIÓN DE LA SOCIEDAD AUDITORA**

Mediante Junta General de Accionistas de fecha 31 de marzo de 2022, la Junta aprobó la designación como sociedad de auditoría externa a la firma Tanaka, Valdivia & Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada, representantes de Ernst & Young, señalando que dicha firma ha sido la sociedad auditora externa que ha venido realizando el análisis de los estados financieros de la sociedad y de los Fondos Mutuos en los últimos años, demostrando su calidad profesional para el cumplimiento de sus labores.

Asimismo, la Sociedad Administradora cuenta con manuales de organización y funciones, así como con manuales de procedimientos, los mismos que le permiten cumplir adecuadamente sus operaciones. Los manuales mencionados cumplen con los requisitos establecidos en el Reglamento de Fondos Mutuos de Inversión en Valores y sus Sociedades Administradoras (Resolución Nro. 068-2014-EF/94.01.1) así como en el Reglamento de Fondos de Inversión y sus Sociedades Administradoras (Resolución Nro.042-2003-EF/94.10).

## **RIESGOS NO FINANCIEROS**

Durante el 2022, desde el área de Riesgos Operativos se ha venido trabajando activamente con todas las áreas de la compañía con el fin de actualizar nuestros planes de continuidad del negocio, con el cual buscamos mantener operativos nuestros productos y/o servicios esenciales que pudiesen verse afectados en caso se cuente con un evento de interrupción significativa. Así mismo, se han definido lineamientos de seguridad para los Canales Digitales con el fin de brindarles mayor seguridad, confiabilidad y disponibilidad a los clientes.

En adición, se detallan los logros relevantes de la gestión de Riesgos Operacionales durante el período:

- La compañía mantuvo el nivel de riesgo en el rango medio en la escala que maneja Sura Asset Management.
- Como parte del Gobierno de Riesgos se han revisado y actualizado los procedimientos, manuales y políticas de Riesgos Operacionales (Riesgo Operativo, Seguridad de la Información y Continuidad del Negocio) de manera integral.
- Desde el frente de Riesgo Operativo hemos venido trabajando con los dueños de procesos para mantener vigentes los riesgos y controles de sus procesos; así como diseñar y monitorear indicadores clave de riesgos; los cuales contribuyen en una adecuada gestión y a mantener el nivel de riesgo de la compañía dentro del rango aceptable.
- En referencia a los temas de Seguridad de la Información y Ciberseguridad, se realizó el monitoreo del cumplimiento de controles a través de las evaluaciones de los procesos tecnológicos, de negocio, proyectos, proveedores y activos de información, con la finalidad de garantizar el cumplimiento del reglamento de la SMV N° 027-2016 -SMV/01 resolución modificatoria N° 014-2019-SMV/01.
- Referente a la continuidad del negocio, durante el 2022 hemos actualizados nuestra metodología de trabajo, así como actualizar nuestros planes de continuidad reflejando nuevos escenarios de trabajo y escenarios de continuidad, con el fin de mantener operando nuestros productos y servicios esenciales para la compañía y enfocados en seguir brindando atención al cliente. Así mismo, hemos realizado pruebas de nivel 1 de forma satisfactoria.
- Referente a la Gestión de Hallazgos por auditorías internas/externas, evaluaciones de riesgos y supervisores, se cumplió con el objetivo de 0% de overdues, es decir, que por sexto año consecutivo venimos cerrando al 100% los planes de acción de los hallazgos dentro del plazo establecido.

- Como parte de la Cultura del Control Interno hemos venido trabajando en diversas actividades de concientización en riesgos, seguridad de la información ciberseguridad, continuidad del negocio; el cual está en marcado en seguir reforzando la cultura de pensamiento basado en riesgos dado que es un punto clave en la gestión adecuada de los riesgos. En ese sentido, durante el 2022 hemos ejecutado charlas, tips de seguridad y realizamos de forma híbrida nuestra Semana del Control el cual de forma interactiva buscó reforzar el conocimiento en la primera línea, así mismo hemos ejecutados pruebas de ingeniería social como parte de validación de efectividad de nuestro plan de concientización. Por otro lado, hemos venido reforzando mensajes de prevención de fraude externo con nuestros clientes.

## **BUEN GOBIERNO CORPORATIVO Y CUMPLIMIENTO**

En relación con la gestión de nuestros órganos de gobierno, durante el 2022 estuvimos enfocados en atender de forma más eficiente y oportuna cada una de las solicitudes, requerimientos y consultas de las diferentes áreas de la compañía y en el refuerzo de los procedimientos de entrega de información necesaria que permita que el acceso eficiente y suficiente de nuestros accionistas y directores.

En dicho sentido, se ampliaron las funcionalidades de Gobertia, herramienta de gestión de los órganos de gobierno, a fin de que nuestros directores puedan enviar sus comentarios de forma segura y confidencial, buscando adecuarnos al entorno digital.

Por otro lado, a través de comunicados interactivos y premiaciones, incentivamos la participación de los colaboradores en nuestros procesos, con el objetivo de obtener un real compromiso con las prácticas de buen gobierno implementadas por la Compañía y reducir cualquier tipo de riesgo que afecte su reputación.

En la misma línea, en el 2022 a través de un video interactivo capacitamos a nuestros colaboradores acerca de los principales lineamientos que nos conducen a lograr un alto estándar en las prácticas de gobierno corporativo.

Asimismo, en virtud de la necesidad de contar con una herramienta que permita consolidar la información societaria de la compañía, nuestra casa matriz implementó “Dilitrust”, herramienta digital que nos provee de información actualizada societaria de Fondos Sura, lo que mejora los tiempos y calidad de las respuestas a nuestros grupos de interés.

Sabemos que la adopción de prácticas de buen gobierno promueve el respeto de los derechos de los accionistas y demás grupos de interés, y contribuye a generar valor, solidez y eficiencia en la compañía, por ello seguiremos reforzando aún más las estructuras y el desempeño del gobierno corporativo, a fin de responder a los intereses directos de nuestros grupos de interés.

### **Cumplimiento:**

Durante el año 2022 el área de Cumplimiento Corporativo continuó perfeccionando el Sistema de Prevención de Lavado de Activos y Financiamiento del Terrorismo de la compañía y, adecuando nuestras políticas y procesos a las nuevas exigencias normativas del regulador.

Por otro lado, culminamos satisfactoriamente con el Plan de Automatización de nuestros procesos, especialmente en la implementación de robots que se encargarán de ejecutar varios de los procesos de debida diligencia, minimizando el riesgo de error humano en los procesos y el riesgo de acciones de Lavado de Activos por parte de clientes de la compañía.

Asimismo, a través de horóscopos, flujogramas, concursos, premiaciones, entre otros, dirigidas a nuestros colaboradores buscamos potenciar aún más las comunicaciones y sensibilización de los procesos de Cumplimiento, a fin de reforzar el actuar ético y responsable conforme a los principios corporativos de la compañía, sin perjuicio de las capacitaciones referidas a línea ética, anticorrupción, datos personales, lavado de activos, entre otros.

Sabemos que los contextos actuales nos desafían constantemente y nos exigen innovar de manera permanente, tomamos este desafío como una oportunidad que nos permitirá superar las expectativas de todos nuestros grupos de interés, por ello seguiremos trabajando para contar con las mejores prácticas y políticas claves a fin prevenir, detectar, enfrentar y mitigar cualquier tipo de riesgo que afecte la reputación e integridad de la Compañía.

## **MARKETING**

### **1. Eventos de relacionamiento:**

Con el objetivo de brindar la más completa asesoría a nuestros clientes, el 2022 realizamos conferencias virtuales que, además de ofrecer asesoría especializada con expositores locales e internacionales, buscaron generar más cercanía y mantener informados a nuestros clientes tanto naturales como jurídicos. En esta línea, realizamos 21 conferencias online “SURA Te Cuenta” para clientes actuales y potenciales. Estas conferencias online fueron dirigidas por los líderes del negocio de inversiones a nivel local y regional y contaron con la presencia de representantes de los gestores de los distintos fondos que administramos. Asimismo, se sumaron reconocidos expositores externos como Arturo Tuesta (Socio de PwC), Luis Malave (Client Relationship Manager de The Carlyle Group) y Axel Christensen (Chief Investment Strategist para Latinoamérica de BlackRock). En estas conferencias se trataron temas de coyuntura del mercado financiero local y global, oportunidades de inversión y se realizaron actualizaciones sobre los distintos fondos que manejamos.

Asimismo, realizamos nuestra cumbre anual SURA SUMMIT, en su segunda versión virtual, en la cual contamos con la ponencia del reconocido escritor Simon Sinek, la cual giró en torno a cómo lograr y mantener nuestro propósito en entornos cambiantes.

### **2. Campañas**

Realizamos la activación de una campaña publicitaria durante el segundo y cuarto trimestre del año. En ella enfatizamos atributos de la marca como nuestro expertise, la asesoría personalizada de nuestro equipo de inversiones y la diversificación de productos de inversión con la que contamos a nivel mundial. Enfocamos la estrategia de despliegue en medios afines a nuestro target, tales como el salón VIP del aeropuerto y torneos deportivos en televisión por cable, como golf, tenis, fútbol, automóvil, entre otros. Adicionalmente, se activó publicidad digital dirigida a nuestros clientes y clientes potenciales a través de redes sociales y páginas afines al target.

Esta campaña logró consolidar buenos resultados en los indicadores de salud de marca del 2022, mostrando un incremento vs los resultados del 2021, lo que nos permitió mantener un buen posicionamiento en un año complejo debido a la coyuntura política y del mercado financiero.

---

### **3. Generación de contenido para nuestros clientes**

Con el fin de brindar contenido de valor para nuestros clientes y brindarles asesoría personalizada, implementamos el envío segmentado de boletines con información del mercado financiero de acuerdo a las preferencias de nuestros clientes.

Asimismo, continuamos con nuestros envíos de Podcast y Videopodcast, los cuales fueron dirigidos por los líderes del negocio de inversiones a nivel local y regional.

Por otro lado, actualizamos la estrategia de contenidos y look&feel para nuestras redes sociales, con el objetivo de reforzar nuestro posicionamiento de marca y brindando información oportuna y de calidad centrándonos en 4 pilares de contenido: updates de mercado, educación, asesoría y promoción de servicios digitales.

### **4. Experiencia Digital**

Nuestros esfuerzos estuvieron centrados en fortalecer nuestra oferta de autoatención y aumentar los niveles de satisfacción de nuestros clientes con nuestros canales digitales. Luego de concluir la renovación de nuestras zonas web privada y pública, haciéndolas más seguras y con una experiencia más moderna y amigable para nuestros clientes, este año incorporamos 4 nuevas funcionalidades, lanzamos el APP de Fondos SURA en las tiendas de Ios, Android y Huawei, e implementamos nuestro Chat de servicios en la zona pública web.

Como resultados obtuvimos un 70% de share de operaciones tier 1 (+8pps vs. 2021), un 49% de incremento de uso de la zona privada web vs el 2020 y mantener nuestros niveles de satisfacción digital, aún en periodos coyunturales, con un 86% de clientes satisfechos. Por el lado de nuestra web pública, obtuvimos 86,600 visitas correspondientes a 12,800 usuarios.

### **5. SURA y el arte**

Comprometidos siempre con la difusión del arte y las expresiones culturales del país, SURA participó de la octava edición del Hay Festival Arequipa 2022 “Abraza la diversidad”, el cual retornó a la presencialidad este año contando con 25,000 asistentes presenciales y 63,870 visualizaciones digitales. Participamos en la rueda de prensa de lanzamiento y contamos con 2 charlas patrocinadas, teniendo presencia de marca en prensa y redes. El Hay Festival es un espacio de conocimiento y acercamiento de culturas y personas, lo que contribuye a nuestro propósito como Grupo Empresarial de crear bienestar y desarrollo sostenible en las sociedades en las que estamos presentes.

### **6. Analítica de clientes**

Desde el frente de Analytics se ha destinado gran parte del esfuerzo en tres principales actividades: identificación de leads para la generación de ingresos a través de marketing digital, mejora en los instrumentos de medición de calidad de servicio y generación de mayor conocimiento sobre la cartera de Fondos SURA, de tipo transaccional y de comportamiento, a través de modelos estadísticos de clasificación.

A través de modelos de perfilamiento, clonación y clasificación se ha logrado crear un flujo continuo de clientes potenciales, los cuales interactúan con nuestras plataformas digitales. Durante el año 2022 se han recaudado 33.8 millones de soles de nuevos clientes que llegaron a través de campañas de marketing digital, donde particularmente el equipo de analítica dio soporte desde la identificación de leads, medición de resultados y calibración de perfiles.

Adicionalmente se ha incrementado en 10 veces la cantidad de variables con las que es posible analizar el comportamiento transaccional de los clientes de Fondos SURA, en aras de identificar oportunidades como campañas de reactivación o cruce de productos.

## **7. Otros reconocimientos:**

Durante el 2022 obtuvimos los siguientes reconocimientos:

- Fondos SURA fue reconocido como Mejor Administrador de Fondos Mutuos en los Perú Golden Awards, realizado por G de Gestión y El Dorado (premiación correspondiente al periodo 2021) para las siguientes categorías:
  - Categoría Muy Corto Plazo Dólares
  - Categoría Corto Plazo Dólares

## **SOSTENIBILIDAD**

La sostenibilidad es el eje central de cada una de nuestras operaciones. A partir de una cultura ampliamente impartida, buscamos que nuestro trabajo impacte positivamente en cada grupo de interés, a través de iniciativas integrales alineadas a nuestros principios. Es así, que nuestra estrategia de sostenibilidad tiene como objetivo la construcción permanente de confianza con nuestros grupos de interés, logrando relaciones de largo plazo que nos permitan acompañarlos a lo largo de todo el camino.

Durante el 2022, trabajamos en función de 2 de los 5 pilares que definen nuestra la estrategia de sostenibilidad de SURA Perú: (i) Cuidamos los recursos, incorporando el análisis de variables Ambientales, Sociales y de Gobierno Corporativo (ASG) en nuestras decisiones de inversión; y (ii) Gestionamos Responsablemente, asegurando que nuestros procesos internos se manejen de forma ética, eficiente, y en línea con nuestros principios corporativos.

### **Cuidamos los recursos**

En línea con nuestro compromiso regional, se actualizó la política de Inversión Responsable para incluir nuestro proceso de engagement y el enfoque de integración de lineamientos ASG referenciales para el proceso de selección de fondos administrados por terceros.

### **Gestionamos responsablemente**

Creemos firmemente que la diversidad e inclusión es una pieza clave que permite a una organización consolidar relaciones de confianza de largo plazo entre la empresa y sus grupos de interés. Esta promueve la innovación y fortalece el compromiso de los colaboradores, además aporta a la atracción y retención del talento para desempeñarnos de manera exitosa en una sociedad que se encuentra en permanente cambio. Es por ello por lo que el Comité de Diversidad e Inclusión (D&I), con el apoyo de nuestro aliado GenderLab y en coordinación con las diversas áreas de la organización, vienen trabajando por segundo año consecutivo en la ejecución de un plan de acción. Esto refleja la convicción que tiene la organización sobre la importancia de fortalecernos en esta materia. El plan contempla medidas de corto, mediano y largo plazo, y tiene el objetivo de reducir las brechas y reforzar las fortalezas de la compañía en temas de género, edad, discapacidad y comunicación y compromiso de los líderes y la organización. Como resultado del 2022, el 100% de las acciones planteadas a corto plazo han sido ejecutadas, mientras que el 34% de las acciones a mediano y largo plazo se encuentran en desarrollo.

Por otra parte, en Fondos SURA, a través de una herramienta regional que permite efectuar la medición de nuestra huella de carbono como parte de SURA Perú, cuantifica sus emisiones de

---

Gases Efecto Invernadero (GEI). En el 2022, la huella de carbono total de SURA Perú fue de 479,331.79 Kg de CO<sub>2</sub> equivalente. Las principales fuentes de emisión para el grupo de empresas son el consumo de energía (65%) y los viajes aéreos (21.5%).

Además, en 2022, en alianza con Perú Sostenible, inscribimos a nuestro proveedor DEMO PLUS en el Programa de Negocios Competitivos, una iniciativa que impulsa la elaboración de reportes de sostenibilidad siguiendo la metodología GRI. Asimismo, desde SURA Perú, apoyamos la iniciativa Provee Pyme, una plataforma que busca fomentar la reactivación económica mediante la articulación de la oferta productiva de las pequeñas empresas y los requerimientos de las grandes empresas. Para ello, lanzamos comunicados a los colaboradores para que conozcan los proveedores que hacen parte de esta iniciativa y los tengan en cuenta en sus requerimientos de contratación y compras.

### **Voluntariado Corporativo**

En 2022 seguimos impulsando el Voluntariado SURA. A través de este, promovemos la participación de los colaboradores en iniciativas que les permitan desarrollar habilidades y competencias, a la vez que generan impactos positivos en la sociedad. En el 2022, los 23 miembros del Comité de Voluntariado Corporativo definieron la estrategia anual y trabajaron en la transferencia de habilidades de educación financiera y campañas para recaudar recursos en apoyo a iniciativas con comunidades vulnerables. Así, alcanzamos a impactar en 86 beneficiarios en total a través de tres proyectos:

- i) Para promover la independencia financiera, se abrió un nuevo programa en alianza con PROA y Nankuranaisa, en el cual 32 colaboradores brindaron asesorías sobre primer empleo, finanzas personales y ahorro provisional a estudiantes de educación superior de distintas regiones.
- ii) En busca de impartir conocimientos financieros para las familias, y en alianza con PROA, Voluntarios por Ti y Misma Luna, 29 colaboradores se conectaron con jefas de familia para fomentar el uso responsable de su dinero.
- iii) En alianza con PROA y Misma Luna, 25 colaboradores se conectaron semanalmente con jóvenes emprendedores para fortalecer sus conocimientos financieros.

Los colaboradores dedicaron cerca de 560 horas. Además, el 100% valoró positivamente su labor en cada programa y el 99% mencionó estar satisfecho con los recursos brindados para dictar las sesiones.

Al finalizar el año, nos aliamos con Comparte Perú, asociación que refuerza la educación y salud mental de niñas(os), adolescentes, padres y docentes de escuelas públicas peruanas. Se llevó a cabo una donación por parte de los colaboradores de la empresa que superó los S/ 6 mil para financiar el evento navideño “Sueños Compartidos”.

### **CONTINGENCIAS SIGNIFICATIVAS**

Al cierre del ejercicio Fondos SURA SAF S.A.C. no registra procesos judiciales, administrativos o arbitrales iniciados o que sea previsible se inicien en contra o a favor, que tengan un impacto significativo sobre los resultados de operación y la posición financiera de la Empresa.

# FONDOS MUTUOS

---

## COMITÉ DE INVERSIONES DE LOS FONDOS MUTUOS

---

Al 31 de diciembre del 2022, el Comité de Inversiones se encontraba compuesto por cuatro (4) miembros, quienes fueron ratificados en Sesión de Directorio de fecha 22 de marzo de 2022 y el 10 de agosto de 2022:

- **Luis Manuel Ordoñez Ruiz<sup>6</sup>:** Profesional de inversiones con experiencia en el mercado de capitales desde el 2007. Es parte de SURA desde el 2016. Actualmente se desempeña como Asociado Senior de Renta Fija en Fondos Sura SAF S.A.C., estando a cargo de la mesa de Renta Fija de Perú. Previamente dentro de Sura Asset Management, se desempeñó como Asociado Senior de Research; especializándose en empresas del sector financiero y aquellas ligadas a la demanda interna. Anteriormente se desempeñó como Head de Research de Inteligo Bank. También ha trabajado como analista de inversiones en fondos de inversión de Private Equity (Aureos Capital y Summa SAFI). Inició su carrera como Trader de Renta Variable Internacional en Horizonte AFP. Bachiller de economía de la Universidad de Pacífico. Cuenta con el nivel I de la certificación CFA (Chartered Financial Analyst) aprobado.
- **Pamela Vega Arce:** Cuenta con más de 12 años de experiencia en inversiones y actualmente se desempeña como Asociado de Research en Fondos SURA SAF S.A.C. Es miembro del Comité de Inversiones desde noviembre de 2009. Previamente ha realizado otras funciones dentro del área de inversiones de Fondos SURA SAF S.A.C. como Estratega de Inversiones encargada del manejo de los portafolios de renta fija de mediano y corto plazo. También trabajó en AFP Integra en el área de Riesgos de Inversión, a cargo de la evaluación, medición y seguimiento de los riesgos (de Crédito, Liquidez y Mercado) de los 3 portafolios administrados por la AFP. Es Bachiller en Economía de la Universidad del Pacífico y cuenta con la certificación CFA.
- **Eloá Aguirre Ramirez:** Licenciada en Administración de la Universidad de Lima, cuenta con 8 años de experiencia en la industria de fondos mutuos y 5 años de experiencia en temas relacionados a inversiones. Actualmente se desempeña como Analista Senior de Renta Fija en Fondos SURA SAF S.A.C. y está a cargo de la gestión de los portafolios de renta fija de corto plazo y muy corto plazo. Forma parte del Comité de Inversiones de los Fondos Mutuos administrados por Fondos SURA. Es candidata a la Maestría en Finanzas de ESADE Business School y ha aprobado el nivel 1 del CFA.
- **Mauricio Meza Ponce<sup>7</sup>:** Ingeniero comercial con especialidad en Finanzas de la Universidad Católica Santa María. Actualmente, se desempeña como Portfolio Manager de Renta Variable en Fondos Sura. Cuenta con 5 años de experiencia en análisis de emisores de renta variable y crédito a nivel regional. Anteriormente ha desempeñado cargos de análisis de inversiones en Omaha Inversiones y es egresado del Curso de Finanzas Avanzadas del Banco Central de Reserva del Perú. Actualmente posee la designación CFA
- **José Antonio Block Granda<sup>8</sup>**
- **Daniel Espinoza Domínguez<sup>9</sup>**
- **Jose Carlos Justo Delado<sup>10</sup>**

---

<sup>6</sup> Desde el 01 de marzo 2022

<sup>7</sup> Desde el 10 de agosto de 2022

<sup>8</sup> Hasta el 25 de febrero de 2022

<sup>9</sup> Hasta el 25 de febrero de 2022

<sup>10</sup> Hasta el 31 de julio de 2022

## **CUSTODIO DE LOS FONDOS MUTUOS**

El custodio de los Fondos Mutuos es Scotiabank Perú S.A.A. el cual pertenece al grupo económico The Bank of Nova Scotia y su domicilio legal está ubicado en Avenida Dionisio Derteano N° 102, San Isidro, Lima. Los accionistas del custodio con más del 4% de participación es: Scotia Perú Holdings S.A. (99.31%).

## **PROCEDIMIENTO DE SELECCIÓN DE LA SOCIEDAD AUDITORA**

Mediante Junta General de Accionistas de fecha 31 de marzo de 2022, la Junta aprobó la designación como sociedad de auditoría externa a la firma Tanaka, Valdivia & Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada, representantes de Ernst & Young, señalando que dicha firma ha sido la sociedad auditora externa que ha venido realizando el análisis de los estados financieros de la sociedad y de los Fondos Mutuos en los últimos años, demostrando su calidad profesional para el cumplimiento de sus labores.

## **EXCESOS DE PARTICIPACIÓN EN LOS FONDOS MUTUOS**

Debemos indicar que en el ejercicio 2022 se presentaron los siguientes excesos de participación:

| <b>FONDO</b>                  | <b>PORCENTAJE</b> | <b>TOTAL DE PARTICIPES EXCEDIDOS</b> |
|-------------------------------|-------------------|--------------------------------------|
| <b>ENERO</b>                  |                   |                                      |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.66             | 1 partícipe                          |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV   | 10.02             | 1 partícipe                          |
| SURA Acciones FMIV            | 10.06             | 1 partícipe                          |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV   | 10.00             | 1 partícipe                          |
| <b>FEBRERO</b>                |                   |                                      |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.03             | 1 partícipe                          |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV   | 10.05             | 1 partícipe                          |
| <b>MARZO</b>                  |                   |                                      |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.01             | 1 partícipe                          |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.13             | 1 partícipe                          |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.01             | 1 partícipe                          |
| <b>ABRIL</b>                  |                   |                                      |
| SURA Ultra Cash Soles FMIV    | 10.23             | Grupo Sura                           |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.11             | 1 partícipe                          |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.02             | 1 partícipe                          |
| <b>MAYO</b>                   |                   |                                      |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV   | 10.59             | 1 partícipe                          |
| SURA Ultra Cash Soles FMIV    | 10.36             | Grupo Sura                           |
| SURA Corto Plazo Dólares FMIV | 10.92             | Grupo Sura                           |
| SURA Ultra Cash Dólares FMIV  | 11.38             | 1 partícipe                          |
| <b>JUNIO</b>                  |                   |                                      |
| SURA Renta Soles FMIV         | 10.01             | 1 partícipe                          |
| SURA Renta Soles FMIV         | 13.46             | 1 partícipe                          |
| SURA Ultra Cash Dólares FMIV  | 10.52             | 1 partícipe                          |

|                                                |       |                    |
|------------------------------------------------|-------|--------------------|
| <b>JULIO</b>                                   |       |                    |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV                    | 10.97 | 1 partícipe        |
| <b>AGOSTO</b>                                  |       |                    |
| Fondo de Fondos SURA Deuda Privada Global FMIV | 57.94 | Aportante Fundador |
| Fondo de Fondos SURA Corto Plazo Global FMIV   | 28.57 | 1 partícipe        |
| <b>SETIEMBRE</b>                               |       |                    |
| SURA Renta Soles FMIV                          | 10.03 | 1 partícipe        |
| SURA Corto Plazo Dólares FMIV                  | 10.02 | 1 partícipe        |
| <b>NOVIEMBRE</b>                               |       |                    |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV                    | 10.02 | 1 partícipe        |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV                    | 11.41 | Grupo Sura         |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV                    | 10.00 | 1 partícipe        |
| SURA Renta Soles FMIV                          | 10.06 | 1 partícipe        |
| <b>DICIEMBRE</b>                               |       |                    |
| SURA Corto Plazo Soles FMIV                    | 10.11 | 1 partícipe        |

## **EQUIPO DE VENTAS Y SERVICIOS**

Al cierre de 2022, Fondos SURA SAF S.A.C. cuenta con un equipo compuesto por 33 Asesores de Inversión, 9 Asesores Patrimoniales, 55 Asesores Comisionistas, 6 Asesores Institucionales, 1 Banqueros de Inversión, 4 Banqueros Patrimoniales y 5 Asesores de Servicio al Cliente.

## **AGENTES COLOCADORES Y DISTRIBUIDORES**

(\*) La información del cuadro muestra la cantidad de excesos generados cada mes, mas no el acumulado a cada corte. Al 31 de diciembre 2022 manteníamos 3 excesos pendientes de regularización en los fondos mutuos Deuda privada global (1), Corto plazo soles (1) y Corto plazo dólares (1).

Al cierre del año 2022 se mantuvieron los acuerdos de agentes colocador con el Banco Interamericano de Finanzas, Renta 4 SAB y SAB SURA.

Asimismo, se firmó contrato de Distribución con Renta 4 SAB.

## **PROCEDIMIENTO DE SUSCRIPCIÓN**

La participación en los fondos mutuos administrados por Fondos SURA SAF S.A.C. se realiza mediante la suscripción de un Contrato de Administración. Una vez firmado el contrato – previa información y evaluación del cliente - se hace entrega del Reglamento de Participación, el anexo al Reglamento de Participación, el prospecto simplificado, el código único de cliente y la respectiva contraseña del cliente para el acceso a su zona privada.

La suscripción de los partícipes se realiza vía la red de agencias de los bancos recaudadores, o vía Internet accediendo a la plataforma web de los bancos recaudadores.

La metodología de asignación del valor cuota se encuentra definida en el anexo al Reglamento de Participación y los prospectos simplificados de cada uno de los fondos mutuos administrados

por Fondos SURA SAF S.A.C. Según las horas de corte establecidas en dicha metodología, el partícipe conocerá el valor cuota con el cual realizará la suscripción.

### **PROCEDIMIENTO DE RESCATE**

La solicitud de rescate de cuotas de los fondos mutuos, así como la metodología de asignación del valor cuota para hacer efectivo el rescate se realiza de acuerdo con lo establecido en el anexo del Reglamento de Participación y el prospecto simplificado de cada uno de los fondos mutuos administrados por Fondos SURA SAF S.A.C. Según las horas de corte establecidas en dicha metodología, el partícipe conocerá el valor cuota con el cual realizará el rescate solicitado. Asimismo, en el anexo al Reglamento de Participación y el Prospecto Simplificado de cada Fondo establece el plazo para hacer efectivo el pago del rescate en cada caso.

### **COMISIONES**

Las comisiones unificadas aplicables a los fondos bajo administración al finalizar el ejercicio 2022 fueron:

| <b>FONDO</b>                               | <b>MONEDA</b> | <b>COMISION UNIFICADA</b> |
|--------------------------------------------|---------------|---------------------------|
| SURA Ultra Cash Soles                      | Soles         | 0.40% + IGV               |
| SURA Ultra Cash Dólares                    | Dólares       | 0.30% + IGV               |
| SURA Corto Plazo Soles                     | Soles         | 0.60% + IGV               |
| SURA Corto Plazo Dólares                   | Dólares       | 0.50% + IGV               |
| SURA Renta Soles                           | Soles         | 1.15% + IGV               |
| SURA Renta Dólares                         | Dólares       | 0.85% + IGV               |
| SURA Deuda Soberana Distributiva Soles (*) | Soles         | 0.85% + IGV               |
| SURA Renta Periódica I Dólares             | Dólares       | 0.20% + IGV               |
| SURA Renta Periódica II Dólares            | Dólares       | 0.85% + IGV               |
| SURA Corto Plazo Global                    | Dólares       | 0.25% + IGV               |
| SURA Capital Estratégico I A               | Soles         | 1.00% + IGV               |
| SURA Capital Estratégico I B               | Soles         | 0.80% + IGV               |
| SURA Capital Estratégico II A              | Soles         | 2.00% + IGV               |
| SURA Capital Estratégico II B              | Soles         | 1.80% + IGV               |
| SURA Acciones                              | Soles         | 3.00% + IGV               |
| SURA Acciones Norteamericanas              | Dólares       | 1.35% + IGV               |
| SURA Acciones Europeas                     | Dólares       | 1.50% + IGV               |
| SURA Selección Global I A                  | Dólares       | 1.00% + IGV               |
| SURA Selección Global I B                  | Dólares       | 0.80% + IGV               |
| SURA Bonos Globales A                      | Dólares       | 0.90% + IGV               |
| SURA Bonos Globales B                      | Dólares       | 1.00% + IGV               |
| SURA Acciones Globales Sostenibles         | Dólares       | 1.35% + IGV               |
| SURA Real Estate Global Income             | Dólares       | 1.00% + IGV               |
| SURA Deuda Latam Dólares                   | Dólares       | 0.00% + IGV               |
| SURA Deuda Privada Global                  | Dólares       | 1.25% + IGV               |

(\*) Al 31/12/2022 este fondo se encontraba en etapa preoperativa sin pagar comisión.

---

## **CONTINGENCIAS SIGNIFICATIVAS**

Al cierre del ejercicio ninguno de los Fondos Mutuos administrados por Fondos SURA SAF S.A.C. registra procesos judiciales, administrativos o arbitrales iniciados o que sea previsible se inicien en contra o a favor, que tengan un impacto significativo sobre los resultados de operación y la posición financiera de los Fondos.

## **FONDOS MUTUOS**

### **SURA Renta Dólares FMIV**

#### **Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores**

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución Gerencia General N° 039-2005-EF/94.11 de fecha 14 de abril de 2005, con el nombre de ING RENTA FUND – FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Renta Dólares FMIV, siendo la última modificación realizada mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 095-2022-SMV/10.2 de fecha 15 de agosto de 2022.

#### **Objetivo de Inversión del Fondo**

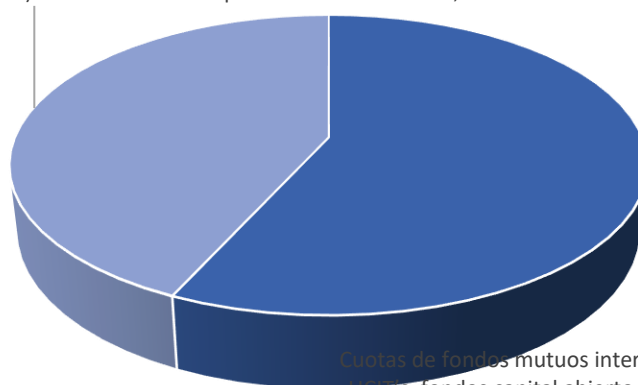
Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en dólares en instrumentos representativos de deuda en mercados locales e internacionales. Se tiene como objetivo maximizar la relación entre riesgo y retorno, manteniendo adecuados niveles de liquidez en un horizonte de mediano plazo.

#### **Política de Inversión del Fondo**

La duración promedio del portafolio de instrumentos representativos de deuda es de 2 años, fluctuando en un rango de entre 1 y 3 años. El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, así como en instrumentos representativos de deuda de largo plazo con una clasificación igual o superior a BBB- para el mercado local y hasta B para el internacional y en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-

### Inversiones del Fondo por Instrumento

Instrumentos distintos de cuotas de fondos de inversión, fondos mutuos internacionales, ETF's, UCIT's, fondos capital abierto (Open Ended) de instrumentos representativos de deuda; 43.21%



Cuotas de fondos mutuos internacionales, ETF's, UCIT's, fondos capital abierto (Open Ended) de instrumentos representativos de deuda (1); 56.79%

Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Emisor

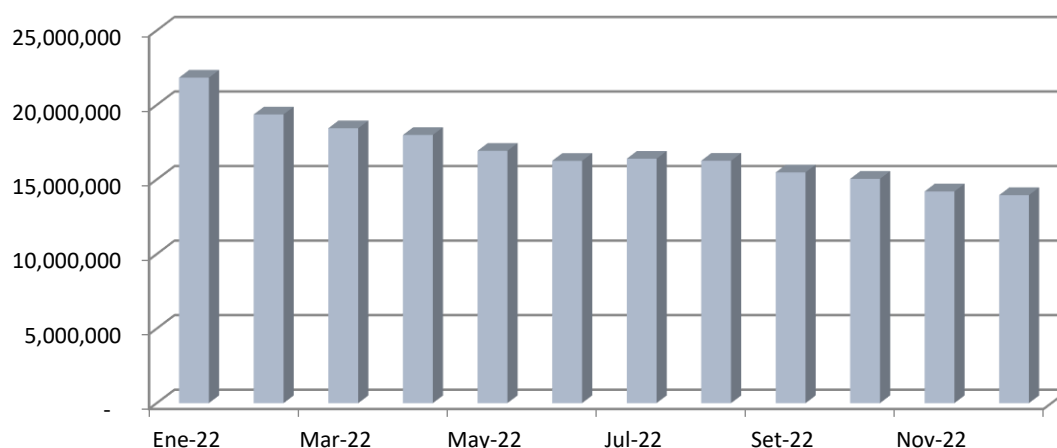
| EMISORES                                      | %           |
|-----------------------------------------------|-------------|
| BLACK ROCK                                    | 18.55%      |
| VANGUARD SHORT TERM CORPORATE BOND ETF        | 14.76%      |
| VANGUARD SHORT TERM BOND ETF                  | 14.71%      |
| ISHARES \$ SHORT DURATION CORP BOND UCITS ETF | 8.78%       |
| ORAZUL ENERGY EGENOR                          | 5.18%       |
| BANCO DE BOGOTA                               | 4.98%       |
| BTG PACTUAL                                   | 4.97%       |
| OTROS                                         | 28.08%      |
| <b>TOTAL</b>                                  | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Renta Dólares 30/12/2022                                                                                                                               |           |          |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                                                                                                                                          | 1.95      |          |         |
| Derivados                                                                                                                                                                           | -         | Márgenes | Legales |
| Límite                                                                                                                                                                              | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio                                                                                                                      | -         | Al 0     | 10.00   |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                                                                                                                                     | 100.00    | na       | na      |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                                                                                                                 | 12.23     | Al 0     | 87.77   |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                                                                                                                | 4.87      | Al 0     | 95.13   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                                                                                                   | 4.59      | Al 0     | 95.41   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                                                                                                                 | 20.68     | Al 0     | 59.32   |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda                                                                                                              | -         | Al 0     | 70.00   |
| Cuotas de fondos mutuos internacionales, ETF's, UCIT's, fondos capital abierto (Open Ended) de instrumentos representativos de deuda (1)                                            | 55.69     | Al 0     | 14.31   |
| Instrumentos distintos de cuotas de fondos de inversión, fondos mutuos internacionales, ETF's, UCIT's, fondos capital abierto (Open Ended) de instrumentos representativos de deuda | 42.37     | Al 0     | -12.37  |
| Según Moneda (Posición Neta)                                                                                                                                                        | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                                                                                                                               | 98.05     | 23.05    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                                                                                                                                        | -         | Al 0     | 25.00   |
| Según Tipo de Mercado                                                                                                                                                               | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                                                                                                                                        | 9.64      | Al 0     | 90.36   |
| Inversiones en mercado extranjero                                                                                                                                                   | 88.42     | Al 0     | 11.58   |
| Según Clasificación de Riesgo de los instrumentos de deuda                                                                                                                          | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                                                                                                                                         | -         |          |         |
| CP-1                                                                                                                                                                                | -         | Al 0     | 80.00   |
| CP-2 y CP-3                                                                                                                                                                         | -         | Al 0     | 20.00   |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                                                                                                                                         | 3.12      |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                  | 3.12      | Al 0     | 96.88   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                               | -         | Al 0     | 20.00   |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                                                                                                                               | 6.52      |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                   | 6.52      | Al 0     | 100.00  |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                    | -         | Al 0     | 20.00   |
| Menor a B-                                                                                                                                                                          | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Internacional                                                                                                                                                               | 32.73     |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                                                                                                                     | -         | Al 0     | 80.00   |
| Corto Plazo: Menor a CP - 3                                                                                                                                                         | -         | -        | -       |
| Largo Plazo: No menor a B                                                                                                                                                           | 32.73     | Al 0     | 67.27   |
| Largo Plazo: Menor a B                                                                                                                                                              | -         | -        | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                                                                                                                                            | -         | Al 0     | 100.00  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                                                                                                              | -         | Al 0     | 50.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                                                                                                                              | -         |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                | -         | Al 0     | 100.00  |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                            | -         | Al 0     | 25.00   |
| Swaps                                                                                                                                                                               | -         | Al 0     | 100.00  |
| DURACIÓN                                                                                                                                                                            |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                                                                                                                              | 2.15      | 1.15     | 0.85    |

Patrimonio Administrado (US\$)



Evolución del patrimonio y valor cuota

| Fecha  | Cuotas     | Valor Cuota | US\$       |
|--------|------------|-------------|------------|
| Ene-22 | 129,173.40 | 169.030779  | 21,834,281 |
| Feb-22 | 115,613.74 | 167.517287  | 19,367,299 |
| Mar-22 | 109,987.00 | 167.677291  | 18,442,323 |
| Abr-22 | 107,804.27 | 166.882344  | 17,990,630 |
| May-22 | 101,165.37 | 167.299877  | 16,924,954 |
| Jun-22 | 97,448.85  | 166.778207  | 16,252,345 |
| Jul-22 | 97,997.75  | 167.308966  | 16,395,902 |
| Ago-22 | 96,855.29  | 167.888577  | 16,260,897 |
| Set-22 | 93,090.71  | 166.296487  | 15,480,657 |
| Oct-22 | 90,609.28  | 166.065270  | 15,047,054 |
| Nov-22 | 84,543.92  | 168.008009  | 14,204,055 |
| Dic-22 | 82,710.11  | 168.701610  | 13,953,328 |

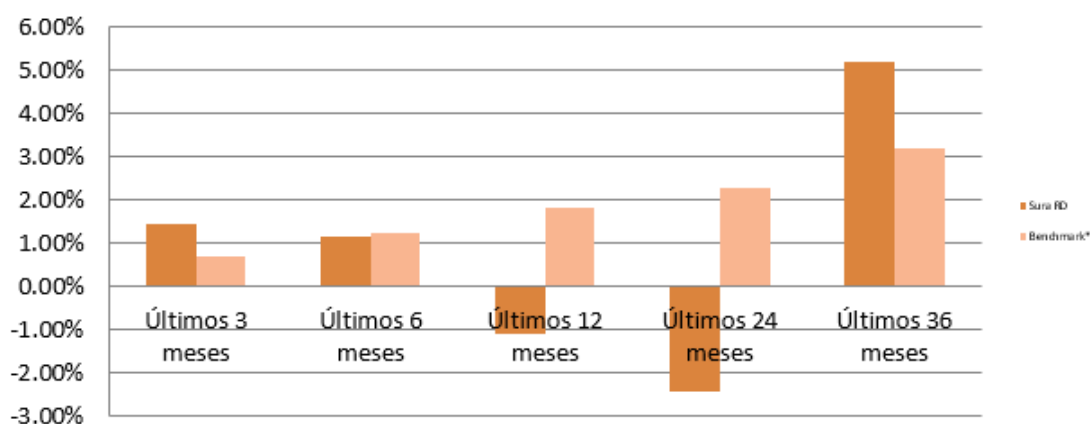
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 771,353            | 770,607       | 742        |
| Feb-22 | 192,943            | 2,468,954     | 696        |
| Mar-22 | 455,357            | 1,397,255     | 674        |
| Abr-22 | 309,317            | 674,584       | 661        |
| May-22 | 86,770             | 1,195,674     | 637        |
| Jun-22 | 262,797            | 884,054       | 628        |
| Jul-22 | 553,968            | 462,425       | 614        |
| Ago-22 | 151,841            | 343,706       | 608        |
| Set-22 | 192,034            | 820,650       | 599        |
| Oct-22 | 111,062            | 523,045       | 574        |
| Nov-22 | 74,260             | 1,083,245     | 564        |
| Dic-22 | 158,550            | 467,754       | 554        |

Rentabilidad de SURA Renta Dólares FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura RD | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | 1.45%   | 0.70%      |
| Últimos 6 meses  | 1.15%   | 1.25%      |
| Últimos 12 meses | -1.09%  | 1.81%      |
| Últimos 24 meses | -2.43%  | 2.27%      |
| Últimos 36 meses | 5.19%   | 3.19%      |

\*El promedio de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera a 360 días ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderado en función a su volumen de depósitos del banco respectivo.

**Retorno Histórico Sura Renta Dolares vs Benchmark**



A diciembre de 2022, el fondo mutuo de renta fija en dólares, SURA Renta Dólares FMIV, registró un patrimonio de US\$ 13,953,328 y obtuvo un rendimiento de -1.09%.

Asimismo, cabe indicar que, en Setiembre del 2022 entró en vigencia el nuevo allocation del fondo (70% de inversión en UCITs, ETFs y/o Fondos Mutuos del exterior y 30% en Bonos Corporativos y Depósitos a Plazo).

Con respecto a ello, debido al proceso de implementación del nuevo allocation, al 31 de diciembre de 2022, se mantuvo un exceso de inversión legal por instrumentos distintos de cuotas de fondos de inversión, fondos mutuos internacionales, ETF's, UCIT's, fondos de capital abierto (open ended) de instrumentos representativos de deuda.

## SURA Renta Soles FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución Gerencia General N° 138-2005-EF/94.11 de fecha 26 de diciembre de 2005, con el nombre de ING RENTA SOLES FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Renta Soles FMIV, siendo la última modificación la realizada mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 048-2019-SMV/10.2 de fecha 06 de junio de 2019 donde se modifica el objetivo de inversión y la política de inversiones.

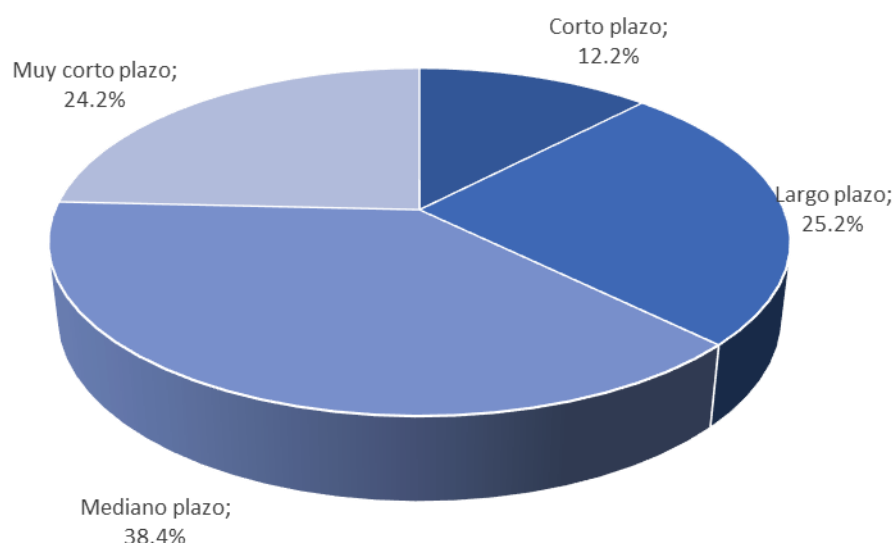
### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda local en instrumentos representativos de deuda emitidos en mercados locales e internacionales. Se tiene como objetivo maximizar la relación entre riesgo y retorno, manteniendo adecuados niveles de liquidez en un horizonte de mediano plazo.

### Política de Inversión del Fondo

El Fondo Mutuo Sura Renta Soles FMIV invierte únicamente en instrumentos representativos de deuda, denominados principalmente en soles, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú o en el extranjero. La duración promedio del portafolio de instrumentos representativos de deuda es de 2 años, fluctuando en un rango de entre 1 y 3 años. El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3 para el internacional, así como en instrumentos representativos de deuda de largo plazo con una clasificación igual o superior a BBB- para el mercado local y hasta BB- para el internacional y en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-.

### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Emisor

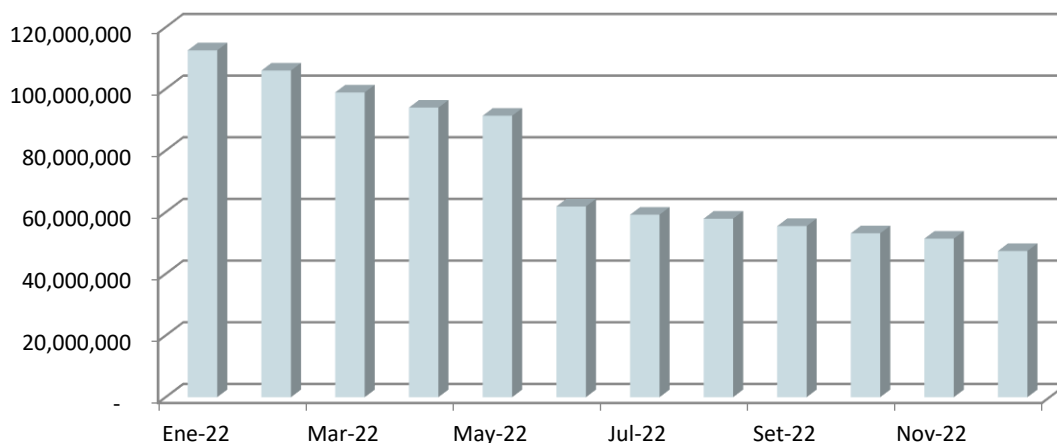
| EMISORES                                | %           |
|-----------------------------------------|-------------|
| FONDO MIVIVIENDA S.A.                   | 17.54%      |
| REPUBLICA DEL PERU                      | 15.28%      |
| SCOTIABANK DEL PERÚ                     | 13.41%      |
| ALICORP S.A.A.                          | 12.04%      |
| BANCO BBVA PERU                         | 8.19%       |
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS        | 6.63%       |
| MIBANCO - BANCO DE LA MICROEMPRESA S.A. | 5.54%       |
| OTROS                                   | 21.36%      |
| <b>TOTAL</b>                            | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

### Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Renta Soles 30/12/2022                                              |           |          |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                                                       | 0.57      |          |         |
| Derivados                                                                                        | -         | Márgenes | Legales |
| Límite                                                                                           | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio                                   | -         | Al 0     | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                                                  | 100.00    | na       | na      |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                              | 20.00     | Al 0     | 80.00   |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                             | 40.05     | Al 0     | 59.95   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                | 15.27     | Al 0     | 84.73   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                              | 24.11     | Al 0     | 55.89   |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda                           | -         | Al 0     | 30.00   |
| Instrumentos distintos de cuotas de fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda | 99.43     | 29.43    | 0.57    |
| Según Moneda (Posición Neta)                                                                     | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                                            | 99.43     | 24.43    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                                                     | -         | Al 0     | 25.00   |
| Según Tipo de Mercado                                                                            | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                                                     | 92.40     | Al 0     | 7.60    |
| Inversiones en mercado extranjero                                                                | 7.04      | Al 0     | 92.96   |
| Según Clasificación de Riesgo de los instrumentos de deuda                                       | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                                                      | -         |          |         |
| CP-1                                                                                             | -         | Al 0     | 80.00   |
| CP-2 y CP-3                                                                                      | -         | Al 0     | 20.00   |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                                                      | 34.99     |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                                               | 34.99     | Al 0     | 65.01   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                            | -         | Al 0     | 20.00   |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                                            | 42.21     |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                                                | 42.21     | Al 0     | 57.79   |
| Desde B hasta B-                                                                                 | -         | Al 0     | 20.00   |
| Menor a B-                                                                                       | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Internacional                                                                            | 7.04      |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                                  | -         | Al 0     | 80.00   |
| Corto Plazo: Menor a CP - 3                                                                      | -         | -        | -       |
| Largo Plazo: No menor a BB-                                                                      | 7.04      | Al 0     | 92.96   |
| Largo Plazo: Menor a BB-                                                                         | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                                                         | 15.20     | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                           | -         | Al 0     | 50.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                                           | -         |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                             | -         | Al 0     | Al 100  |
| Forwards a otras monedas                                                                         | -         | Al 0     | 25.00   |
| Swaps                                                                                            |           | na       | Al 100  |
| DURACIÓN                                                                                         |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                                           | 1.55      | 0.55     | 1.45    |

Patrimonio Administrado (S/.)



Evolución del patrimonio y valor cuota

| Fecha  | Cuotas     | Valor Cuota | PEN         |
|--------|------------|-------------|-------------|
| Ene-22 | 592,707.29 | 189.841159  | 112,520,238 |
| Feb-22 | 559,487.59 | 189.398153  | 105,965,916 |
| Mar-22 | 522,067.38 | 189.350535  | 98,853,739  |
| Abr-22 | 496,637.31 | 189.148670  | 93,938,286  |
| May-22 | 480,720.45 | 189.927456  | 91,302,013  |
| Jun-22 | 325,374.89 | 190.161168  | 61,873,669  |
| Jul-22 | 311,906.44 | 189.827139  | 59,208,307  |
| Ago-22 | 302,842.92 | 191.192183  | 57,901,199  |
| Set-22 | 292,066.54 | 190.124911  | 55,529,125  |
| Oct-22 | 277,539.97 | 191.588226  | 53,173,391  |
| Nov-22 | 262,956.91 | 195.580286  | 51,429,188  |
| Dic-22 | 242,862.36 | 195.258909  | 47,421,040  |

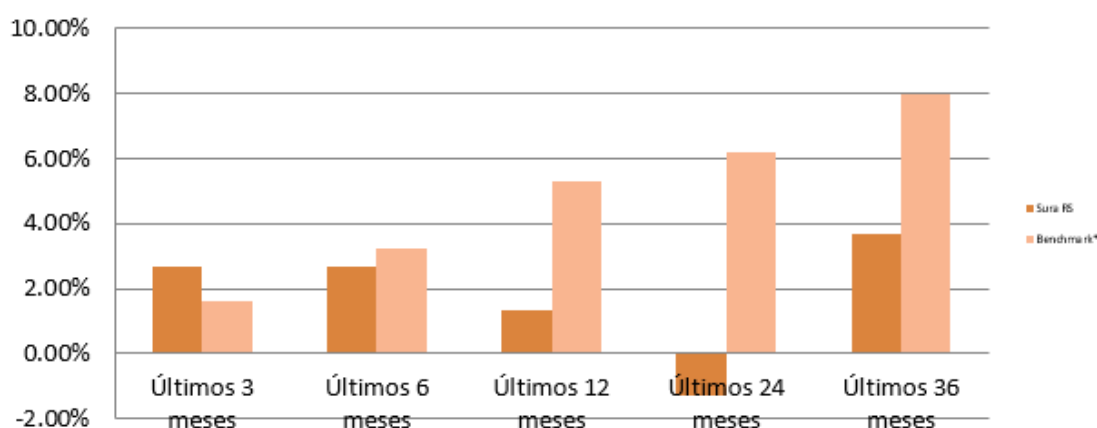
| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 3,944,672         | 6,260,751    | 870        |
| Feb-22 | 222,418           | 6,527,984    | 824        |
| Mar-22 | 471,944           | 7,560,499    | 789        |
| Abr-22 | 608,536           | 5,419,834    | 763        |
| May-22 | 71,100            | 3,087,837    | 732        |
| Jun-22 | 217,796           | 29,747,646   | 711        |
| Jul-22 | 1,150,690         | 3,710,748    | 704        |
| Ago-22 | 258,242           | 1,986,931    | 685        |
| Set-22 | 363,867           | 2,425,029    | 668        |
| Oct-22 | 242,582           | 3,013,315    | 649        |
| Nov-22 | 125,629           | 2,963,553    | 634        |
| Dic-22 | 197,389           | 4,119,303    | 620        |

Rentabilidad de SURA Renta Soles FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura RS | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | 2.70%   | 1.62%      |
| Últimos 6 meses  | 2.68%   | 3.22%      |
| Últimos 12 meses | 1.34%   | 5.27%      |
| Últimos 24 meses | -1.29%  | 6.19%      |
| Últimos 36 meses | 3.67%   | 7.97%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional a 360 días ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

**Retorno Histórico Sura Renta Soles vs Benchmark**



A diciembre de 2022, SURA Renta Soles FMIV administró un patrimonio de S/ 47,421,040.00 nuevos soles. El retorno de “SURA Renta Soles FMIV” durante el 2022 fue de 1.34%.

Al cierre del año, el fondo presentó un exceso en la política de inversión por el emisor Fondo Mivivienda, que poseía una posición superior al máximo permitido del activo del fondo.

## SURA Acciones FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución Gerencia General N° 002-2007-EF/94.11 de fecha 05 de enero de 2007, con el nombre de ING RENTA ACCIONES FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Renta Acciones FMIV.

### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda local en instrumentos de renta variable emitidos por empresas locales y extranjeras que listan en la Bolsa de Valores de Lima, teniendo como objetivo maximizar la relación entre riesgo y retorno con un horizonte de inversión de largo plazo.

### Política de Inversión del Fondo

Las inversiones se realizan en instrumentos de renta variable emitidos por instituciones y empresas establecidas o constituidas en el Perú y que formen parte del índice Morgan Stanley Capital International All Peru 10/40 (MSCI 10/40). El fondo “SURA Acciones FMIV” (antes ING Renta Acciones FMIV) toma el rendimiento de índice como indicador de referencia a partir de abril del 2015. Anteriormente se tenía como referencia del Índice Selectivo de la Bolsa de Valores de Lima (ISBVL).

En vista de la volatilidad de los valores que componen las inversiones (al menos 75% del portafolio invertido en instrumentos de renta variable), este Fondo está dirigido a inversionistas con baja aversión al riesgo.

### Inversiones del Fondo por Sector Económico

| Sector             | %           |
|--------------------|-------------|
| MINERÍA            | 35.07%      |
| FINANCIEROS        | 29.11%      |
| CONSTRUCCIÓN       | 15.43%      |
| CONSUMO            | 14.28%      |
| RETAIL             | 5.05%       |
| SERVICIOS PÚBLICOS | 0.44%       |
| <b>Total</b>       | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Instrumento

| Instrumento    | %           |
|----------------|-------------|
| Renta Variable | 97.29%      |
| Cash           | 2.71%       |
| <b>Total</b>   | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

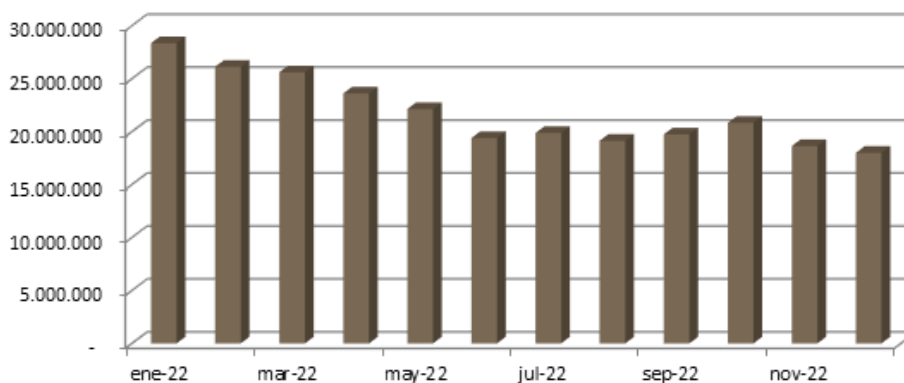
| EMISORES                          | %           |
|-----------------------------------|-------------|
| ALICORP S.A.A.                    | 14.37%      |
| ENRIQUE FERREYROS                 | 12.04%      |
| CIA. DE MINAS BUENAVENTURA S.A.A. | 12.02%      |
| INTERCORP FINANCIAL SERVICES      | 10.27%      |
| SOUTHERN PERU COPPER CORPORATION  | 9.79%       |
| CREDICORP                         | 9.67%       |
| CERRO VERDE                       | 8.46%       |
| OTROS                             | 23.37%      |
| <b>TOTAL</b>                      | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Acciones 30/12/2022                                          |               |              |               |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|---------------|
| Caja + CxC + Derivados                                                                    | 1.29          | Márgenes     | Legales       |
| Según Tipo de Instrumento                                                                 | % Cartera     | Min          | Max           |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                     | <b>95.54</b>  | <b>20.54</b> | <b>Al 100</b> |
| Acciones comunes y de inversión                                                           | 83.74         | 0            | 100           |
| Acciones preferentes                                                                      | -             | 0            | 100           |
| American Depositary Receipts (ADRs)                                                       | 11.80         | 0            | 100           |
| Certificados de Suscripción Preferente                                                    | -             | 0            | 100           |
| Cuotas de Fondos Mutuos de renta variable                                                 | -             | 0            | 0             |
| Cuotas de Fondos de Inversión de renta variable                                           | -             | 0            | 0             |
| Otros autorizados por la SMV                                                              | -             | 0            | 100           |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                    | <b>2.66</b>   | <b>0</b>     | <b>25.00</b>  |
| Instr. emitidos / garantizados por el Gobierno, BCOP y organismos multilaterales          | -             | 0            | 25.00         |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                        | 2.66          | 0            | 25.00         |
| Instrumentos emitidos por empresas del sistema financiero                                 | -             | 0            | 25.00         |
| Instrumentos de emisiones corporativas                                                    | -             | 0            | 25.00         |
| Cuotas de Fondos Mutuos de instrumentos representativos de deuda o pasivos                | -             | 0            | 0             |
| Cuotas de Fondos de Inversión de instrumentos representativos de deuda o pasivos          | -             | 0            | 0             |
| Exchange Trade Funds (ETF) relacionados a instrumentos representativos de deuda o pasivos | -             | 0            | 0             |
| Operaciones de reporte y otros autorizados por la SMV                                     | -             | 0            | 25.00         |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                  | <b>100.00</b> |              |               |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                       | 41.92         | 0            | 100           |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                | 56.29         | 0            | 100           |
| <b>Origen Mercado</b>                                                                     | <b>100.00</b> |              |               |
| Mercado Local                                                                             | 52.21         | 0            | 100           |
| Mercado Extranjero                                                                        | 45.99         | 0            | 100           |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                     | <b>2.66</b>   |              |               |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                         |               |              |               |
| CP - 1 - CP-3                                                                             | -             | 0            | 25.00         |
| Desde CP-2 hasta CP-3                                                                     | -             | 0            | 5.00          |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                         |               |              |               |
| Desde AAA hasta AA-                                                                       | -             | 0            | 25.00         |
| Desde A+ hasta BBB-                                                                       | -             | 0            | 5.00          |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                               | <b>2.66</b>   |              |               |
| Desde A+ hasta B+                                                                         | 2.66          | 0            | 25.00         |
| Desde B hasta B-                                                                          | -             | 0            | 5.00          |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                              |               |              |               |
| Corto Plazo: no menor a CP-2                                                              | -             | 0            | 25.00         |
| Largo Plazo: no menor a BBB-                                                              | -             | 0            | 25.00         |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BCOP)</b>                                           |               |              |               |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                    | -             | 0            | 25.00         |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                             |               |              |               |
| Forward a la moneda del valor cuota                                                       | -             | 0            | 25.00         |
| Forward a otras monedas                                                                   | -             | 0            | 25.00         |

Patrimonio Administrado (S/.)



Evolución del patrimonio

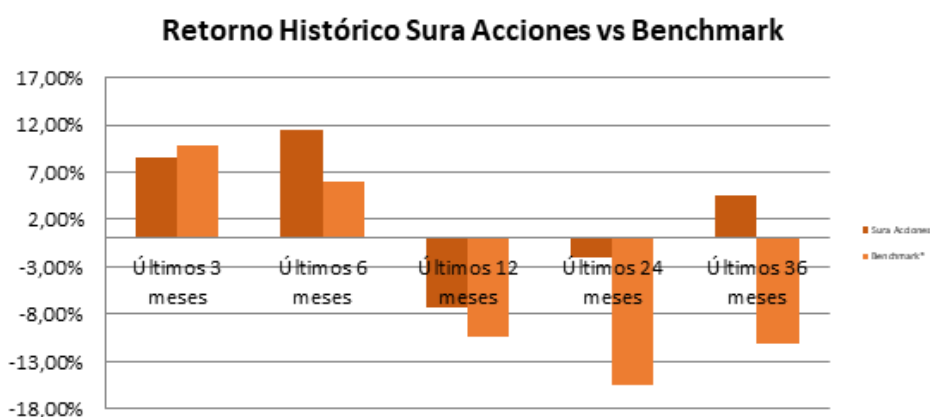
| Fecha  | Cuotas       | Valor Cuota | PEN        |
|--------|--------------|-------------|------------|
| Ene-22 | 2,035,269.89 | 13.935285   | 28,362,067 |
| Feb-22 | 1,858,992.32 | 14.053062   | 26,124,534 |
| Mar-22 | 1,766,861.59 | 14.489132   | 25,600,291 |
| Abr-22 | 1,777,612.61 | 13.280524   | 23,607,626 |
| May-22 | 1,813,646.83 | 12.202200   | 22,130,481 |
| Jun-22 | 1,801,779.75 | 10.764728   | 19,395,670 |
| Jul-22 | 1,800,969.70 | 11.036938   | 19,877,190 |
| Ago-22 | 1,790,475.37 | 10.688696   | 19,137,847 |
| Set-22 | 1,783,939.14 | 11.063040   | 19,735,790 |
| Oct-22 | 1,729,112.51 | 12.043773   | 20,825,039 |
| Nov-22 | 1,503,686.19 | 12.399334   | 18,644,707 |
| Dic-22 | 1,499,651.38 | 12.006773   | 18,005,973 |

| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 380,350           | 1,586,082    | 890        |
| Feb-22 | 381,214           | 2,849,873    | 882        |
| Mar-22 | 141,640           | 1,481,605    | 880        |
| Abr-22 | 782,589           | 601,442      | 871        |
| May-22 | 685,910           | 260,688      | 873        |
| Jun-22 | 297,555           | 414,788      | 866        |
| Jul-22 | 261,487           | 266,762      | 854        |
| Ago-22 | 134,665           | 246,200      | 852        |
| Set-22 | 297,765           | 367,104      | 846        |
| Oct-22 | 32,320            | 666,583      | 838        |
| Nov-22 | 148,573           | 2,945,275    | 832        |
| Dic-22 | 46,580            | 95,627       | 828        |

Rentabilidad de SURA Acciones FMIV (antes ING Renta Acciones) vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura Acciones | Benchmark* |
|------------------|---------------|------------|
| Últimos 3 meses  | 8.53%         | 9.81%      |
| Últimos 6 meses  | 11.54%        | 6.09%      |
| Últimos 12 meses | -7.35%        | -10.30%    |
| Últimos 24 meses | -1.94%        | -15.41%    |
| Últimos 36 meses | 4.52%         | -11.16%    |

\*Desde Abril 2015 se toma como referencia se toma el MSCI 10/40. Anteriormente, se usaba como Benchmark el Índice Selectivo de la Bolsa de Valores de Lima.



\* El indicador de referencia es actualmente el índice MSCI Peru 10/40.

A diciembre del 2022, “SURA Acciones FMIV” (antes ING Renta Acciones FMIV), mantuvo un patrimonio administrado de S/. 18’005,973 nuevos soles. El Fondo obtuvo un rendimiento de -7.35% durante el 2022, con un alpha positivo en relación al benchmark, el cual tuvo una caída de 10.30% durante dicho período.

Cabe mencionar que el portafolio del Fondo se mantuvo dentro de los límites establecidos en la política de inversiones (no se produjeron excesos).

La reducción de partícipes observada durante el 2022 estuvo motivada por un menor apetito de riesgo por activos de renta variable local, debido a la incertidumbre política a lo largo del año y una menor liquidez en la bolsa local producto de las leyes de retiros de las AFPs.

## SURA Corto Plazo Soles FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución Directoral de Patrimonios Autónomos N° 060-2008-EF/94.06.2 de fecha 25 de noviembre de 2008, con el nombre de ING Renta Corto Plazo Soles – FMIV; mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Corto Plazo Soles FMIV, siendo su última modificación mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 087-2019-SMV/10.2 de fecha 21 de octubre de 2019.

### Objetivo de Inversión del Fondo

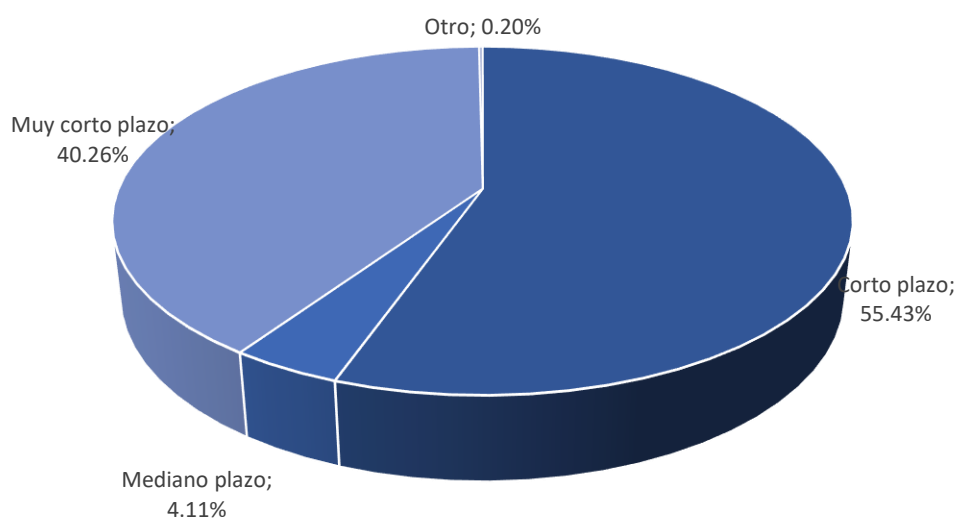
El Fondo tiene como objetivo ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda local, a través de instrumentos representativos de deuda -principalmente de corto plazo-, emitidos tanto en mercados locales como internacionales. Se busca maximizar la relación riesgo y retorno a través de un portafolio con una muy baja volatilidad y manteniendo niveles adecuados de liquidez en un horizonte de inversión de corto plazo.

### Política de Inversión del Fondo

La tipología del Fondo es de Instrumentos de Deuda de Corto Plazo. Las inversiones se realizan principalmente en instrumentos de corto plazo que cuenten con la mejor clasificación de riesgo crediticio o en instrumentos con riesgo soberano. La duración objetivo del portafolio es de 180 días, manteniéndose en todo momento en un rango que puede fluctuar entre 0 y 360 días.

La política conservadora del fondo conduce a invertir los recursos principalmente en activos clasificados en las categorías CP1+ a CP1- en el corto plazo y en las categorías AAA a AA- en el largo plazo.

### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Emisor

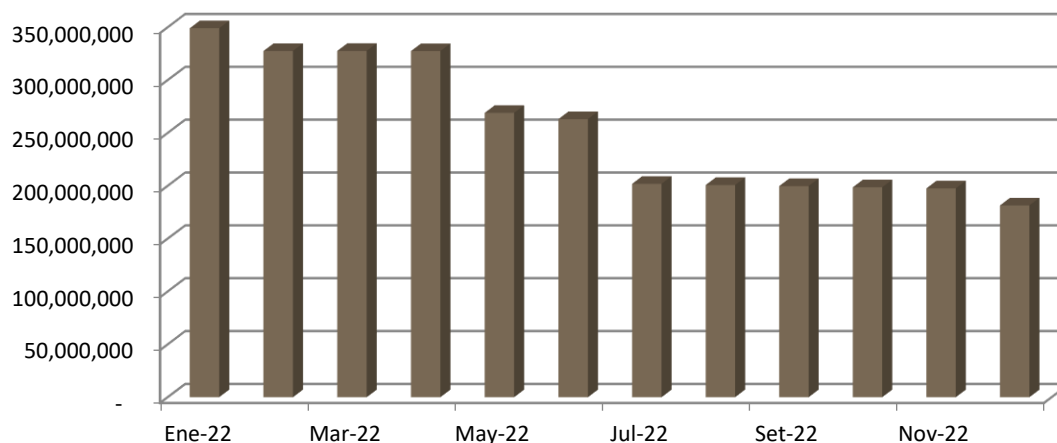
| EMISORES                                | %           |
|-----------------------------------------|-------------|
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS        | 18.02%      |
| BANCO BBVA PERU                         | 16.49%      |
| MIBANCO - BANCO DE LA MICROEMPRESA S.A. | 15.11%      |
| SCOTIABANK DEL PERÚ                     | 12.15%      |
| BANCO FALABELLA PERU S.A                | 11.13%      |
| BANCO DE CREDITO DEL PERU               | 8.53%       |
| BANCO GNB DEL PERÚ                      | 4.49%       |
| OTROS                                   | 14.08%      |
| <b>TOTAL</b>                            | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

### Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Corto Plazo Soles 30/12/2022              |           |          |         |
|------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                             | 0.27      |          |         |
| Derivados                                                              | 0.20      | Márgenes | Legales |
| Límite                                                                 | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio         | -         | Al 0     | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                        | 100.00    | na       | na      |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                    | -         | Al 0     | 40.00   |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                   | 2.45      | Al 0     | 47.55   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                      | 56.93     | Al 0     | 43.07   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                    | 40.15     | Al 0     | 59.85   |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda | -         | Al 0     | 100.00  |
| Cuotas de Fondos Mutuos                                                | -         | Al 0     | 40.00   |
| Según Moneda (Posición Neta)                                           | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                  | 99.73     | 24.73    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                           | - 0.00    | Al 0     | 25.00   |
| Según Tipo de Mercado                                                  | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                           | 95.37     | Al 0     | 4.63    |
| Inversiones en mercado extranjero                                      | 4.36      | Al 0     | 95.64   |
| Según Clasificación de Riesgo de los instrumentos de deuda             | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                            | 4.09      |          |         |
| CP-1                                                                   | 4.09      | Al 0     | 95.91   |
| CP-2                                                                   | -         | Al 0     | 50.00   |
| CP-3                                                                   | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                            | 3.73      |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                     | 3.73      | Al 0     | 96.27   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                  | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                  | 87.35     |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                      | 87.35     | Al 0     | 12.65   |
| Desde B hasta B-                                                       | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Internacional                                                  | 4.36      |          |         |
| Corto Plazo: No menor a CP-2                                           | -         | Al 0     | 100.00  |
| Corto Plazo: Menor a CP-2                                              | -         | Al 0     | -       |
| Largo Plazo: No menor a BB-                                            | 4.36      | Al 0     | 95.64   |
| Largo Plazo: Menor a BB-                                               | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                               | -         | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                 | -         | Al 0     | 50.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                 | 6.33      |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                   | 6.33      | Al 0     | Al 100  |
| Forwards a otras monedas                                               | -         | Al 0     | 25.00   |
| Swaps                                                                  |           | Al 0     | 100.00  |
| DURACIÓN                                                               |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                 | 0.415     | 0.17     | 0.585   |

Patrimonio Administrado (S/.)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas       | Valor Cuota | PEN         |
|--------|--------------|-------------|-------------|
| Ene-22 | 2,163,187.71 | 161.389660  | 349,116,130 |
| Feb-22 | 2,031,936.55 | 161.213773  | 327,576,158 |
| Mar-22 | 2,026,178.43 | 161.683188  | 327,598,988 |
| Abr-22 | 2,019,227.08 | 162.171163  | 327,460,403 |
| May-22 | 1,652,453.60 | 162.802569  | 269,023,690 |
| Jun-22 | 1,609,520.45 | 163.448627  | 263,073,908 |
| Jul-22 | 1,231,008.85 | 163.953077  | 201,827,688 |
| Ago-22 | 1,218,976.04 | 164.687735  | 200,750,403 |
| Set-22 | 1,207,457.58 | 165.416490  | 199,733,394 |
| Oct-22 | 1,195,305.98 | 166.190054  | 198,647,966 |
| Nov-22 | 1,183,281.86 | 166.974380  | 197,577,754 |
| Dic-22 | 1,081,028.25 | 167.821918  | 181,420,234 |

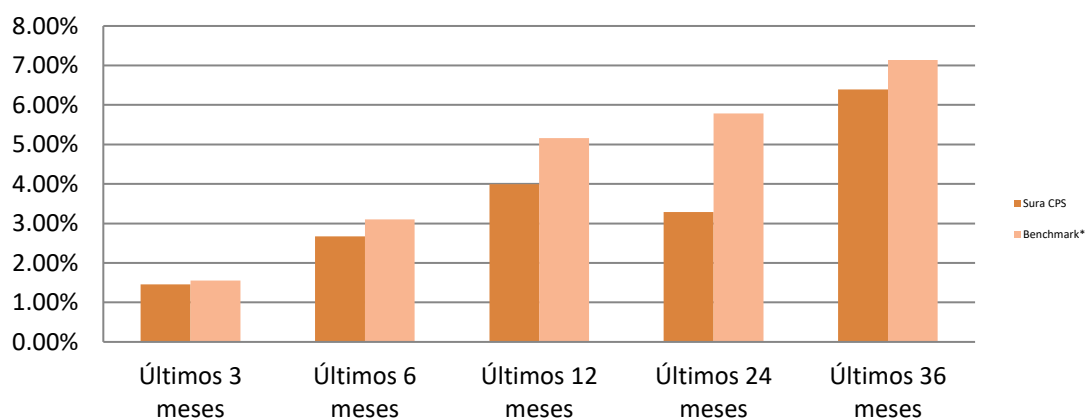
| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 11,753,818        | 22,426,673   | 981        |
| Feb-22 | 4,329,181         | 25,481,612   | 951        |
| Mar-22 | 9,438,231         | 10,363,118   | 931        |
| Abr-22 | 6,417,081         | 7,538,475    | 926        |
| May-22 | 7,859,845         | 67,425,263   | 913        |
| Jun-22 | 7,461,008         | 14,473,150   | 910        |
| Jul-22 | 8,930,637         | 70,844,297   | 908        |
| Ago-22 | 5,124,223         | 7,100,748    | 874        |
| Set-22 | 3,501,544         | 5,405,751    | 859        |
| Oct-22 | 2,932,402         | 4,945,942    | 845        |
| Nov-22 | 14,622,765        | 16,618,305   | 838        |
| Dic-22 | 4,558,068         | 21,670,784   | 827        |

### Rentabilidad de SURA Corto Plazo Soles vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura CPS | Benchmark* |
|------------------|----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 1.45%    | 1.56%      |
| Últimos 6 meses  | 2.68%    | 3.11%      |
| Últimos 12 meses | 3.99%    | 5.16%      |
| Últimos 24 meses | 3.29%    | 5.78%      |
| Últimos 36 meses | 6.40%    | 7.14%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional entre 181 y 360 días ofrecidas por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

### **Retorno Histórico Sura Corto Plazo Soles vs Benchmark**



A diciembre de 2022, SURA Corto Plazo Soles FMIV administró un patrimonio de S/181,420,234.00 soles. El retorno de “SURA Corto Plazo Soles FMIV” durante el 2022 fue de 3.99%.

Al cierre de año, el fondo presentó excesos de inversión pasivos por emisor en Ban Bif, Banco BBVA y Mibanco, ello debido a la reducción en el activo del fondo.

## SURA Corto Plazo Dólares FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución Directoral de Patrimonios Autónomos N° 060-2008-EF/94.06.2 de fecha 25 de noviembre de 2008, con el nombre de ING Renta Corto Plazo Dólares – FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Corto Plazo Dólares FMIV.

Mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N°123- 2021-SMV/10.2 de fecha 26 de noviembre de 2021, se da la última modificación al prospecto simplificado y al Anexo del Reglamento de Participación del fondo referido a: la política de inversiones, comisiones y gastos, medios y horarios de atención, otros aspectos particulares del fondo, rentabilidad histórica, entre otros.

### Objetivo de Inversión del Fondo

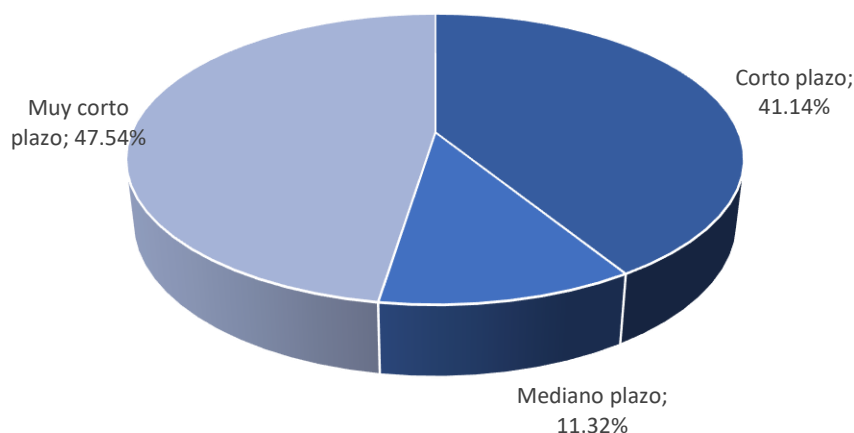
El Fondo tiene como objetivo ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda extranjera, a través de instrumentos representativos de deuda -principalmente de corto plazo- tanto en mercados locales como internacionales. Se busca maximizar la relación riesgo y retorno a través de un portafolio con una muy baja volatilidad y manteniendo niveles adecuados de liquidez en un horizonte de inversión de corto plazo.

### Política de Inversión del Fondo

La tipología del Fondo es de Instrumentos de Deuda de Corto Plazo. Las inversiones se realizan principalmente en instrumentos de corto plazo que cuenten con la mejor clasificación de riesgo crediticio o en instrumentos con riesgo soberano. La *duración* objetivo del portafolio es de 180 días, manteniéndose en todo momento en un rango que puede fluctuar entre 0 y 360 días.

La política conservadora del fondo conduce a invertir los recursos principalmente en activos clasificados en las categorías CP1+ a CP1- en el corto plazo y en las categorías AAA a AA- en el largo plazo.

### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Emisor

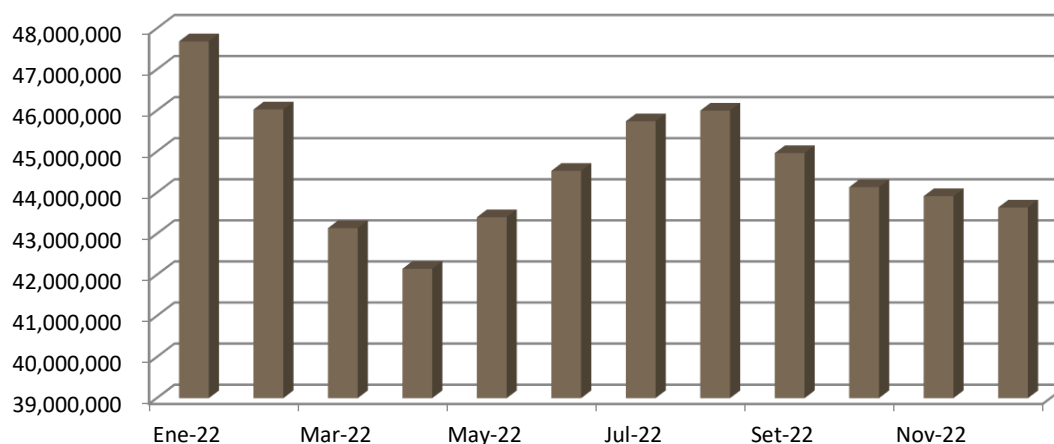
| EMISORES                         | %           |
|----------------------------------|-------------|
| BTG PACTUAL CHILE                | 15.19%      |
| ITAU CORPBANCA                   | 14.83%      |
| BANCO BBVA PERU                  | 12.39%      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA  | 11.69%      |
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS | 8.75%       |
| FI BD CAPITAL MONEY MARKET 2     | 5.94%       |
| BANCOLOMBIA S.A.                 | 4.22%       |
| OTROS                            | 26.99%      |
| <b>TOTAL</b>                     | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

### Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Corto Plazo Dólares 30/12/2022            |           |          |         |
|------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                             | 1.53      |          |         |
| Derivados                                                              | -         | Márgenes | Legales |
|                                                                        |           | Min      | Max     |
| Límite                                                                 | % Cartera |          |         |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio         | -         | Al 0     | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                        | 100.00    | Al 100   | Al 100  |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                    | -         | Al 0     | 40.00   |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                   | 11.15     | Al 0     | 38.85   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                      | 40.51     | Al 0     | 59.49   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                    | 40.97     | Al 0     | 59.03   |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda | 5.85      | Al 0     | 19.15   |
| Cuotas de Fondos Mutuos                                                | -         | Al 0     | 15.00   |
| Según Moneda (Posición Neta)                                           | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                  | 98.47     | 23.47    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                           | -         | Al 0     | 25.00   |
| Según Tipo de Mercado                                                  | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                           | 38.03     | Al 0     | 61.97   |
| Inversiones en mercado extranjero                                      | 60.45     | Al 0     | 39.55   |
| Según Clasificación de Riesgo de los Instrumentos de deuda             | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                            | -         |          |         |
| CP-1                                                                   | -         | Al 0     | Al 100  |
| CP-2 y CP-3                                                            | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                            | 7.42      |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                     | 5.85      | Al 0     | Al 100  |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                  | 1.57      | Al 0     | 48.43   |
| Menor a BBB-                                                           | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                  | 32.18     |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                      | 32.18     | Al 0     | Al 100  |
| Desde B hasta B-                                                       | -         | Al 0     | 50.00   |
| Menor a B-                                                             | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Internacional                                                  | 58.88     |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                        | -         | Al 0     | 100.00  |
| Corto Plazo: Menor a CP - 3                                            | -         | -        | -       |
| Largo Plazo: No menor a BB-                                            | 58.88     | Al 0     | 41.12   |
| Largo Plazo: Menor a BB-                                               | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                               | -         | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                 | -         | Al 0     | 50.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                 | -         |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                   | -         | Al 0     | Al 100  |
| Sintéticos Bonos y DPZ                                                 | -         | na       | na      |
| Sintéticos otros Instrumentos                                          | -         | na       | na      |
| Forwards a otras monedas                                               | -         | Al 0     | 25.00   |
| Swaps                                                                  | -         | Al 0     | 100.00  |
| DURACIÓN                                                               |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                 | 0.43      | 0.18     | 0.57    |

Patrimonio Administrado (US\$)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas     | Valor Cuota | US\$       |
|--------|------------|-------------|------------|
| Ene-22 | 386,046.95 | 123.522214  | 47,685,374 |
| Feb-22 | 372,926.07 | 123.425896  | 46,028,734 |
| Mar-22 | 349,393.83 | 123.467921  | 43,138,930 |
| Abr-22 | 341,212.74 | 123.528915  | 42,149,640 |
| May-22 | 351,115.10 | 123.619613  | 43,404,713 |
| Jun-22 | 359,931.20 | 123.729874  | 44,534,242 |
| Jul-22 | 369,234.23 | 123.875195  | 45,738,962 |
| Ago-22 | 370,751.19 | 124.069469  | 45,998,903 |
| Set-22 | 361,878.11 | 124.254960  | 44,965,150 |
| Oct-22 | 354,451.59 | 124.522359  | 44,137,148 |
| Nov-22 | 351,892.80 | 124.803269  | 43,917,372 |
| Dic-22 | 348,588.14 | 125.190313  | 43,639,859 |

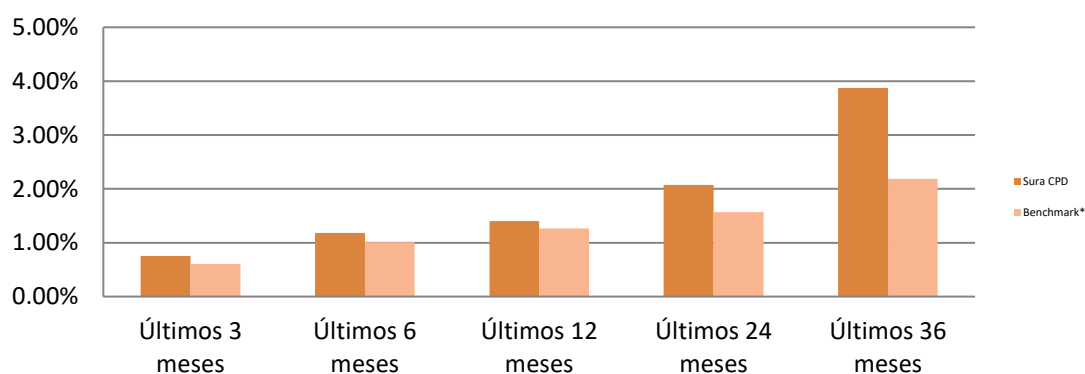
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 6,821,525          | 1,702,402     | 770        |
| Feb-22 | 2,732,424          | 4,350,780     | 762        |
| Mar-22 | 1,746,923          | 4,652,067     | 748        |
| Abr-22 | 1,730,436          | 2,740,826     | 758        |
| May-22 | 3,954,379          | 2,730,480     | 746        |
| Jun-22 | 4,699,832          | 3,609,938     | 749        |
| Jul-22 | 2,220,300          | 1,068,789     | 756        |
| Ago-22 | 4,449,351          | 4,262,844     | 753        |
| Set-22 | 1,332,083          | 2,434,348     | 735        |
| Oct-22 | 1,082,826          | 2,006,642     | 716        |
| Nov-22 | 1,827,121          | 2,146,926     | 713        |
| Dic-22 | 1,187,821          | 1,600,624     | 705        |

Rentabilidad de Corto Plazo Dólares vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura CPD | Benchmark* |
|------------------|----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 0.75%    | 0.60%      |
| Últimos 6 meses  | 1.18%    | 1.01%      |
| Últimos 12 meses | 1.40%    | 1.26%      |
| Últimos 24 meses | 2.07%    | 1.57%      |
| Últimos 36 meses | 3.87%    | 2.19%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera entre 181 y 360 días ofrecidas por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

**Retorno Histórico Sura Corto Plazo Dolares vs Benchmark**



A diciembre de 2022, “SURA Corto Plazo Dólares FMIV” administró un patrimonio de US\$43,639,859.00 y obtuvo un rendimiento de 1.40% en el año.

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos en la política de inversión.

---

### Fondo de Fondos SURA Acciones Norteamericanas FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 085-2013-SMV/10.2 de fecha 31 de julio de 2013, con el nombre de Sura Acciones Norteamericanas – FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 097-2017-SMV/10.2, de fecha 04 de julio de 2017, la SMV aprobó la modificación de la denominación del fondo mutuo de inversión en valores "Sura Acciones Norteamericanas FMIV" a "Fondo de Fondos Sura Acciones Norteamericanas FMIV".

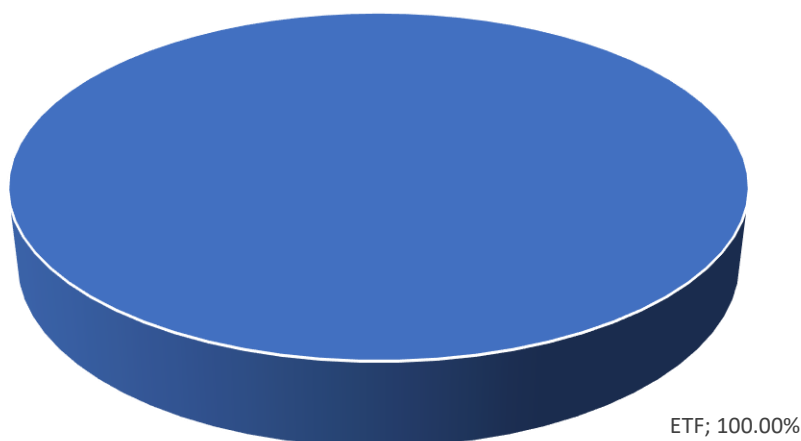
#### Objetivo de Inversión del Fondo

El fondo permite a los clientes obtener exposición a la rentabilidad del mercado norteamericano de renta variable, a través de fondos mutuos internacionales que inviertan directa o indirectamente (ETF, fondos mutuos u otros) en títulos representativos de derechos patrimoniales (acciones) de empresas predominantemente norteamericanas y principalmente en la moneda del valor cuota. Asimismo, se invierte en menor medida en instrumentos representativos de deuda, de preferencia con bajo riesgo relativo.

#### Política de Inversión del Fondo

El fondo mantiene un mínimo un 75% de su patrimonio en fondos mutuos internacionales que inviertan directa o indirectamente (ETF, fondos mutuos u otros) en títulos representativos de derechos patrimoniales de empresas predominantemente norteamericanas. Así mismo, se establece la posibilidad de invertir hasta un máximo de 25% en instrumentos representativos de deuda o pasivos

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES       | %           |
|----------------|-------------|
| VANGUARD GROUP | 100%        |
| <b>TOTAL</b>   | <b>100%</b> |

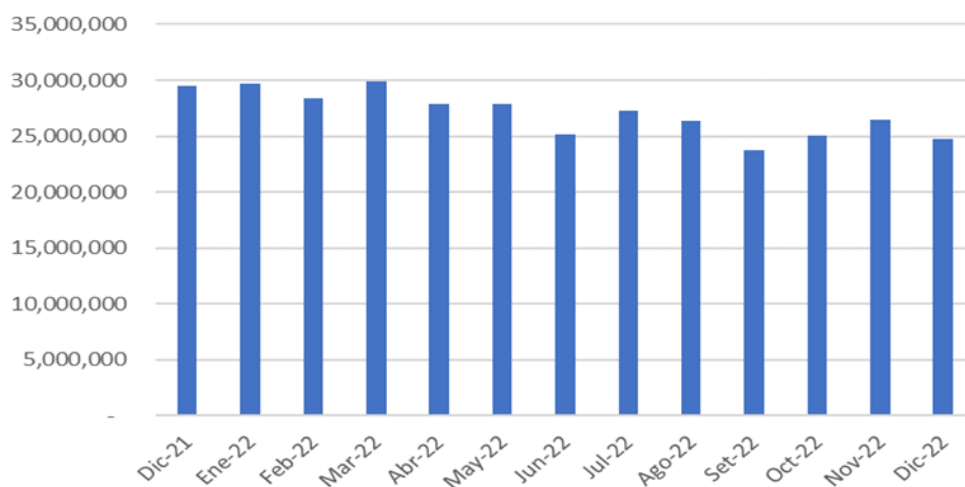
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - SURA Acciones Norteamericanas 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 0.79          | Márgenes     | Legales       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|---------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera     | Min          | Max           |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | <b>100.00</b> | <b>25.00</b> | <b>Al 100</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 99.21         | 24.21        | Al 100        |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | -             | Al 0         | 25.00         |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00         |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                                                    | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 99.21         | 24.21        | Al 100        |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                                                                                                            | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Origen Mercado</b>                                                                                                                                                                 | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Mercado Local                                                                                                                                                                         | -             | Al 0         | 50.00         |
| Mercado Extranjero                                                                                                                                                                    | 99.21         | 49.21        | Al 100        |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | -             | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | -             | na           | na            |
| CP - 1 - CP-1-                                                                                                                                                                        | -             | Al 0         | 25.00         |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | -             | na           | na            |
| Desde AAA hasta AA-                                                                                                                                                                   | -             | Al 0         | -             |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -             | Al 0         | -             |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | -             | na           | na            |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -             | Al 0         | 25.00         |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | -             | na           | na            |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3 (BBB)                                                                                                                                                  | -             | Al 0         | 25.00         |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -             | Al 0         | -             |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)                                                                                                                                              | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | -             | Al 0         | -             |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | -             | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -             | Al 0         | Al 100        |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -             | Al 0         | 25.00         |

## Patrimonio Administrado (US\$)



## Evolución del patrimonio

| Mes    | Cuotas    | Valor Cuota | Patrimonio (US\$) |
|--------|-----------|-------------|-------------------|
| Dic-21 | 1,276,321 | 23.13       | 29,517,366        |
| Ene-22 | 1,354,027 | 21.96       | 29,731,956        |
| Feb-22 | 1,328,836 | 21.35       | 28,369,328        |
| Mar-22 | 1,353,674 | 22.07       | 29,873,290        |
| Abr-22 | 1,385,338 | 20.12       | 27,878,007        |
| May-22 | 1,381,904 | 20.16       | 27,853,618        |
| Jun-22 | 1,370,112 | 18.40       | 25,204,477        |
| Jul-22 | 1,356,201 | 20.11       | 27,271,562        |
| Ago-22 | 1,367,664 | 19.26       | 26,336,864        |
| Set-22 | 1,363,221 | 17.40       | 23,716,051        |
| Oct-22 | 1,330,980 | 18.84       | 25,073,487        |
| Nov-22 | 1,335,063 | 19.84       | 26,493,273        |
| Dic-22 | 1,325,247 | 18.66       | 24,725,142        |

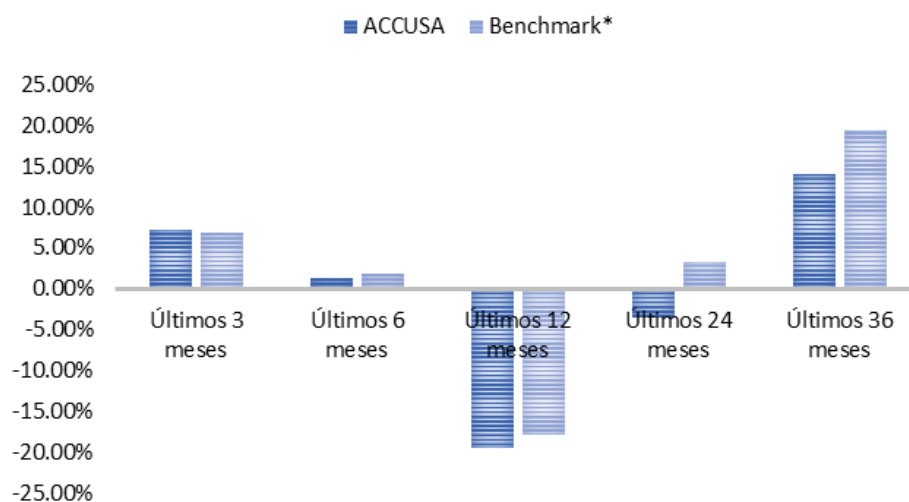
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 3,200,052          | 1,467,357     | 1111       |
| Feb-22 | 1,245,770          | 1,747,725     | 1125       |
| Mar-22 | 1,467,954          | 906,251       | 1134       |
| Abr-22 | 1,091,082          | 407,189       | 1157       |
| May-22 | 805,805            | 856,196       | 1163       |
| Jun-22 | 409,318            | 618,939       | 1162       |
| Jul-22 | 225,153            | 481,090       | 1144       |
| Ago-22 | 524,175            | 291,890       | 1143       |
| Set-22 | 338,102            | 409,668       | 1133       |
| Oct-22 | 271,258            | 853,662       | 1101       |
| Nov-22 | 356,599            | 271,757       | 1092       |
| Dic-22 | 123,811            | 311,038       | 1073       |

Rentabilidad de Fondo de Fondos SURA Acciones Norteamericanas FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | ACCUSA  | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | 7.24%   | 6.83%      |
| Últimos 6 meses  | 1.42%   | 1.88%      |
| Últimos 12 meses | -19.33% | -17.77%    |
| Últimos 24 meses | -3.53%  | 3.29%      |
| Últimos 36 meses | 13.96%  | 19.43%     |

\* Ishares IVV US ETF a partir del 26/06/2017.

## RETORNO HISTÓRICO SURA ACCIONES NORTEAMERICANAS VS BENCHMARK



\* IVV US: ETF incorporado en los Estados Unidos que replica el rendimiento del Índice S&P 500, el cual se encuentra ponderado por las capitalizaciones de 500 acciones representativas.

A diciembre de 2022, “Fondo de Fondos SURA Acciones Norteamericanas FMIV” administró un patrimonio de US\$ 24,725,142, obteniendo un rendimiento de -19.33% lo cual estuvo ligeramente por debajo del retorno del benchmark (-17.77%) en el mismo periodo.

Asimismo, al cierre del año 2022 el fondo no tuvo exceso de inversión.

---

### Fondo de Fondos SURA Acciones Europeas FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 028-2014-SMV/10.2 de fecha 15 de mayo de 2014, con el nombre de SURA Acciones Europeas – FMIV y mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 097-2017-SMV/10.2, de fecha 04 de julio de 2017, la SMV aprobó la modificación de la denominación del fondo mutuo de inversión en valores "Sura Acciones Europeas FMIV" a "Fondo de Fondos Sura Acciones Europeas FMIV".

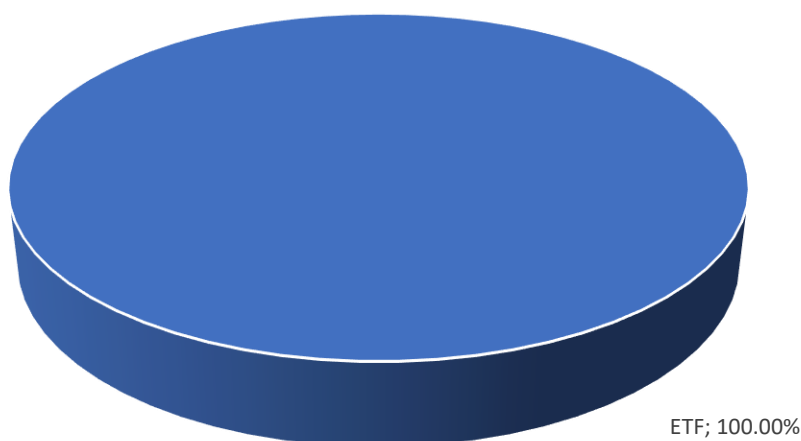
#### Objetivo de Inversión del Fondo

El fondo permite a los clientes obtener exposición a la rentabilidad del mercado europeo de renta variable, a través de fondos mutuos internacionales expresados que inviertan directa o indirectamente (ETF, fondos mutuos u otros) en títulos representativos de derechos patrimoniales (acciones) de empresas predominantemente europeas y principalmente en moneda del valor cuota. Asimismo, se invierte en menor medida en instrumentos representativos de deuda, de preferencia con bajo riesgo relativo.

#### Política de Inversión del Fondo

El fondo mantiene un mínimo un 75% de su patrimonio en fondos mutuos internacionales que inviertan directa o indirectamente (ETF, fondos mutuos u otros) en títulos representativos de derechos patrimoniales de empresas predominantemente europeas. Así mismo, se establece la posibilidad de invertir hasta un máximo de 25% en instrumentos representativos de deuda o pasivos.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES       | %           |
|----------------|-------------|
| BLACK ROCK     | 50.22%      |
| VANGUARD GROUP | 49.78%      |
| <b>TOTAL</b>   | <b>100%</b> |

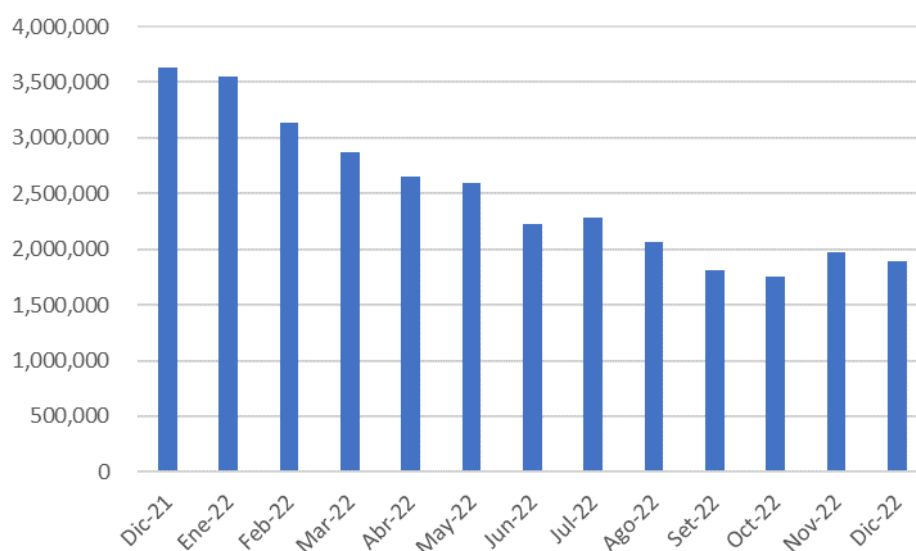
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - SURA Acciones Europeas 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 0.87      | Márgenes | Legales |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio                                                                                                                        | 99.13     | 24.13    | Al 100  |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 99.13     | 24.13    | Al 100  |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                                                                                                                                       | -         | Al 0     | 25.00   |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                                                                                                      | -         | Al 0     | 25.00   |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                                                    | -         | Al 0     | 25.00   |
| Límite por Moneda                                                                                                                                                                     | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 99.13     | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                                                                                                            | -         | Al 0     | Al 100  |
| Origen Mercado                                                                                                                                                                        | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local                                                                                                                                                                         | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Extranjero                                                                                                                                                                    | 99.13     | 49.13    | Al 100  |
| Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda                                                                                                                        | -         | na       | na      |
| Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo                                                                                                                                            | -         | na       | na      |
| CP - 1 - CP-1-                                                                                                                                                                        | -         | Al 0     | 25.00   |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -         | Al 0     | 25.00   |
| Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo                                                                                                                                            | -         | na       | na      |
| Desde AAA hasta AA-                                                                                                                                                                   | -         | Al 0     | -       |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Local: Entidades Financieras                                                                                                                                                  | -         | na       | na      |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -         | Al 0     | 25.00   |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -         | Al 0     | 25.00   |
| Mercado Internacional                                                                                                                                                                 | -         | na       | na      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3 (BBB)                                                                                                                                                  | -         | Al 0     | 25.00   |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)                                                                                                                                              | -         | Al 0     | 25.00   |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                                                                                                                | -         | Al 0     | -       |
| Instrumentos Derivados                                                                                                                                                                | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -         | Al 0     | 100.00  |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -         | Al 0     | 100.00  |

## Patrimonio Administrado (US\$)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas     | Valor Cuota | Patrimonio US\$ |
|--------|------------|-------------|-----------------|
| Ene-22 | 300,703.92 | 11.80       | 3,548,241       |
| Feb-22 | 279,502.48 | 11.23       | 3,139,230       |
| Mar-22 | 253,873.17 | 11.31       | 2,870,125       |
| Abr-22 | 249,968.72 | 10.59       | 2,647,651       |
| May-22 | 239,848.46 | 10.84       | 2,600,721       |
| Jun-22 | 229,029.25 | 9.73        | 2,227,659       |
| Jul-22 | 224,708.58 | 10.18       | 2,287,927       |
| Ago-22 | 219,470.31 | 9.43        | 2,068,999       |
| Set-22 | 212,802.61 | 8.52        | 1,813,848       |
| Oct-22 | 190,388.16 | 9.22        | 1,754,548       |
| Nov-22 | 189,179.17 | 9.12        | 1,973,884       |
| Dic-22 | 184,874.80 | 9.12        | 1,887,717       |

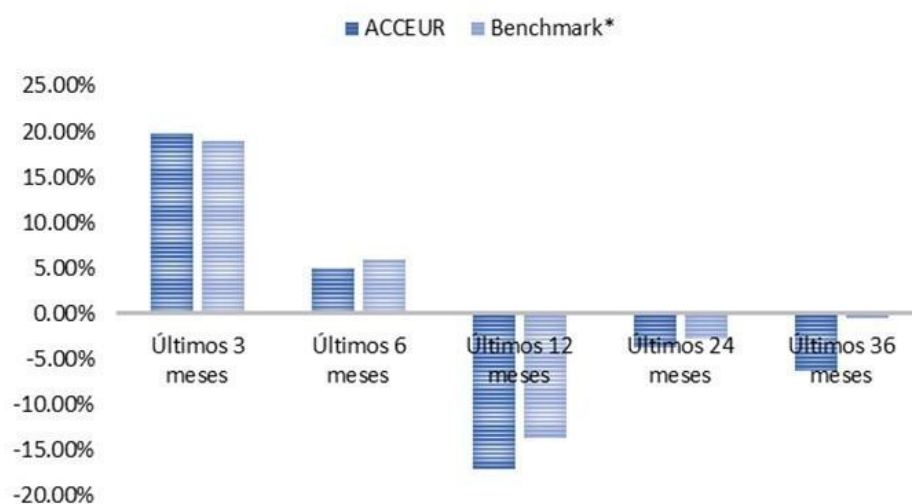
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 213,096            | 143,331       | 274        |
| Feb-22 | 91,589             | 333,036       | 262        |
| Mar-22 | 25,100             | 298,170       | 246        |
| Abr-22 | 20,537             | 62,928        | 243        |
| May-22 | 31,599             | 138,426       | 237        |
| Jun-22 | 11,300             | 119,727       | 231        |
| Jul-22 | 1,000              | 42,361        | 226        |
| Ago-22 | -                  | 53,214        | 219        |
| Set-22 | 2,380              | 60,670        | 212        |
| Oct-22 | 2,460              | 200,415       | 198        |
| Nov-22 | 700                | 12,945        | 195        |
| Dic-22 | -                  | 44,758        | 189        |

Rentabilidad de Fondo de Fondos SURA Acciones Europeas FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | ACCEUR  | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | 19.79%  | 18.94%     |
| Últimos 6 meses  | 4.98%   | 5.86%      |
| Últimos 12 meses | -17.05% | -13.76%    |
| Últimos 24 meses | -3.66%  | -2.68%     |
| Últimos 36 meses | -6.29%  | -0.49%     |

\*Ishares IEV US ETF a partir del 26/06/2017.

## RETORNO HISTÓRICO SURA ACCIONES EUROPEAS VS BENCHMARK



A diciembre de 2022, “SURA Acciones Europeas FMIV” administró un patrimonio de US\$1, , obteniendo un rendimiento de -17.05%, por debajo del retorno que tuvo el benchmark en ese mismo periodo (-13.76%).

Asimismo, al cierre del año el fondo no tuvo exceso de inversión.

---

### Fondo de Fondos SURA Acciones Mercados Emergentes FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 085-2013-SMV/10.2 de fecha 31 de julio de 2013, con el nombre de SURA Acciones de Mercados Emergentes – FMIV y mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 097-2017-SMV/10.2, de fecha 04 de julio de 2017, la SMV aprobó la modificación de la denominación del fondo mutuo de inversión en valores "Sura Acciones Mercados Emergente FMIV" a "Fondo de Fondos Sura Acciones Mercados Emergente FMIV".

#### Objetivo de Inversión del Fondo

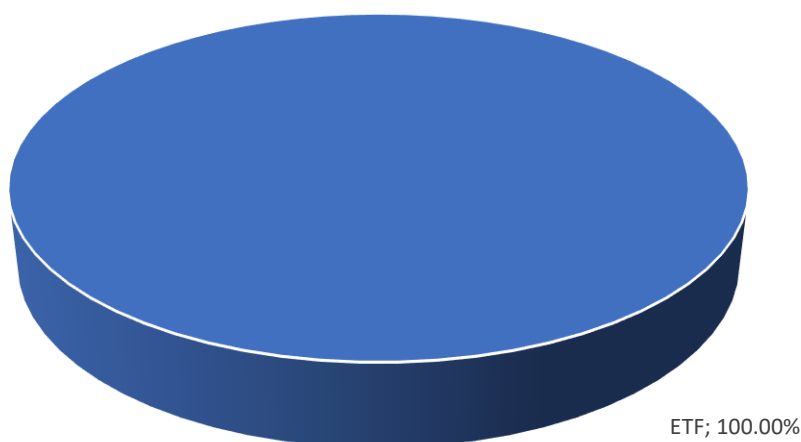
El fondo permite a los clientes obtener exposición a la rentabilidad del mercado emergente de renta variable. El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 95% por la evolución del iShares MSCI Emerging Market ETF y en un 5% por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

#### Política de Inversión del Fondo

El Fondo de Fondos SURA Acciones de Mercados Emergentes FMIV invierte como mínimo el 75% del patrimonio en cuotas de participación de fondos administrados por la misma sociedad administradora y/o por otras administradoras y/o ETF's; predominantemente en fondos representativos de instrumentos de participación en el patrimonio. Asimismo, el Fondo invertirá entre el 0% y 25% restante del patrimonio en instrumentos representativos de deuda, con preferencia por instrumentos de bajo riesgo relativo con un vencimiento no mayor a 1 año.

El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, así como en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 14/09/2022

\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES       | %           |
|----------------|-------------|
| BLACK ROCK     | 49.74%      |
| VANGUARD GROUP | 50.26%      |
| <b>TOTAL</b>   | <b>100%</b> |

Nota: Información al 14/09/2022

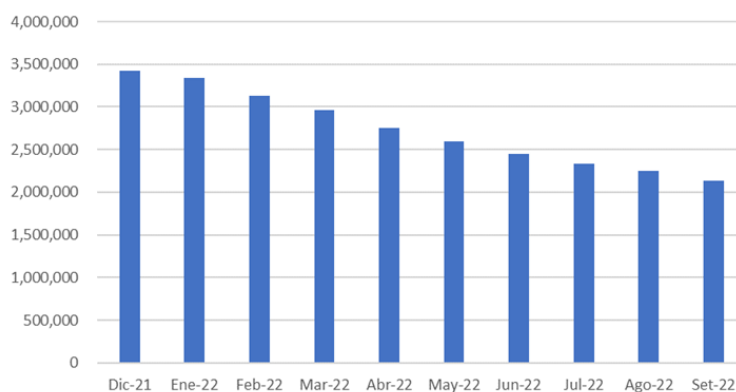
\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Acciones de Mercados Emergentes 14/09/2022                                                                                                               |           |          |         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 0.94      | Márgenes | Legales |
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera | Min      | Max     |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | 99.06     | 24.06    | AI 100  |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 99.06     | 24.06    | AI 100  |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | -         | AI 0     | 25.00   |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                                                                                                      | -         | AI 0     | 25.00   |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                                                    | -         | AI 0     | 25.00   |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 99.06     | AI 0     | AI 100  |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                                                                                                            | -         | AI 0     | AI 100  |
| <b>Origen Mercado</b>                                                                                                                                                                 | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local                                                                                                                                                                         | -         | AI 0     | 50.00   |
| Mercado Extranjero                                                                                                                                                                    | 99.06     | 49.06    | AI 100  |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | -         | na       | na      |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | -         | na       | na      |
| CP - 1 - CP-1-                                                                                                                                                                        | -         | AI 0     | 25.00   |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -         | AI 0     | 25.00   |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | -         | na       | na      |
| Desde AAA hasta AA-                                                                                                                                                                   | -         | AI 0     | -       |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -         | AI 0     | -       |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | -         | na       | na      |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -         | AI 0     | 25.00   |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -         | AI 0     | 25.00   |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | -         | na       | na      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3 (BBB)                                                                                                                                                  | -         | AI 0     | 25.00   |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -         | AI 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)                                                                                                                                              | -         | AI 0     | 25.00   |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | -         | AI 0     | -       |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -         | AI 0     | AI 100  |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -         | AI 0     | 25.00   |

\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

## Patrimonio Administrado (US\$)



\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas  | Valor Cuota | Patrimonio (US\$) |
|--------|---------|-------------|-------------------|
| Ene-22 | 289,751 | 11.53       | 3,339,694         |
| Feb-22 | 282,381 | 11.08       | 3,128,348         |
| Mar-22 | 276,320 | 10.73       | 2,964,099         |
| Abr-22 | 273,013 | 10.08       | 2,750,728         |
| May-22 | 256,160 | 10.12       | 2,591,397         |
| Jun-22 | 254,584 | 9.63        | 2,450,553         |
| Jul-22 | 244,012 | 9.55        | 2,330,792         |
| Ago-22 | 238,289 | 9.45        | 2,251,404         |

\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Participes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 45,093             | 30,839        | 245        |
| Feb-22 | 9,705              | 95,200        | 240        |
| Mar-22 | 27,329             | 89,635        | 233        |
| Abr-22 | 4,621              | 39,462        | 229        |
| May-22 | 3,749              | 167,704       | 227        |
| Jun-22 | 7,500              | 22,635        | 225        |
| Jul-22 | 5,755              | 104,351       | 221        |
| Ago-22 | 8,500              | 64,286        | 217        |
| Set-22 | -                  | 149,050       | 212        |

\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

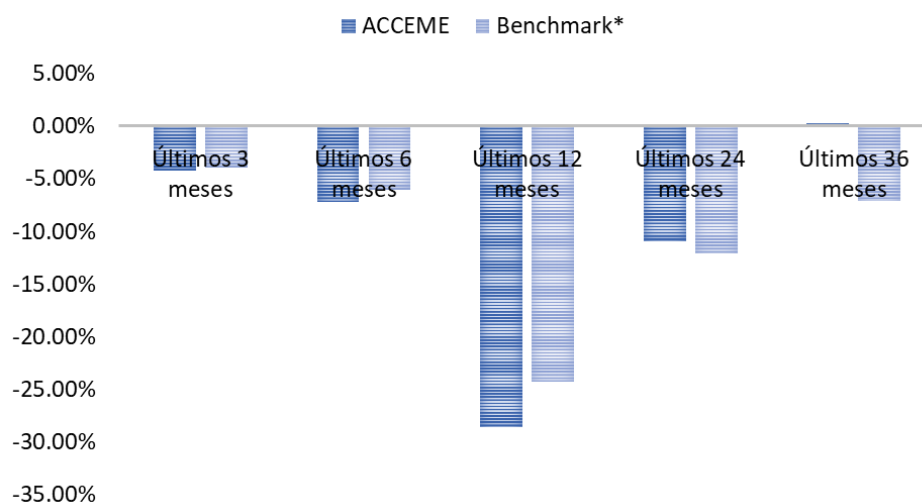
Rentabilidad de Fondo de Fondos SURA Acciones Mercados Emergentes FMIV vs. Benchmark

| al 14/09/2022    | ACCEME  | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | -4.25%  | -3.96%     |
| Últimos 6 meses  | -7.25%  | -6.02%     |
| Últimos 12 meses | -28.56% | -24.30%    |
| Últimos 24 meses | -10.94% | -12.11%    |
| Últimos 36 meses | 0.24%   | -7.08%     |

\*Ishares EEM US ETF a partir del 26/06/2017.

\*El fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

### RETORNO HISTÓRICO SURA EMERGENTES VS BENCHMARK



A 14 de septiembre de 2022, “Fondo de Fondos SURA Acciones Mercados Emergentes FMIV” administró un patrimonio de USD 2,139,254, obteniendo un retorno de -21.97% en el año, mientras que el benchmark obtuvo un rendimiento de -19.41% en el mismo periodo.

Asimismo, el fondo fue absorbido por el Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV el 16/09/2022.

---

## SURA Ultra Cash Soles FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 002-2011-SMV/10.2 de fecha 19 de diciembre de 2011, con el nombre de ING Renta Cash Soles – FMIV; mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Ultra Cash Soles – FMIV, y; mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 088-2017-SMV/10.2 de fecha 16 de junio de 2017 se modifica la comisión del Fondo Mutuo.

Mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 036-2021-SMV/10.2, de fecha 17 de marzo de 2021, se realiza la última modificación al prospecto simplificado y anexo del reglamento de participación del fondo, referidas a la sub clasificación del fondo, objetivo de inversión, política de inversiones, indicador de comparación de rendimientos, gastos a cargo del fondo, medios y horario de atención y otros aspectos particulares del fondo.

### Objetivo de Inversión del Fondo

El Fondo tiene como objetivo ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda local, a través de instrumentos representativos de deuda -principalmente de muy corto plazo-, emitidos tanto en mercados locales como internacionales. Se busca maximizar la relación riesgo y retorno a través de un portafolio con una muy baja volatilidad y manteniendo niveles adecuados de liquidez en un horizonte de inversión de muy corto plazo.

### Política de Inversión del Fondo

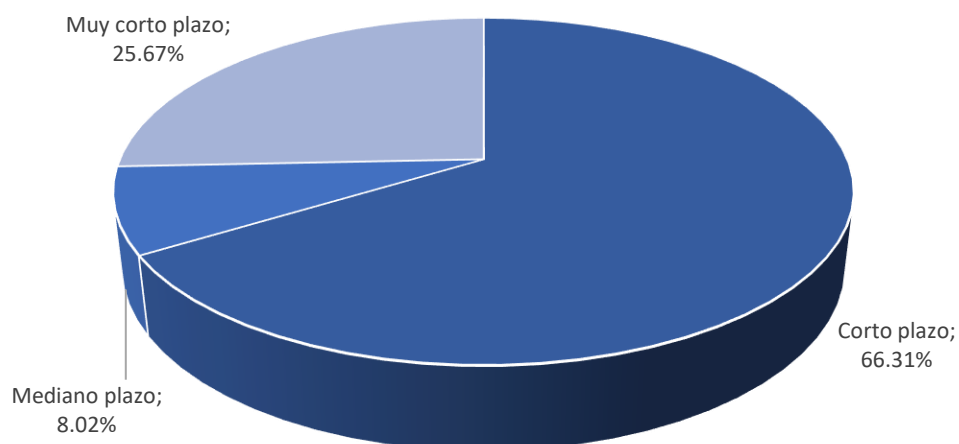
El 18 de marzo 2021, se realizó cambios en la tipología del Fondo, el cuál pasó a ser de Corto Plazo. El portafolio invierte únicamente en instrumentos representativos de deuda, principalmente de corto plazo y muy corto plazo denominados en soles, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú o en el extranjero. La duración promedio del portafolio de instrumentos representativos de deuda se encontrará entre 90 y 180 días como máximo.

La política conservadora del fondo conduce a invertir los recursos principalmente en activos clasificados en las categorías CP1+ a CP1- en el corto plazo y en las categorías AAA a AA- en el largo plazo, con una duración promedio del portafolio no menor a 90 días y no mayor a 180 días.

### Indicador de Comparación de Rendimientos

El indicador de comparación de rendimientos está compuesto por el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional de 0 a 30 días en un 40% y de 91 a 180 días en un 60%, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

Inversiones del Fondo por Instrumento



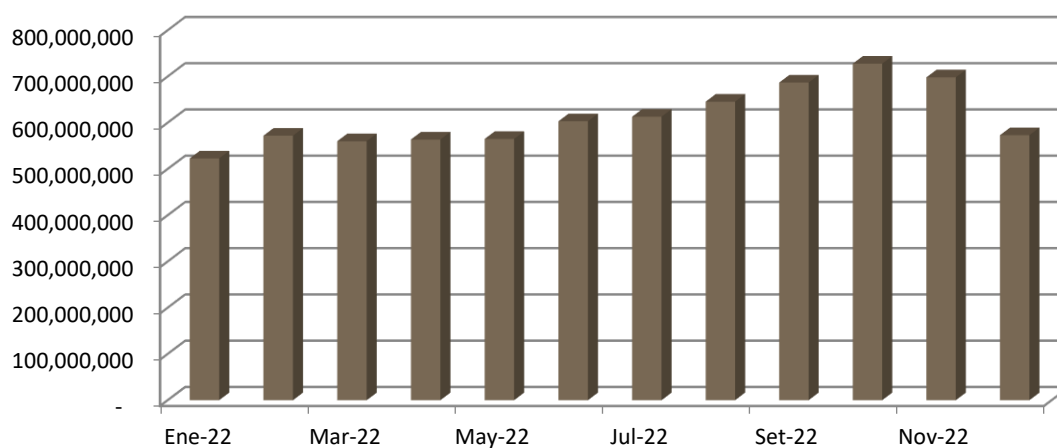
Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                | %           |
|-----------------------------------------|-------------|
| SCOTIABANK DEL PERÚ                     | 15.71%      |
| BANCO DE CREDITO DEL PERU               | 12.69%      |
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS        | 12.16%      |
| BANCO GNB DEL PERÚ                      | 11.92%      |
| BANCO BBVA PERU                         | 11.13%      |
| MIBANCO - BANCO DE LA MICROEMPRESA S.A. | 7.96%       |
| BANCO SANTANDER PERU S.A.               | 6.19%       |
| OTROS                                   | 22.24%      |
| <b>TOTAL</b>                            | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (S/.)



## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Ultra Cash Soles 30/12/2022                                         |           |          |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                                                       | 0.96      |          |         |
| Derivados                                                                                        | - 0.11    | Márgenes | Legales |
| Límite                                                                                           | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio                                   | -         | Al 0     | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                                                  | 100.00    | na       | na      |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                              | -         | Al 0     | -       |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                             | 7.94      | Al 0     | 22.06   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                | 63.11     | Al 0     | 36.89   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                              | 25.43     | Al 0     | 74.57   |
| Cuotas de Fondos de Inversión de instrumentos representativos de deuda y Cuotas de Fondos Mutuos | 2.67      | na       | na      |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda                           | 2.67      | na       | 17.33   |
| Cuotas de Fondos Mutuos                                                                          | -         | na       | 10.00   |
| Según Moneda (Posición Neta)                                                                     | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                                            | 99.02     | 24.02    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                                                     | 0.02      | Al 0     | 24.98   |
| Según Tipo de Mercado                                                                            | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                                                     | 99.04     | Al 0     | 0.96    |
| Inversiones en mercado extranjero                                                                | -         | Al 0     | 100.00  |
| Según Clasificación de Riesgo de los instrumentos de deuda                                       | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                                                      | -         |          |         |
| CP-1                                                                                             | -         | Al 0     | Al 100  |
| CP-2 y CP-3                                                                                      | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                                                      | 2.67      |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                                               | 2.67      | Al 0     | 97.33   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                            | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                                            | 95.34     |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                                                | 95.34     | Al 0     | 4.66    |
| Desde B hasta B-                                                                                 | -         | Al 0     | 50.00   |
| Menor a B-                                                                                       | -         | Al 0     | -       |
| Mercado Internacional                                                                            | 1.14      |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                                  | 1.14      | Al 0     | 98.87   |
| Corto Plazo: Menor a CP - 3                                                                      | -         | -        | -       |
| Largo Plazo: No menor a BB-                                                                      | -         | Al 0     | 100.00  |
| Largo Plazo: Menor a BB-                                                                         | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                                                         | -         | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                           | -         | Al 0     | 20.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                                           | 2.54      |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                             | 2.54      | Al 0     | Al 100  |
| Forwards a otras monedas                                                                         | -         | Al 0     | 25.00   |
| Swaps                                                                                            |           | na       | na      |
| DURACIÓN                                                                                         |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                                           | 0.49      | 0.243    | 0.01    |

Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas       | Valor Cuota | PEN         |
|--------|--------------|-------------|-------------|
| Ene-22 | 3,795,458.45 | 137.762293  | 522,871,057 |
| Feb-22 | 4,146,438.38 | 137.963590  | 572,057,525 |
| Mar-22 | 4,048,666.60 | 138.326396  | 560,037,459 |
| Abr-22 | 4,063,645.67 | 138.728177  | 563,742,154 |
| May-22 | 4,058,708.64 | 139.215334  | 565,034,478 |
| Jun-22 | 4,315,979.50 | 139.758268  | 603,193,820 |
| Jul-22 | 4,367,771.57 | 140.359604  | 613,058,687 |
| Ago-22 | 4,578,036.08 | 141.034033  | 645,658,890 |
| Set-22 | 4,847,367.72 | 141.729140  | 687,013,258 |
| Oct-22 | 5,108,146.96 | 142.475652  | 727,786,570 |
| Nov-22 | 4,874,385.79 | 143.242181  | 698,217,653 |
| Dic-22 | 3,980,015.61 | 144.003881  | 573,137,696 |

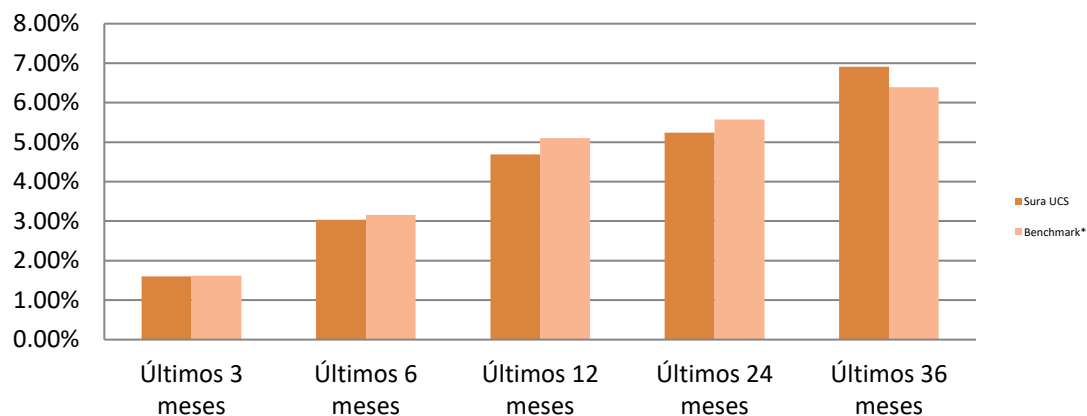
| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 92,727,381        | 118,605,016  | 1516       |
| Feb-22 | 160,576,103       | 112,218,466  | 1533       |
| Mar-22 | 151,727,160       | 165,181,753  | 1535       |
| Abr-22 | 125,089,858       | 123,011,848  | 1556       |
| May-22 | 117,374,441       | 118,085,744  | 1560       |
| Jun-22 | 108,814,799       | 72,869,439   | 1574       |
| Jul-22 | 116,817,279       | 109,528,137  | 1673       |
| Ago-22 | 128,037,754       | 98,478,132   | 1732       |
| Set-22 | 137,028,431       | 98,818,797   | 1809       |
| Oct-22 | 120,791,015       | 83,642,973   | 1869       |
| Nov-22 | 90,784,201        | 124,146,107  | 1922       |
| Dic-22 | 72,466,792        | 201,055,036  | 1948       |

Rentabilidad de SURA Ultra Cash Soles vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura UCS | Benchmark* |
|------------------|----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 1.60%    | 1.62%      |
| Últimos 6 meses  | 3.04%    | 3.15%      |
| Últimos 12 meses | 4.69%    | 5.10%      |
| Últimos 24 meses | 5.24%    | 5.57%      |
| Últimos 36 meses | 6.91%    | 6.39%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional hasta 30 días ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

### Retorno Histórico Sura Ultra Cash Soles vs Benchmark



A diciembre de 2022, SURA Ultra Cash Soles FMIV administró un patrimonio de S/ 573,137,696.00 soles. El retorno de “SURA Ultra Cash Soles FMIV” durante el 2022 fue de 4.69%.

Al cierre de año, en el fondo “SURA Ultra Cash Soles FMIV” se presentó un exceso de inversión pasivo en el emisor Scotiabank.

---

## SURA Ultra Cash Dólares FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 002-2011-SMV/10.2 de fecha 19 de diciembre de 2011, con el nombre de ING Renta Cash Soles – FMIV, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 014-2012-SMV/10.2 de fecha 17 de febrero de 2012 se modifica la denominación del Fondo Mutuo a Sura Ultra Cash Soles – FMIV.

Mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 037-2021-SMV/10.2, de fecha 17 de marzo de 2021, se realiza la última modificación al prospecto simplificado y anexo del reglamento de participación del fondo, referidas a la sub clasificación del fondo, objetivo de inversión, política de inversiones, indicador de comparación de rendimientos, gastos a cargo del fondo, medios y horario de atención y otros aspectos particulares del fondo.

### Objetivo de Inversión del Fondo

El Fondo tiene como objetivo ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en moneda extranjera, a través de instrumentos representativos de deuda -principalmente de muy corto plazo- tanto en mercados locales como internacionales. Se busca maximizar la relación riesgo y retorno a través de un portafolio con una muy baja volatilidad y manteniendo niveles adecuados de liquidez en un horizonte de inversión de muy corto plazo.

### Política de Inversión del Fondo

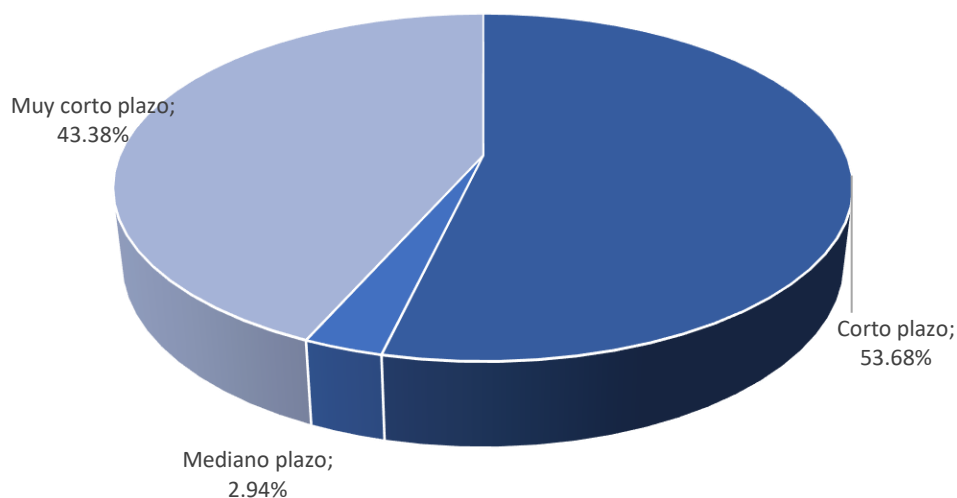
El 18 de marzo 2021, se realizó cambios en la tipología del Fondo, el cuál pasó de Muy Corto Plazo a ser de Corto Plazo. El portafolio invierte únicamente en instrumentos representativos de deuda, principalmente de corto plazo y muy corto plazo denominados en soles, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú o en el extranjero. La duración promedio del portafolio de instrumentos representativos de deuda se encontrará entre 90 y 180 días como máximo.

La política conservadora del fondo conduce a invertir los recursos principalmente en activos clasificados en las categorías CP1+ a CP1- en el corto plazo y en las categorías AAA a AA- en el largo plazo, con una duración promedio del portafolio no menor a 90 días y no mayor a 180 días.

### Indicador de Comparación de Rendimientos

El indicador de comparación de rendimientos está compuesto por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días en un 40% y de 91 a 180 días en un 60%, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota:

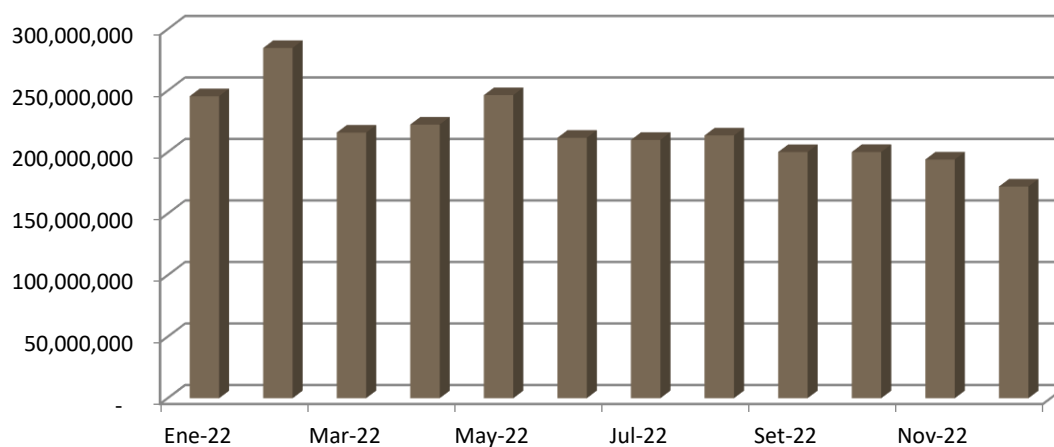
Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                         | %           |
|----------------------------------|-------------|
| ITAU CORPBANCA                   | 17.03%      |
| BTG PACTUAL CHILE                | 16.60%      |
| BANCO BBVA PERU                  | 14.46%      |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA  | 12.55%      |
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS | 7.82%       |
| BANCOLOMBIA PUERTO RICO          | 7.23%       |
| FI BD CAPITAL MONEY MARKET 2     | 6.38%       |
| OTROS                            | 17.93%      |
| <b>TOTAL</b>                     | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (US\$)



## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - SURA Ultra Cash Dólares 30/12/2022               |           |          |         |
|--------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                               | 1.22      |          |         |
| Derivados                                                                | -         | Márgenes | Legales |
| Límite                                                                   | % Cartera | Min      | Max     |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio           | 0.00      | Al 0     | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                          | 100.00    | na       | na      |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                      | 0.00      | Al 0     | -       |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                     | 2.91      | Al 0     | 27.09   |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                        | 49.39     | Al 0     | 50.61   |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                      | 40.18     | Al 0     | 59.82   |
| Cuotas de Fondos de Inversión de instrumentos representativos de deuda y | 6.30      | na       | na      |
| Cuotas de Fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda   | 6.30      | na       | 13.70   |
| Cuotas de Fondos Mutuos                                                  | 0.00      | na       | 10.00   |
| Según Moneda (Posición Neta)                                             | 100.00    |          |         |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                    | 98.78     | 23.78    | Al 100  |
| Inversiones en otras monedas                                             | -         | Al 0     | 25.00   |
| Según Tipo de Mercado                                                    | 100.00    |          |         |
| Inversiones en mercado local                                             | 40.05     | 40.05    | 100.00  |
| Inversiones en mercado extranjero                                        | 58.73     | Al 0     | 41.27   |
| Según Clasificación de Riesgo de los instrumentos de deuda               | 100.00    |          |         |
| Mercado Local - Instrumentos de corto plazo                              | 0.00      |          |         |
| CP-1                                                                     | 0.00      | Al 0     | Al 100  |
| CP-2 y CP-3                                                              | 0.00      | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local - Instrumentos de largo plazo                              | 6.50      |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                       | 6.30      | Al 0     | 93.70   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                    | 0.20      | Al 0     | 49.80   |
| Mercado Local - Entidades Financieras                                    | 33.75     |          |         |
| Desde A+ hasta B+                                                        | 33.75     | Al 0     | Al 100  |
| Desde B hasta B-                                                         | 0.00      | Al 0     | 50.00   |
| Menor a B-                                                               | 0.00      | Al 0     | -       |
| Mercado Internacional                                                    | 58.53     |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                          | 0.00      | Al 0     | 100.00  |
| Corto Plazo: Menor a CP - 3                                              | 0.00      | -        | -       |
| Largo Plazo: No menor a BB-                                              | 58.53     | Al 0     | 41.47   |
| Largo Plazo: Menor a BB-                                                 | 0.00      | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)                                 | 0.00      | Al 0     | Al 100  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                   | 0.00      | Al 0     | 20.00   |
| INSTRUMENTOS DERIVADOS                                                   | 0.00      |          |         |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                     | -         | -        | Al 100  |
| Sintéticos Bonos y DPZ                                                   | -         | na       | na      |
| Sintéticos otros Instrumentos                                            | -         | na       | na      |
| Forwards a otras monedas                                                 | -         | -        | 25.00   |
| Swaps                                                                    |           | -        | Al 100  |
| DURACIÓN                                                                 |           |          |         |
| Duración de la cartera                                                   | 0.382     | 0.13230  | 0.12    |

## Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas       | Valor Cuota | US\$        |
|--------|--------------|-------------|-------------|
| Ene-22 | 2,206,745.94 | 111.264726  | 245,532,983 |
| Feb-22 | 2,558,871.67 | 111.281578  | 284,755,278 |
| Mar-22 | 1,939,795.52 | 111.319906  | 215,937,855 |
| Abr-22 | 1,997,523.96 | 111.379870  | 222,483,959 |
| May-22 | 2,211,030.10 | 111.451782  | 246,423,246 |
| Jun-22 | 1,898,378.77 | 111.544533  | 211,753,773 |
| Jul-22 | 1,880,344.29 | 111.681865  | 210,000,357 |
| Ago-22 | 1,910,121.56 | 111.853236  | 213,653,277 |
| Set-22 | 1,786,101.80 | 112.055934  | 200,143,305 |
| Oct-22 | 1,782,602.19 | 112.299667  | 200,185,633 |
| Nov-22 | 1,723,920.73 | 112.574476  | 194,069,472 |
| Dic-22 | 1,524,394.12 | 112.898157  | 172,101,287 |

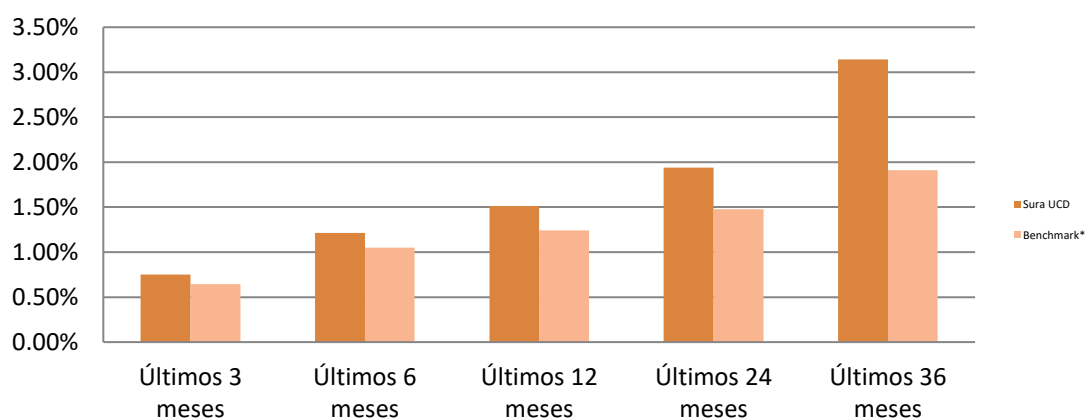
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 53,266,390         | 15,733,106    | 1403       |
| Feb-22 | 73,715,431         | 34,535,844    | 1605       |
| Mar-22 | 87,143,464         | 156,065,204   | 1514       |
| Abr-22 | 48,478,249         | 42,057,512    | 1628       |
| May-22 | 78,249,943         | 54,450,078    | 1759       |
| Jun-22 | 59,504,693         | 94,364,682    | 1579       |
| Jul-22 | 39,661,322         | 41,668,848    | 1688       |
| Ago-22 | 33,145,076         | 29,822,828    | 1765       |
| Set-22 | 49,196,620         | 63,094,600    | 1699       |
| Oct-22 | 33,723,860         | 34,105,483    | 1705       |
| Nov-22 | 47,344,988         | 53,973,705    | 1736       |
| Dic-22 | 30,962,099         | 53,476,774    | 1709       |

#### Rentabilidad de SURA Ultra Cash Dólares vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura UCD | Benchmark* |
|------------------|----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 0.75%    | 0.64%      |
| Últimos 6 meses  | 1.21%    | 1.05%      |
| Últimos 12 meses | 1.51%    | 1.24%      |
| Últimos 24 meses | 1.94%    | 1.48%      |
| Últimos 36 meses | 3.14%    | 1.91%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera hasta 30 días ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

#### **Retorno Histórico Sura Ultra Cash Dolares vs Benchmark**



A diciembre de 2022, SURA Ultra Cash Dólares FMIV administró un patrimonio de US\$ 172,101,287. El retorno de “SURA Ultra Cash Dólares FMIV” durante el 2022 fue de 1.51%.

Al cierre de año, en el fondo “SURA Ultra Cash Dólares FMIV” se presentaron dos excesos de inversión con respecto de los límites establecidos en la política de inversiones del fondo mutuo por emisor BTG Pactual Chile e Itau Corpbanca.

---

### SURA Renta Periódica I Dólares FMIV

Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo ha sido constituido con una duración máxima de 4 años y fue inscrito en la sección de Fondos del Registro mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 074-2018-SMV/10.2, con fecha 22 de junio de 2018, la última modificación realizada es mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 083-2022-SMV/10.2 de fecha 07 de julio de 2022.

#### Objetivo de Inversión del Fondo

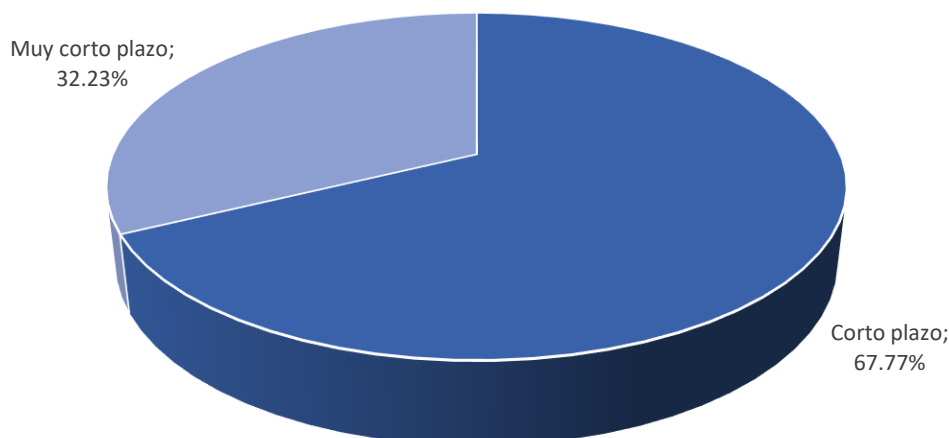
El Fondo SURA Renta Periódica I Dólares FMIV invierte en instrumentos representativos de deuda, denominados en dólares, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú como en el extranjero. La duración promedio del portafolio durante el primer año de vigencia del fondo estará en el rango de entre 2 y 4 años.

#### Política de Inversión del Fondo

El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de largo plazo con una clasificación igual o superior a BBB- para el mercado local y hasta B+ para el internacional, así como en instrumentos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, y en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-. Dichos instrumentos se mantendrán hasta sus fechas de vencimiento o la fecha de vencimiento del fondo, salvo que, por algún evento de mercado, la Administradora decida venderlos previamente. El Fondo también podrá invertir hasta un 25% del patrimonio en cuotas de fondos mutuos, fondos de inversión y/o ETF que inviertan 100% en instrumentos representativos de deuda.

El Fondo repartirá flujos trimestrales producto de la acumulación del cobro de los cupones y/o amortizaciones de los instrumentos representativos de deuda que componen el portafolio, siempre que los emisores cumplan con el pago de los mismos. La repartición se realizará a través de rescates programados

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



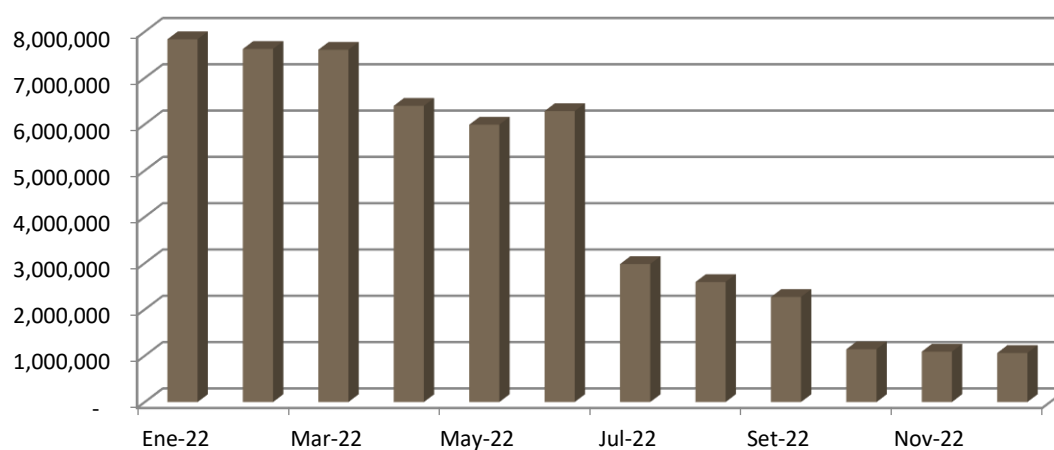
Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                         | %           |
|----------------------------------|-------------|
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS | 16.95%      |
| SCOTIABANK DEL PERÚ              | 16.94%      |
| BANCO DE CREDITO DEL PERU        | 16.94%      |
| BANCO BBVA PERU                  | 16.93%      |
| BTG PACTUAL                      | 16.15%      |
| CEMENTOS PACASMAYO S.A           | 16.08%      |
| <b>TOTAL</b>                     | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (S/.)



## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - Sura Renta Periódica I Dólares 30/12/2022                          |           |          |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                                                 | 13.73     |          |         |
| Derivados                                                                                  | -         | Márgenes | Legales |
|                                                                                            | % Cartera | Min      | Max     |
| Según Tipo de Instrumento                                                                  |           |          |         |
| Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio                             | -         | -        | -       |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                                            | 100.00    | 100.00   | 100.00  |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                           | -         | na       | na      |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                         | 58.46     | na       | na      |
| Instrumentos emitidos por empresas del sistema financiero                                  | 13.94     | na       | na      |
| Instrumentos de emisores corporativos                                                      | 13.87     | na       | na      |
| Operaciones de reporte                                                                     | -         | na       | na      |
| Cuotas de ETF/ fondos mutuos/ fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda | -         | -        | 25.00   |
| Límite por Moneda                                                                          | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                        | 86.27     | 100.00   | 100.00  |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                 | -         | Al 0     | -       |
| Origen Mercado                                                                             | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local                                                                              | 58.46     | Al 0     | 41.54   |
| Mercado Extranjero                                                                         | 27.81     | Al 0     | 100.00  |
| Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda                             | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo                                                 | -         | na       | na      |
| CP-1                                                                                       | -         | Al 0     | 100.00  |
| Desde CP - 2+ hasta CP - 3                                                                 | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo                                                 | -         | na       | na      |
| Desde AAA hasta A-                                                                         | -         | Al 0     | 100.00  |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                      | -         | Al 0     | 100.00  |
| Mercado Local: Entidades Financieras                                                       | 58.46     | na       | na      |
| Desde A+ hasta B+                                                                          | 58.46     | Al 0     | 100.00  |
| Desde B hasta B-                                                                           | -         | Al 0     | 50.00   |
| Mercado Internacional                                                                      | 27.81     | na       | na      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                            | -         | Al 0     | 100.00  |
| Largo Plazo: No menor a C                                                                  | 27.81     | -        | 72.19   |
| Largo Plazo: Menor a C                                                                     | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)                                                   | -         | Al 0     | 100.00  |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                     | -         | Al 0     | 50.00   |
| Instrumentos Derivados                                                                     | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                       | -         | Al 0     | -       |
| Forwards a otras monedas                                                                   | -         | Al 0     | -       |
| Swap                                                                                       | -         | Al 0     | -       |
| Duración de la cartera                                                                     | 0.1994    |          |         |

## Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas    | Valor Cuota | US\$      |
|--------|-----------|-------------|-----------|
| Ene-22 | 74,671.28 | 104.934934  | 7,835,626 |
| Feb-22 | 74,673.55 | 102.130537  | 7,626,449 |
| Mar-22 | 74,673.03 | 101.899383  | 7,609,136 |
| Abr-22 | 62,266.18 | 102.758662  | 6,398,389 |
| May-22 | 62,061.98 | 96.521704   | 5,990,328 |
| Jun-22 | 61,850.88 | 101.618879  | 6,285,217 |
| Jul-22 | 31,721.23 | 93.974797   | 2,980,996 |
| Ago-22 | 30,062.44 | 86.248584   | 2,592,843 |
| Set-22 | 26,293.44 | 86.335004   | 2,270,044 |
| Oct-22 | 13,196.43 | 86.449295   | 1,140,822 |
| Nov-22 | 12,491.61 | 87.206444   | 1,089,349 |
| Dic-22 | 12,144.40 | 87.326133   | 1,060,524 |

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescatos US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 45,610             | 2,295,539     | 189        |
| Feb-22 | 17,350             | 17,299        | 188        |
| Mar-22 | 10,000             | 10,000        | 188        |
| Abr-22 | -                  | 1,280,000     | 188        |
| May-22 | -                  | 20,367        | 187        |
| Jun-22 | -                  | 21,392        | 186        |
| Jul-22 | -                  | 3,014,264     | 142        |
| Ago-22 | -                  | 144,038       | 130        |
| Set-22 | -                  | 325,247       | 109        |
| Oct-22 | -                  | 1,129,525     | 100        |
| Nov-22 | -                  | 61,024        | 94         |
| Dic-22 | -                  | 30,281        | 90         |

Rentabilidad de SURA Renta Periódica I Dólares vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura RPID | Benchmark* |
|------------------|-----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 1.15%     | 0.29%      |
| Últimos 6 meses  | -14.07%   | 0.57%      |
| Últimos 12 meses | -24.29%   | 1.08%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera a más de 360 días, ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

**Retorno Histórico Sura Renta Periódica I Dólares vs Benchmark**



A diciembre de 2022, SURA Renta Periódica I Dólares FMIV administró un patrimonio de \$1,060,524.00 dólares. El retorno de “SURA Renta Periódica I Dólares FMIV” durante el 2022 fue de -24.29%, el cual se vio afectado por el deterioro crediticio e impago por parte de algunos emisores que se mantenían en cartera y que luego fueron vendidos con el fin de evitar mayor riesgo al portafolio.

Al 31 de diciembre del 2022, el fondo no presentó excesos de inversión con respecto de los límites establecidos en la política de inversiones del fondo mutuo.

---

## SURA Renta Periódica I Soles FMIV

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo ha sido constituido con una duración máxima de 4 años y fue inscrito en la sección de Fondos del Registro mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 112-2018-SMV/10.2, con fecha 02 de octubre de 2018. El inicio de actividades rige desde la fecha en la cual el Fondo cumpla con los requisitos previstos en el Reglamento de Fondos Mutuos para el inicio de actividades o etapa operativa.

### Objetivo de Inversión del Fondo

El Fondo SURA Renta Periódica I Soles FMIV invierte predominantemente en instrumentos representativos de deuda, denominados en Soles y/o Dólares, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú como en el extranjero. La duración promedio del portafolio durante el primer año de vigencia del fondo estará en el rango de entre 2 y 4 años.

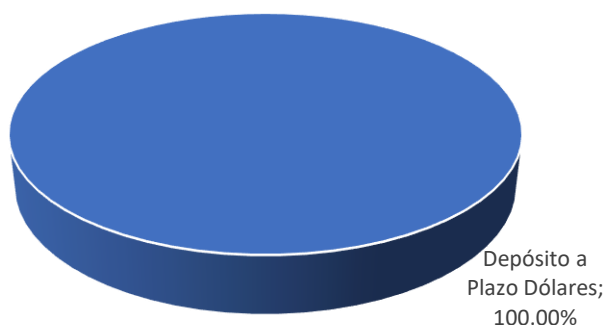
### Política de Inversión del Fondo

El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de largo plazo con una clasificación igual o superior a BBB- para el mercado local y hasta B+ para el internacional, así como en instrumentos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-, y en instrumentos sin clasificación como operadores de reporte y bonos privados. Asimismo, podrá invertir en instrumentos derivados con fines de cobertura. Dichos instrumentos se mantendrán hasta sus fechas de vencimiento o la fecha de vencimiento del fondo, salvo que, por algún evento de mercado, la Administradora decida venderlos previamente.

El Fondo también podrá invertir hasta un 25% del patrimonio en cuotas de fondos mutuos y/o ETF que inviertan 100% en instrumentos representativos de deuda administrados por otras administradoras.

El Fondo repartirá flujos trimestrales o semestrales producto de la acumulación del cobro de los cupones de los instrumentos representativos de deuda que componen el portafolio, siempre que los emisores cumplan con el pago de los mismos.

### Inversiones del Fondo por Instrumento



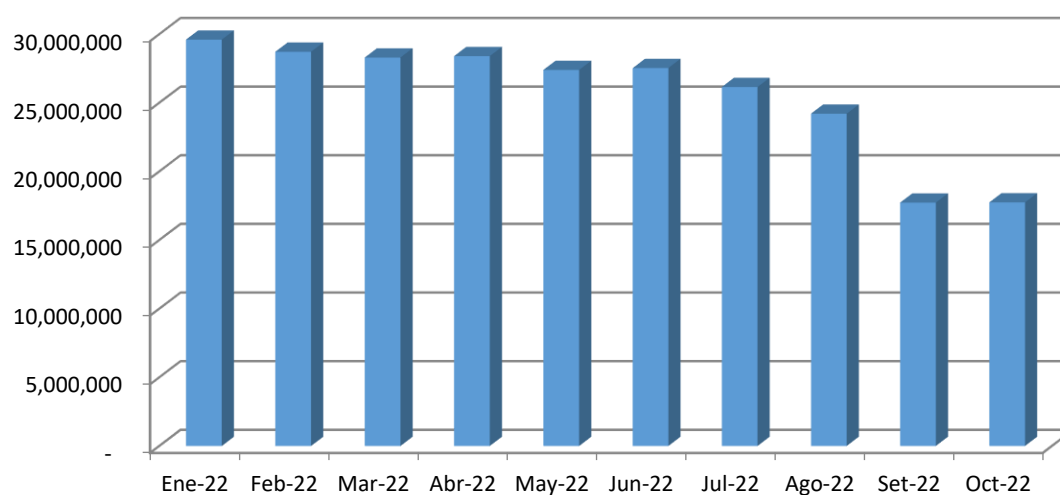
Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                | %           |
|-----------------------------------------|-------------|
| MIBANCO - BANCO DE LA MICROEMPRESA S.A. | 510.8%      |
| BANCO INTERAMERICANO DE FINANZAS        | 510.4%      |
| BANCO INTERNACIONAL DEL PERU-INTERBANK  | 508.6%      |
| FORWARDS                                | -1429.8%    |
| <b>TOTAL</b>                            | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (S/.)



## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Límites del prospecto - Sura Renta Periódica I Soles 20/10/2022                                            |           |          |         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                                                                 | 24.42     |          |         |
| Derivados                                                                                                  | -26.09    | Márgenes | Legales |
| Según Tipo de Instrumento                                                                                  | % Cartera | Min      | Max     |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                      | -         | -        | 20.00   |
| Cuotas de fondos mutuos y/o cuotas de fondos de inversión de instrumentos representativos de participación | -         | -        | 20.00   |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                     | 101.68    | 21.68    | -1.68   |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                           | -         | na       | na      |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                         | 31.42     | na       | na      |
| Instrumentos emitidos por empresas del sistema financiero                                                  | 39.17     | na       | na      |
| Instrumentos de emisores corporativos                                                                      | -         | na       | na      |
| Operaciones de reporte                                                                                     | -         | na       | na      |
| Cuotas de ETF/ fondos mutuos/ fondos de inversión de instrumentos representativos de deuda                 | 31.09     | 31.09    | -6.09   |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                   | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                        | 94.34     | Al 0     | 5.66    |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                                 | -18.75    | -18.75   | 100.00  |
| <b>Origen Mercado</b>                                                                                      | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local                                                                                              | 36.41     | Al 0     | 63.59   |
| Mercado Extranjero                                                                                         | 39.17     | Al 0     | 60.83   |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                      | 100.00    | na       | na      |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                          | -         | na       | na      |
| CP-1                                                                                                       | -         | Al 0     | 100.00  |
| Desde CP - 2+ hasta CP - 3                                                                                 | -         | Al 0     | 50.00   |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                          | 31.09     | na       | na      |
| Desde AAA hasta A-                                                                                         | 31.09     | Al 0     | 68.91   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                      | -         | Al 0     | 100.00  |
| Menor a BBB-                                                                                               | -         | Al 0     | -       |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                | 31.42     | na       | na      |
| Desde A+ hasta B+                                                                                          | 31.42     | Al 0     | 68.58   |
| Desde B hasta B-                                                                                           | -         | Al 0     | 50.00   |
| Menor a B-                                                                                                 | -         | Al 0     | -       |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                               | 39.17     | na       | na      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                                            | -         | Al 0     | 100.00  |
| Largo Plazo: No menor a B+                                                                                 | 39.17     | 39.17    | 60.83   |
| Largo Plazo: Menor a B+                                                                                    | -         | Al 0     | -       |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                            | -         | Al 0     | 100.00  |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                              | -         | Al 0     | 50.00   |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                              | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                       | 94.34     | Al 0     | 5.66    |
| Forwards a otras monedas                                                                                   | -         | Al 0     | -       |
| Swap                                                                                                       | -         | -        | 100.00  |
| Duración de la cartera                                                                                     | 0.15      | 2.00     | 4.00    |

## Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas     | Valor Cuota | PEN        |
|--------|------------|-------------|------------|
| Ene-22 | 318,311.12 | 92.992757   | 29,600,629 |
| Feb-22 | 318,311.12 | 90.225698   | 28,719,843 |
| Mar-22 | 318,299.75 | 88.902097   | 28,297,515 |
| Abr-22 | 318,244.27 | 89.229299   | 28,396,713 |
| May-22 | 316,485.43 | 86.563820   | 27,396,187 |
| Jun-22 | 313,889.22 | 87.704300   | 27,529,435 |
| Jul-22 | 310,491.10 | 84.226972   | 26,151,725 |
| Ago-22 | 308,745.86 | 78.407881   | 24,208,109 |
| Set-22 | 225,777.17 | 78.522366   | 17,728,557 |
| Oct-22 | 225,238.90 | 78.776984   | 17,743,641 |

| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN |
|--------|-------------------|--------------|
| Ene-22 | 120,440           | 116,808      |
| Feb-22 | -                 | -            |
| Mar-22 | 251,296           | 252,307      |
| Abr-22 | -                 | 5,000        |
| May-22 | -                 | 157,163      |
| Jun-22 | -                 | 230,060      |
| Jul-22 | -                 | 293,515      |
| Ago-22 | -                 | 139,175      |
| Set-22 | -                 | 6,506,982    |
| Oct-22 | -                 | 42,227       |
| Nov-22 | -                 | 17,735,393   |
| Dic-22 | -                 | -            |

#### Rentabilidad de SURA Renta Periódica I Soles vs. Benchmark

| al 28/11/2022    | Sura RPIS | Benchmark* |
|------------------|-----------|------------|
| Últimos 3 meses  | 0.43%     | 0.64%      |
| Últimos 6 meses  | -9.03%    | 1.24%      |
| Últimos 12 meses | -23.90%   | 2.30%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional hasta 30 días ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

#### Retorno Histórico Sura Renta Periódica I Soles vs Benchmark



El fondo Sura Renta Periódica I Soles FMIV venció el 20 de Noviembre de 2022.

A Octubre de 2022, el fondo administró un patrimonio de PEN 17,743,641.00 soles. El retorno de “SURA Renta Periódica I Soles FMIV” durante el 2022 fue de -23.90%, %, el cual se vio afectado por el deterioro crediticio e impago por parte de algunos emisores que se mantenían en cartera y que luego fueron vendidos con el fin de evitar mayor riesgo al portafolio.

A la fecha del cierre del fondo, no se presentaron excesos de inversión con respecto de los límites establecidos en la política de inversiones del fondo mutuo.

---

## **SURA Renta Periódica II Dólares FMIV**

### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 045-2019-SMV/10.2 de fecha 10 de junio de 2019 con el nombre de Fondo Sura Renta Periódica II Dólares FMIV y mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 037-2020-SMV/10.2 de fecha 26 de mayo de 2020 se modificó el anexo del reglamento de participación del fondo, cambiando el monto mínimo que se debe recaudar durante la etapa pre-operativa para no incurrir en causal de liquidación.

### Objetivo de Inversión del Fondo

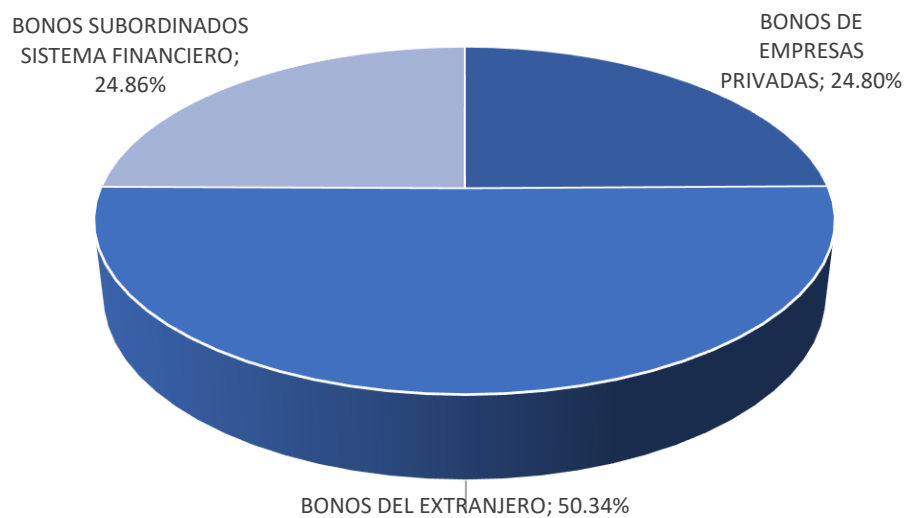
El Fondo SURA Renta Periódica II Dólares FMIV invierte en instrumentos representativos de deuda, denominados en dólares, emitidos tanto en el mercado local como internacional, por empresas e instituciones constituidas tanto en el Perú como en el extranjero. La duración promedio del portafolio durante el primer año de vigencia del fondo estará en el rango de entre 2 y 4 años.

### Política de Inversión del Fondo

El Fondo SURA Renta Periódica II Dólares FMIV invierte en instrumentos representativos de deuda en dólares u otras monedas, las cuales estarán coberturadas al 100% a la moneda del valor cuota, de largo plazo con una clasificación igual o superior a BB para el mercado local y hasta B para el internacional, así como en instrumentos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3 para el internacional, y en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación de fortaleza financiera igual o superior a B-. Dichos instrumentos se mantendrán hasta su fecha de vencimiento o la fecha de vencimiento del fondo, salvo que, por algún evento de mercado, la Administradora decida venderlos previamente. La duración promedio del portafolio durante el primer año de vigencia del fondo estará en el rango de entre 2 y 4 años.

El Fondo también podrá invertir hasta un 25% del activo total en cuotas de ETF y/o fondos de inversión de terceros y/o administrados por la propia Sociedad Administradora que inviertan 100% en instrumentos representativos de deuda. El Fondo podrá invertir en instrumentos derivados, como forwards y swaps, con fines de cobertura en hasta el 100% del activo total.

Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES               | %           |
|------------------------|-------------|
| FIBRA UNO              | 35.76%      |
| BANCO DE BOGOTA        | 24.86%      |
| CEMENTOS PACASMAYO S.A | 24.80%      |
| Alfa SAB               | 14.58%      |
| <b>TOTAL</b>           | <b>100%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

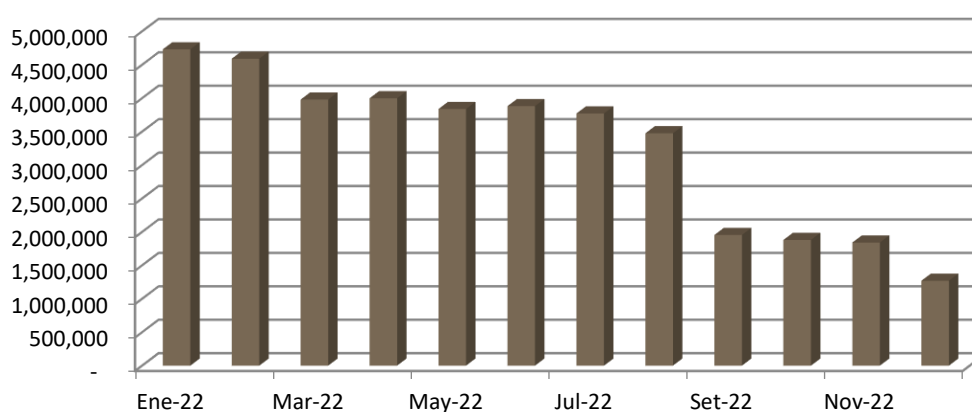
| Límites del prospecto - Sura Renta Periódica II Dólares 30/12/2022     |           |          |         |
|------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Caja + CxC                                                             | 13.03     |          |         |
| Derivados                                                              | -         | Márgenes | Legales |
|                                                                        |           | Min      | Max     |
| Según Tipo de Instrumento                                              | % Cartera |          |         |
| Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos                        | 100.00    | 100.00   | 100.00  |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central       | -         | na       | na      |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                     | -         | na       | na      |
| Instrumentos emitidos por empresas del sistema financiero              | 21.62     | na       | na      |
| Instrumentos de emisores corporativos                                  | 65.35     | na       | na      |
| Operaciones de reporte                                                 | -         | na       | na      |
| Cuotas de ETF/ fondos mutuos/ fondos de inversión de instrumentos repr | -         | -        | 25.00   |
| Límite por Moneda                                                      | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)    | 86.97     | 100.00   | 13.03   |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)             | -         | -        | -       |
| Origen Mercado                                                         | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local                                                          | -         | -        | 100.00  |
| Mercado Extranjero                                                     | 86.97     | 86.97    | 13.03   |
| Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda         | 100.00    | na       | na      |
| Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo                             | -         | na       | na      |
| CP-1                                                                   | -         | -        | 100.00  |
| Desde CP - 2+ hasta CP - 3                                             | -         | -        | 50.00   |
| Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo                             | -         | na       | na      |
| Desde AAA hasta A-                                                     | -         | -        | 100.00  |
| Desde BBB+ hasta BB                                                    | -         | -        | 100.00  |
| Menor a BB                                                             | -         | -        | -       |
| Mercado Local: Entidades Financieras                                   | -         | na       | na      |
| Desde A+ hasta B+                                                      | -         | -        | 100.00  |
| Desde B hasta B-                                                       | -         | -        | 50.00   |
| Menor a B-                                                             | -         | -        | -       |
| Mercado Internacional                                                  | 86.97     | na       | na      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                        | -         | -        | 100.00  |
| Largo Plazo: No menor a B                                              | 86.97     | 86.97    | 100.00  |
| Largo Plazo: Menor a B                                                 | -         | Al 0     | -       |
| Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)                               | -         | -        | 100.00  |
| Instrumentos Derivados                                                 | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                   | -         | -        | 100.00  |
| Forwards a otras monedas                                               | -         | -        | -       |
| Swap                                                                   | -         | -        | 100.00  |
| DURACIÓN                                                               | -         | na       | na      |
| Duración de la cartera                                                 | 0.91      | na       | na      |

## Patrimonio Administrado (S/.)

| Fecha  | Cuotas    | Valor Cuota | US\$      |
|--------|-----------|-------------|-----------|
| Ene-22 | 50,647.18 | 93.403876   | 4,730,643 |
| Feb-22 | 50,647.18 | 90.630086   | 4,590,158 |
| Mar-22 | 44,699.38 | 89.041431   | 3,980,096 |
| Abr-22 | 44,699.38 | 89.470526   | 3,999,277 |
| May-22 | 44,699.38 | 85.884277   | 3,838,974 |
| Jun-22 | 44,502.58 | 87.218540   | 3,881,450 |
| Jul-22 | 44,502.58 | 84.739285   | 3,771,117 |
| Ago-22 | 44,502.58 | 78.100041   | 3,475,653 |
| Set-22 | 25,577.70 | 76.422004   | 1,954,699 |
| Oct-22 | 24,480.27 | 76.815256   | 1,880,458 |
| Nov-22 | 23,708.60 | 77.656844   | 1,841,135 |
| Dic-22 | 16,304.08 | 77.878085   | 1,269,730 |

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 15,050             | 15,033        | 102        |
| Feb-22 | -                  | -             | 102        |
| Mar-22 | -                  | 538,663       | 102        |
| Abr-22 | -                  | -             | 102        |
| May-22 | -                  | -             | 102        |
| Jun-22 | -                  | 17,122        | 101        |
| Jul-22 | -                  | -             | 101        |
| Ago-22 | -                  | -             | 101        |
| Set-22 | -                  | 1,462,015     | 76         |
| Oct-22 | -                  | 84,240        | 70         |
| Nov-22 | -                  | 59,340        | 67         |
| Dic-22 | -                  | 575,515       | 64         |

### Evolución del patrimonio

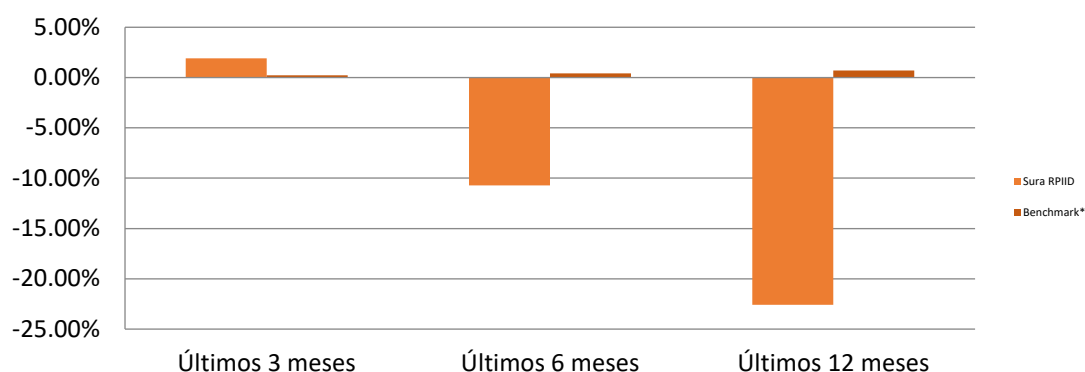


### Rentabilidad de Sura Renta Periódica II vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | Sura RPIID | Benchmark* |
|------------------|------------|------------|
| Últimos 3 meses  | 1.91%      | 0.23%      |
| Últimos 6 meses  | -10.71%    | 0.42%      |
| Últimos 12 meses | -22.58%    | 0.70%      |
| Últimos 24 meses | -26.52%    | 1.24%      |

\*El indicador de referencia es el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera a más de 360 días, ofrecida por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos.

### Retorno Histórico Sura Renta Periódica II Dólares vs Benchmark



A diciembre de 2022, Sura Renta Periódica II Dólares FMIV administró un patrimonio de US\$ 1,269,730.00 dólares. El retorno de “SURA Renta Periódica II Dólares FMIV” durante el 2022 fue de -22.58%, el cual se vio afectado por el deterioro crediticio e impago por parte de algunos emisores que se mantenían en cartera y que luego fueron vendidos con el fin de evitar mayor riesgo al portafolio.

Al 31 de diciembre del 2022, el fondo presentó excesos de inversión por emisor en Banco de Bogotá, Cementos Pacasmayo y Fibra Uno; además, se presentó un exceso de inversión por grupo económico en El-Mann.

---

### Fondo de Fondos SURA Capital Estratégico I FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 083-2013-SMV/10.2 de fecha 20 de junio de 2013 con el nombre de Fondos de Fondos Sura Capital Estratégico I – FMIV.

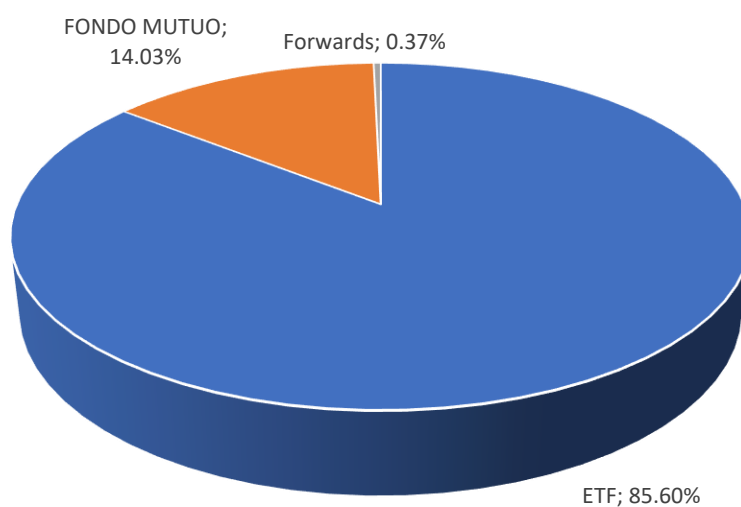
#### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en fondos mutuos locales e internacionales con una exposición mínima de 75%. Tiene como objetivo la búsqueda del crecimiento del capital sobre la base de la relación óptima de rentabilidad y bajo riesgo.

#### Política de Inversión del Fondo

Las inversiones se realizan principalmente en fondos mutuos administrados por Fondos SURA, Fondos internacionales y ETF. El Fondo mantiene una política de inversión conservadora privilegiando la asignación de los fondos hacia fondos de renta fija de corto plazo, sin embargo, éste cuenta con la posibilidad de invertir en fondos de renta variable que el comité de inversiones considere adecuados.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                                 | %           |
|----------------------------------------------------------|-------------|
| ISHARES \$ SHORT DURATION HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF | 23.44%      |
| BLACK ROCK                                               | 20.27%      |
| ISHARES J.P. MORGAN USD EM CRP BOND USD A                | 19.03%      |
| FONDOS SURA SAF SAC                                      | 14.03%      |
| ISHARES \$ SHORT DURATION CORP BOND UCITS ETF            | 10.60%      |
| ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND UCITS ETF                 | 6.77%       |
| IVV ETF                                                  | 4.91%       |
| OTROS                                                    | 0.94%       |
| <b>TOTAL</b>                                             | <b>100%</b> |

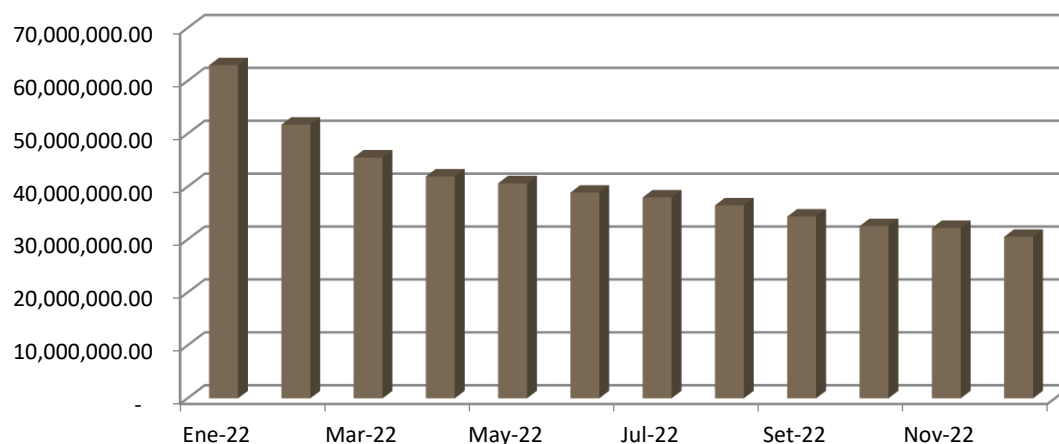
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - SURA Capital Estratégico I 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 2.40          | Márgenes    | Legales       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-------------|---------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera     | Min         | Max           |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | <b>7.86</b>   | <b>Al 0</b> | <b>7.14</b>   |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 7.86          | Al 0        | 7.14          |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | <b>89.74</b>  | <b>4.74</b> | <b>Al 100</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o de fondos mutuos flexibles (4) y/o de fondos de fondos (5) y/o de fondos mutuos internacionales (6)                              | 89.74         | 14.74       | 10.26         |
| ETF Renta Fija                                                                                                                                                                        | 76.00         | na          | na            |
| Instrumentos de deuda directa                                                                                                                                                         | -             | na          | na            |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                                                                                                                   | -             | Al 0        | Al 0          |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                                                                                                                  | -             | Al 0        | Al 0          |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                                                                                                     | -             | Al 0        | 25.00         |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                                                                                                                   | -             | Al 0        | 25.00         |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | <b>100.00</b> | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 51.74         | 51.74       | 100.00        |
| Inversiones en otras monedas USD (posición neta de coberturas)                                                                                                                        | 45.85         | 45.85       | 100.00        |
| <b>Límite por Origen de Mercado</b>                                                                                                                                                   | <b>100.00</b> | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Inversiones en el mercado local                                                                                                                                                       | 13.74         | Al 0        | Al 100        |
| Inversiones en el mercado extranjero                                                                                                                                                  | 83.85         | Al 0        | Al 100        |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| CP - 1                                                                                                                                                                                | -             | Al 0        | 25.00         |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -             | Al 0        | 25.00         |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                    | -             | Al 0        | Al 0          |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -             | Al 0        | Al 0          |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -             | Al 0        | 25.00         |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -             | Al 0        | 25.00         |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Corto Plazo: no menor a CP - 2                                                                                                                                                        | -             | Al 0        | 25.00         |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -             | -           | -             |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                       | <b>-</b>      | <b>Al 0</b> | <b>25.00</b>  |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | <b>-</b>      | <b>Al 0</b> | <b>25.00</b>  |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | <b>-</b>      | <b>na</b>   | <b>na</b>     |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | 38.00         | 38.00       | 62.00         |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -             | -           | 50.00         |

Patrimonio Administrado (S/.)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas A   | Valor Cuota A | Cuotas B | Valor Cuota B | PEN           |
|--------|------------|---------------|----------|---------------|---------------|
| Ene-22 | 429,852.42 | 143.40        | 9,189.28 | 146.31        | 62,984,126.26 |
| Feb-22 | 370,367.73 | 136.27        | 9,047.66 | 139.06        | 51,728,653.52 |
| Mar-22 | 331,302.35 | 133.96        | 8,437.50 | 136.74        | 45,535,869.58 |
| Abr-22 | 309,743.68 | 131.71        | 8,529.07 | 134.46        | 41,943,413.09 |
| May-22 | 302,957.80 | 130.41        | 8,620.30 | 133.16        | 40,655,546.01 |
| Jun-22 | 297,031.61 | 127.10        | 8,710.47 | 129.81        | 38,883,833.02 |
| Jul-22 | 280,932.24 | 130.94        | 8,842.75 | 133.76        | 37,968,254.55 |
| Ago-22 | 274,649.48 | 128.61        | 8,776.29 | 131.41        | 36,476,224.61 |
| Set-22 | 264,669.44 | 126.11        | 7,694.86 | 128.88        | 34,370,364.72 |
| Oct-22 | 249,810.19 | 126.28        | 7,826.68 | 129.08        | 32,556,851.38 |
| Nov-22 | 240,654.92 | 129.48        | 7,868.30 | 132.37        | 32,200,594.98 |
| Dic-22 | 229,230.85 | 128.69        | 7,874.19 | 131.59        | 30,535,978.51 |

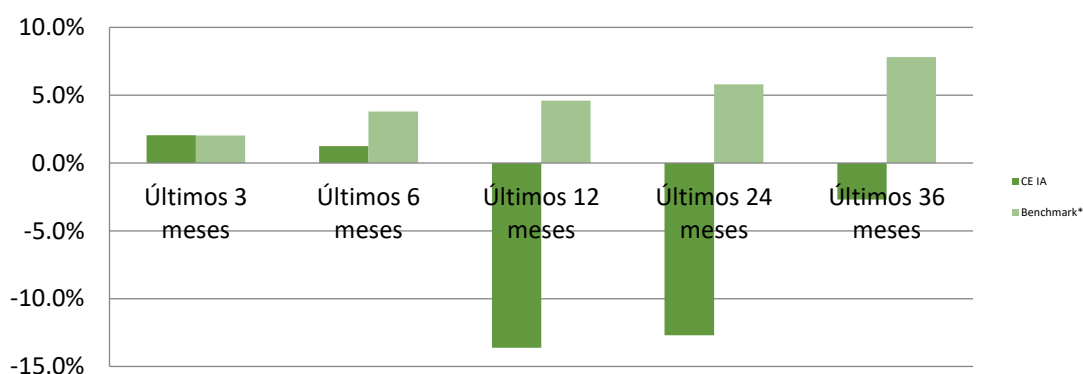
| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 697,026           | 5,726,135    | 778        |
| Feb-22 | 242,519           | 8,629,844    | 723        |
| Mar-22 | 317,745           | 5,639,826    | 690        |
| Abr-22 | 57,297            | 2,913,917    | 668        |
| May-22 | 164,107           | 1,029,731    | 653        |
| Jun-22 | 54,793            | 793,043      | 641        |
| Jul-22 | 47,041            | 2,084,497    | 621        |
| Ago-22 | 83,539            | 913,883      | 611        |
| Set-22 | 74,041            | 1,491,206    | 593        |
| Oct-22 | 59,622            | 1,922,191    | 576        |
| Nov-22 | 16,211            | 1,180,901    | 558        |
| Dic-22 | 20,111            | 1,493,331    | 547        |

Rentabilidad de SURA Capital Estratégico I FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | CE IA  | CE IB  | Benchmark* |
|------------------|--------|--------|------------|
| Últimos 3 meses  | 2.0%   | 2.1%   | 2.0%       |
| Últimos 6 meses  | 1.3%   | 1.4%   | 3.8%       |
| Últimos 12 meses | -13.6% | -13.4% | 4.6%       |
| Últimos 24 meses | -12.7% | -12.3% | 5.8%       |
| Últimos 36 meses | -2.7%  | -2.0%  | 7.8%       |

\*El indicador de referencia está compuesto en un 8% por el IGBVL y en un 92% por el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional a más de 360 días, ofrecidas por los 4 principales bancos del país, ponderadas en función al volumen de depósitos del banco respectivo en moneda nacional hasta 30 días ofrecidas por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos

**Retorno Histórico Sura Capital Estrategico I vs Benchmark**



A diciembre de 2022, el fondo de fondos SURA Capital Estratégico I FMIV administró un patrimonio de S/.30,535,979. El retorno de “SURA Capital Estratégico I” en la serie A fue de –13.6% y en la serie B fue de –13.4%, mientras su benchmark tuvo 4.6% durante el 2022.

Asimismo, al 31 de diciembre de 2022 no se mantuvieron excesos de inversión.

---

### Fondo de Fondos SURA Capital Estratégico II FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 083-2013-SMV/10.2 de fecha 20 de junio de 2013 con el nombre de Fondos de Fondos Sura Capital Estratégico II– FMIV.

El 30 de octubre de 2019, mediante la resolución N° 095-2019-SMV/10.2, la Superintendencia de Mercado de Valores aprobó la fusión por absorción del Fondo de Fondos SURA Capital Estratégico III por parte del Fondo de Fondos SURA Capital Estratégico II. La fusión entró en vigencia el 26 de noviembre 2019.

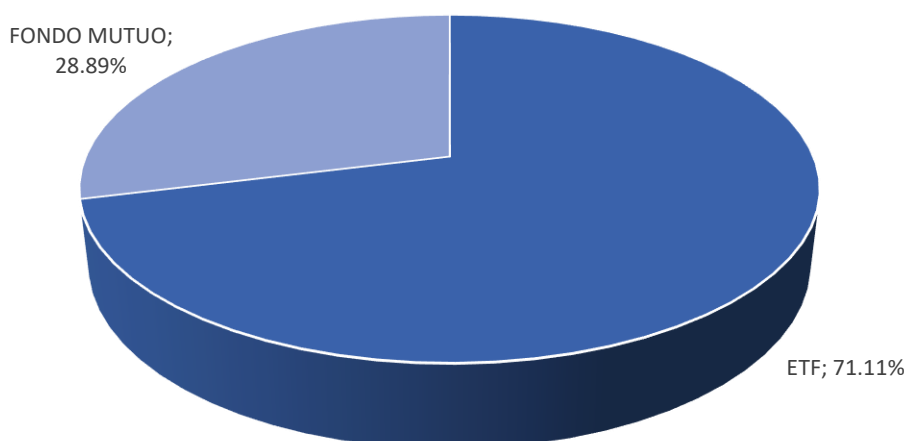
#### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión en fondos mutuos locales e internacionales con una exposición mínima de 75%. Tiene como objetivo la búsqueda del crecimiento del capital sobre la base de la relación óptima de rentabilidad y riesgo medio.

#### Política de Inversión del Fondo

Las inversiones se realizan principalmente en fondos mutuos administrados por Fondos SURA, Fondos internacionales y ETF. El Fondo mantiene una política de inversión de niveles de riesgo medio privilegiando la asignación hacia fondos de renta fija de mediano plazo en los que puede invertir hasta el 60%. Sin embargo, si el comité lo considera pertinente podrá tener hasta un mínimo de 20% en este tipo de fondos. Asimismo, cuenta con la posibilidad de invertir hasta 50% en fondos de renta variable que el comité de inversiones considere adecuados.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                                 | %           |
|----------------------------------------------------------|-------------|
| BLACK ROCK                                               | 42.81%      |
| FONDOS SURA SAF SAC                                      | 28.89%      |
| ISHARES \$ SHORT DURATION HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF | 11.50%      |
| ISHARES J.P. MORGAN USD EM CRP BOND USD A                | 6.53%       |
| IVV ETF                                                  | 4.15%       |
| ISHARES \$ SHORT DURATION CORP BOND UCITS ETF            | 3.54%       |
| ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND UCITS ETF                 | 2.59%       |
| <b>TOTAL</b>                                             | <b>100%</b> |

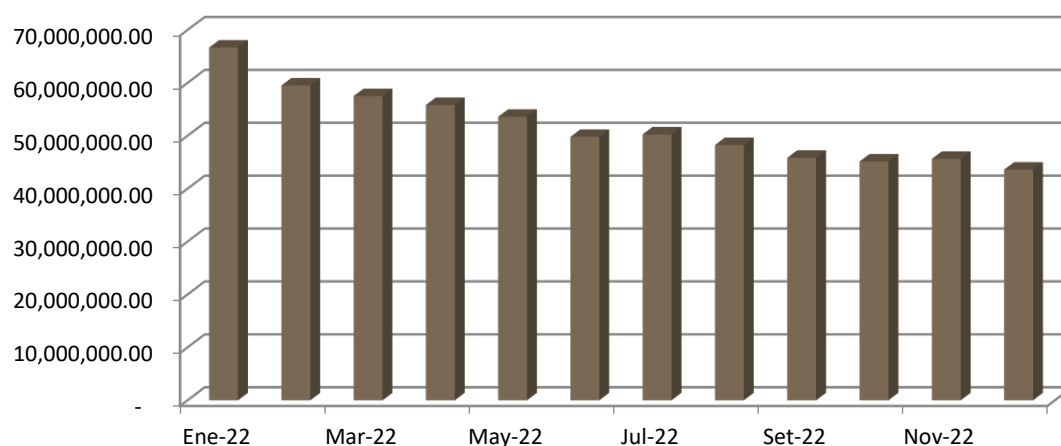
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - SURA Capital Estratégico II 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 1.96          | Márgenes     | Legales      |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|--------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera     | Min          | Max          |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | <b>34.19</b>  | <b>19.19</b> | <b>15.81</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 34.19         | 19.19        | 15.81        |
| ETF Renta Variable                                                                                                                                                                    | 34.19         | na           | na           |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | <b>63.85</b>  | <b>13.85</b> | <b>21.15</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o de fondos mutuos flexibles (4) y/o de fondos de fondos (5) y/o de fondos mutuos internacionales (6)                              | 63.85         | 38.85        | 21.15        |
| <b>Instrumentos de deuda directa</b>                                                                                                                                                  | -             | na           | na           |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                                                                                                                   | -             | Al 0         | Al 0         |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                                                                                                                  | -             | Al 0         | Al 0         |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                                                                                                     | -             | Al 0         | 25.00        |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                                                                                                                   | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 28.32         | 28.32        | 71.68        |
| Inversiones en otras monedas USD (posición neta de coberturas)                                                                                                                        | 69.72         | 69.72        | 30.28        |
| <b>Límite por Origen de Mercado</b>                                                                                                                                                   | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| Inversiones en el mercado local                                                                                                                                                       | 28.32         | Al 0         | Al 100       |
| Inversiones en el mercado extranjero                                                                                                                                                  | 69.72         | Al 0         | Al 100       |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | -             | na           | na           |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | -             | na           | na           |
| CP-1                                                                                                                                                                                  | -             | na           | na           |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | -             | na           | na           |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                    | -             | na           | na           |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -             | na           | na           |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | -             | na           | na           |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -             | Al 0         | 25.00        |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | -             | na           | na           |
| Corto Plazo: no menor a CP - 2                                                                                                                                                        | -             | Al 0         | 25.00        |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -             | -            | -            |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                       | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | -             | na           | na           |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -             | -            | 100.00       |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -             | -            | 50.00        |

Patrimonio Administrado (S/.)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas A   | Valor Cuota A | Cuotas B  | Valor Cuota B | PEN           |
|--------|------------|---------------|-----------|---------------|---------------|
| Ene-22 | 462,810.46 | 140.11        | 12,972.18 | 142.56        | 66,695,020.52 |
| Feb-22 | 424,397.64 | 136.07        | 12,768.56 | 138.48        | 59,516,588.33 |
| Mar-22 | 410,626.43 | 135.90        | 12,321.13 | 138.33        | 57,509,598.91 |
| Abr-22 | 411,848.91 | 131.70        | 11,804.96 | 134.08        | 55,823,333.65 |
| May-22 | 402,624.23 | 129.25        | 11,886.90 | 131.61        | 53,604,354.46 |
| Jun-22 | 386,917.71 | 124.79        | 11,971.36 | 127.10        | 49,806,017.03 |
| Jul-22 | 378,125.72 | 128.82        | 11,894.33 | 131.22        | 50,269,691.30 |
| Ago-22 | 371,137.58 | 125.99        | 11,700.39 | 128.37        | 48,259,891.08 |
| Set-22 | 358,797.44 | 123.74        | 11,532.38 | 126.11        | 45,852,782.78 |
| Oct-22 | 346,418.47 | 126.23        | 11,110.28 | 128.66        | 45,157,043.90 |
| Nov-22 | 341,335.06 | 129.72        | 10,424.65 | 132.25        | 45,655,677.08 |
| Dic-22 | 334,365.27 | 126.37        | 10,486.60 | 128.86        | 43,606,202.77 |

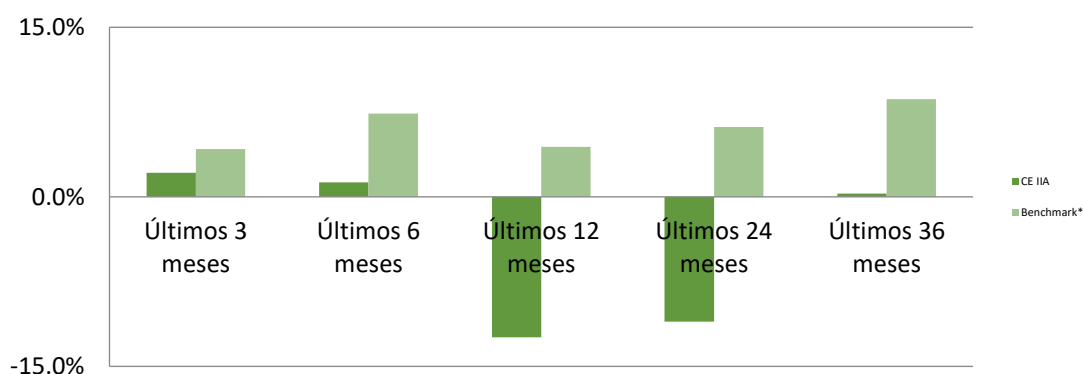
| Mes    | Suscripciones PEN | Rescates PEN | Partícipes |
|--------|-------------------|--------------|------------|
| Ene-22 | 2,399,236         | 7,378,351    | 955        |
| Feb-22 | 691,756           | 6,045,746    | 909        |
| Mar-22 | 1,952,228         | 3,846,798    | 890        |
| Abr-22 | 1,415,581         | 1,322,552    | 874        |
| May-22 | 749,596           | 1,913,562    | 851        |
| Jun-22 | 54,585            | 2,017,919    | 833        |
| Jul-22 | 54,087            | 1,169,679    | 824        |
| Ago-22 | 139,265           | 1,060,262    | 801        |
| Set-22 | 110,527           | 1,686,294    | 784        |
| Oct-22 | 26,217            | 1,626,350    | 767        |
| Nov-22 | 42,505            | 782,345      | 753        |
| Dic-22 | 70,211            | 950,002      | 739        |

Rentabilidad de Capital Estratégico II FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | CE IIA | CE IIB | Benchmark* |
|------------------|--------|--------|------------|
| Últimos 3 meses  | 2.1%   | 2.2%   | 4.2%       |
| Últimos 6 meses  | 1.3%   | 1.4%   | 7.4%       |
| Últimos 12 meses | -12.4% | -12.2% | 4.4%       |
| Últimos 24 meses | -11.1% | -10.6% | 6.2%       |
| Últimos 36 meses | 0.3%   | 1.0%   | 8.7%       |

\*El indicador de referencia está compuesto en un 32% por el IGBVL y en un 68% por el promedio de las tasas pasivas en moneda nacional a más de 360 días, ofrecidas por los 4 principales bancos del país, ponderadas en función al volumen de depósitos del banco respectivo en moneda nacional hasta 30 días ofrecidas por los cuatro principales bancos del país en función a sus depósitos

**Retorno Histórico Sura Capital Estrategico II vs Benchmark**



A diciembre de 2022, el fondo de fondos SURA Capital Estratégico II FMIV administró un patrimonio de S/.43,606,202. El retorno de “SURA Capital Estratégico II” en la Serie A fue de -12.4% y en la Serie B fue -12.2%, mientras su benchmark tuvo 4.4% durante el 2022.

Asimismo, al 31 de diciembre de 2022 no se mantuvieron excesos de inversión.

---

### Fondo de Fondos Sura Selección Global I FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 019-2016-SMV/10.2 de fecha 04 de marzo de 2016 se modifica el nombre de Fondos de Fondos Sura Selección Global I – FMIV y mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 013-2017-SMV/10.2 de fecha 19 de enero de 2017 se modifica el indicador de comparación de rendimientos, la política de inversiones, la comisión de traspaso y los rescates significativos.

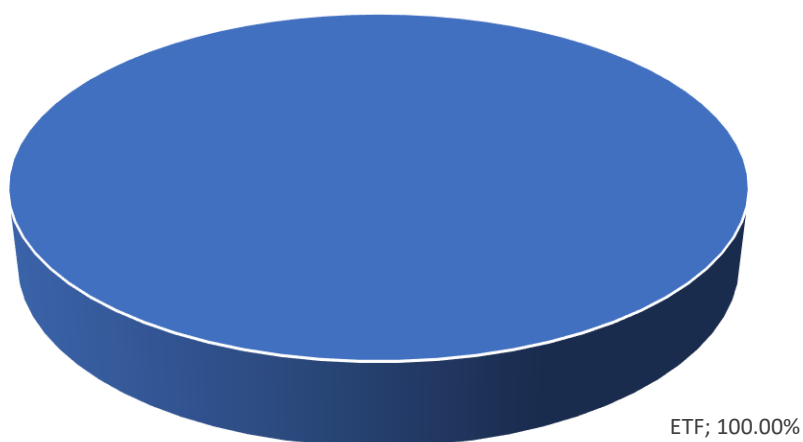
#### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión que invierte como mínimo el 75% del patrimonio en cuotas de participación de fondos administrados por la misma sociedad administradora y/o por otras administradoras y/o ETF's; predominantemente en fondos representativos de instrumentos de deuda y en menor medida en fondos representativos de instrumentos de participación en el patrimonio y en fondos mixtos. Estos fondos invertirán en empresas e instituciones constituidas en el Perú y/o en el extranjero, y sus respectivas cuotas de participación podrán ser denominadas indistintamente tanto en dólares como en otras monedas. Asimismo, el Fondo invertirá entre el 0% y 25% restante del patrimonio en instrumentos de corto plazo (hasta 1 año) emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú (BCRP) y/o en depósitos e instrumentos representativos de estos emitidos por empresas del sistema financiero denominados tanto en dólares como en otras monedas. Además, el Fondo podrá realizar operaciones con derivados cambiarios (forwards) con fines de cobertura.

#### Política de Inversión del Fondo

La tipología del Fondo es de Fondo de Fondos. El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, así como en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-. Las inversiones del Fondo se realizan en dólares y soles y en el mercado local e internacional. El Fondo mantendrá en todo momento una posición en monedas neta de coberturas de al menos 75% en dólares, otorgando a los partícipes una exposición a dicha moneda resultante de la estrategia que el comité de inversiones determine en función a la evolución de los distintos tipos de cambio. Se podrá contratar operaciones forwards sin fines de cobertura con el fin de liquidar anticipadamente una posición.

Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                                 | %           |
|----------------------------------------------------------|-------------|
| BLACK ROCK                                               | 47.32%      |
| ISHARES \$ SHORT DURATION HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF | 23.69%      |
| ISHARES J.P. MORGAN USD EM CRP BOND USD A                | 13.49%      |
| ISHARES \$ SHORT DURATION CORP BOND UCITS ETF            | 10.07%      |
| ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND UCITS ETF                 | 5.42%       |
| <b>TOTAL</b>                                             | <b>100%</b> |

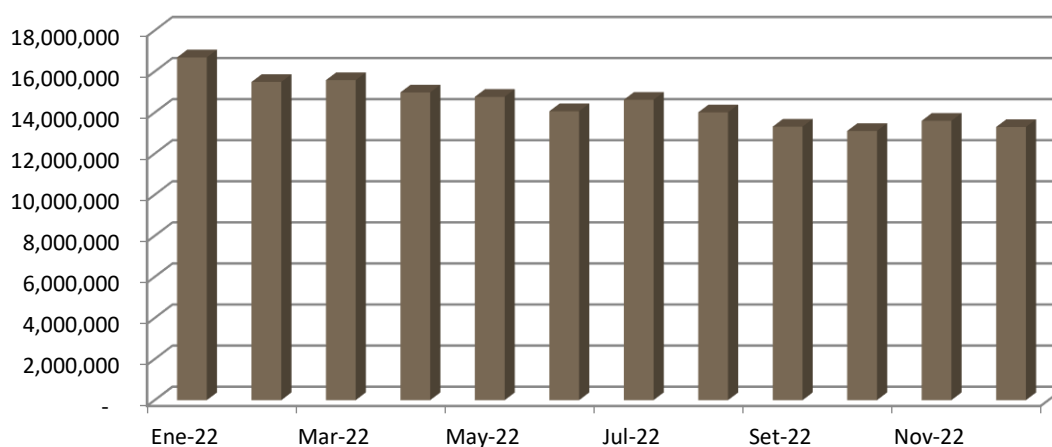
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - Selección Global I 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 1.01          | Márgenes     | Legales      |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|--------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera     | Min          | Max          |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | <b>34.47</b>  | <b>20.00</b> | <b>10.53</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 34.47         | 14.47        | 10.53        |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | <b>64.52</b>  | <b>55.00</b> | <b>80.00</b> |
| Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)                                                                                                                                   | -             | -            | -            |
| Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario)                                                                                                                                  | -             | -            | 25.00        |
| Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario)                                                                                                                                     | -             | -            | 25.00        |
| Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)                                                                                                                                   | -             | -            | 25.00        |
| Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3)                                 | 64.52         | 9.52         | 15.48        |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                   | 98.99         | 48.99        | 100.00       |
| Inversiones en otras monedas                                                                                                                                                          | -             | -            | 50.00        |
| <b>Límite por Origen de Mercado</b>                                                                                                                                                   | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| Inversiones en el mercado local                                                                                                                                                       | -             | Al 0         | 100.00       |
| Inversiones en el mercado extranjero                                                                                                                                                  | 98.99         | Al 0         | 100.00       |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | <b>-</b>      | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>     |
| CP - 1                                                                                                                                                                                | -             | Al 0         | 25.00        |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>     |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                    | -             | Al 0         | -            |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -             | Al 0         | -            |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>     |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -             | Al 0         | 25.00        |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>     |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3                                                                                                                                                        | -             | Al 0         | 25.00        |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -             | Al 0         | 25.00        |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                       | <b>-</b>      | <b>Al 0</b>  | <b>25.00</b> |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | <b>-</b>      | <b>Al 0</b>  | <b>-</b>     |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | <b>-</b>      | <b>na</b>    | <b>na</b>    |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -             | Al 0         | 100.00       |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -             | Al 0         | 50.00        |

## Evolución del patrimonio (US\$)



Patrimonio Administrado

| Fecha  | Cuotas A   | Valor Cuota A | Cuotas B | Valor Cuota B | US\$       |
|--------|------------|---------------|----------|---------------|------------|
| Ene-22 | 138,049.33 | 120.63        | 287.35   | 122.17        | 16,687,773 |
| Feb-22 | 130,908.92 | 118.03        | 348.75   | 119.56        | 15,492,742 |
| Mar-22 | 131,543.18 | 118.09        | 378.81   | 119.65        | 15,579,245 |
| Abr-22 | 132,190.14 | 112.94        | 441.58   | 114.45        | 14,980,072 |
| May-22 | 129,749.86 | 113.36        | 506.54   | 114.91        | 14,766,982 |
| Jun-22 | 130,877.02 | 107.27        | 233.07   | 108.76        | 14,065,116 |
| Jul-22 | 130,317.41 | 111.97        | 302.11   | 113.53        | 14,625,409 |
| Ago-22 | 128,040.76 | 109.10        | 368.97   | 110.65        | 14,010,011 |
| Set-22 | 127,869.41 | 103.77        | 437.42   | 105.27        | 13,314,949 |
| Oct-22 | 123,024.61 | 106.09        | 507.23   | 107.64        | 13,106,081 |
| Nov-22 | 122,485.14 | 110.85        | 203.97   | 112.49        | 13,599,911 |
| Dic-22 | 121,661.05 | 109.07        | 270.75   | 110.71        | 13,299,155 |

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 210,649            | 448,263       | 459        |
| Feb-22 | 297,947            | 1,131,138     | 446        |
| Mar-22 | 455,378            | 370,734       | 438        |
| Abr-22 | 317,829            | 231,740       | 435        |
| May-22 | 101,887            | 367,941       | 426        |
| Jun-22 | 194,988            | 96,275        | 422        |
| Jul-22 | 153,786            | 205,158       | 417        |
| Ago-22 | 48,757             | 295,455       | 412        |
| Set-22 | 337,982            | 341,382       | 402        |
| Oct-22 | 7,555              | 505,652       | 389        |
| Nov-22 | 37,558             | 128,496       | 384        |
| Dic-22 | 69,798             | 153,865       | 379        |

Rentabilidad de Selección Global I FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | SG IA  | SG IB  | Benchmark* |
|------------------|--------|--------|------------|
| Últimos 3 meses  | 5.1%   | 5.2%   | 3.0%       |
| Últimos 6 meses  | 1.7%   | 1.8%   | -2.8%      |
| Últimos 12 meses | -12.5% | -12.3% | -16.6%     |

\*El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 35% por la evolución del ACWI ETF y en un 65% por la evolución del IUSB ETF

### Retorno Histórico Sura Seleccion Global I vs Benchmark



A diciembre de 2022, el patrimonio del fondo SURA Selección Global I FMIV fue US\$ 13,299,155. El fondo muestra un rendimiento de -12.5% en la Serie A y -12.3% en la Serie B en los doce últimos meses del año, mientras que su benchmark rindió -16.6%.

Asimismo, al 31 de diciembre de 2022 el fondo no mantiene excesos de inversión.

.

---

### Fondo de Fondos Sura Bonos Globales FMIV

Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo ha sido constituido con una duración indefinida y fue inscrito en la sección de Fondos del Registro mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 140-2017-SMV/10.2 con de setiembre de 2017

### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión de inversión en los mercados de renta fija global a través de la inversión fondos mutuos e ETF de reconocidos managers internacionales. El fondo cuenta con dos series, una de clases distributiva y la otra de clase acumulativa.

### Política de Inversión del Fondo

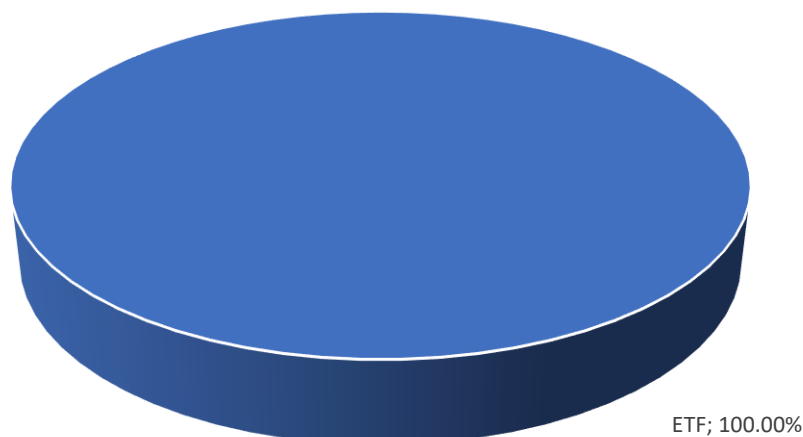
El Fondo de Fondos Sura Bonos Globales FMIV invierte como mínimo el 75% del patrimonio en cuotas de participación de fondos administrados por la misma Sociedad Administradora y/o por otras administradoras y/o ETF's; predominantemente en fondos representativos de instrumentos de deuda de diversos plazos y con duración del portafolio de inversión entre 360 días y 10 años. Estos fondos invertirán en empresas e instituciones constituidas en el Perú y/o en el extranjero, y sus respectivas cuotas de participación podrán ser denominadas indistintamente tanto en dólares como en otras monedas.

Asimismo, el Fondo invertirá entre el 0% y 25% restante del patrimonio en instrumentos de corto plazo (hasta 1 año) emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú (BCRP) y/o en depósitos e instrumentos representativos de estos emitidos por empresas del sistema financiero denominados tanto en dólares como en otras monedas. Además, el Fondo podrá realizar operaciones con derivados cambiarios (forwards) con fines de cobertura.

El Fondo invierte en instrumentos representativos de deuda de corto plazo con una clasificación igual o superior a CP-3 para el mercado local y hasta CP-3- para el internacional, así como en instrumentos emitidos por entidades financieras con una clasificación igual o superior a B-. En el caso de los instrumentos locales de largo plazo, el Fondo podrá invertir en instrumentos que tengan una clasificación igual o superior a BBB-; y para el mercado internacional, el Fondo podrá invertir en instrumentos que tengan una clasificación igual o superior a BB-.

---

Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                                 | %           |
|----------------------------------------------------------|-------------|
| ISHARES \$ SHORT DURATION HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF | 36.70%      |
| BLACK ROCK                                               | 34.94%      |
| ISHARES J.P. MORGAN \$ EM CORP BOND UCITS ETF            | 20.40%      |
| ISHARES \$ TREASURY BOND 1-3YR UCITS ETF USD             | 4.22%       |
| ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND UCITS ETF                 | 3.73%       |
| <b>TOTAL</b>                                             | <b>100%</b> |

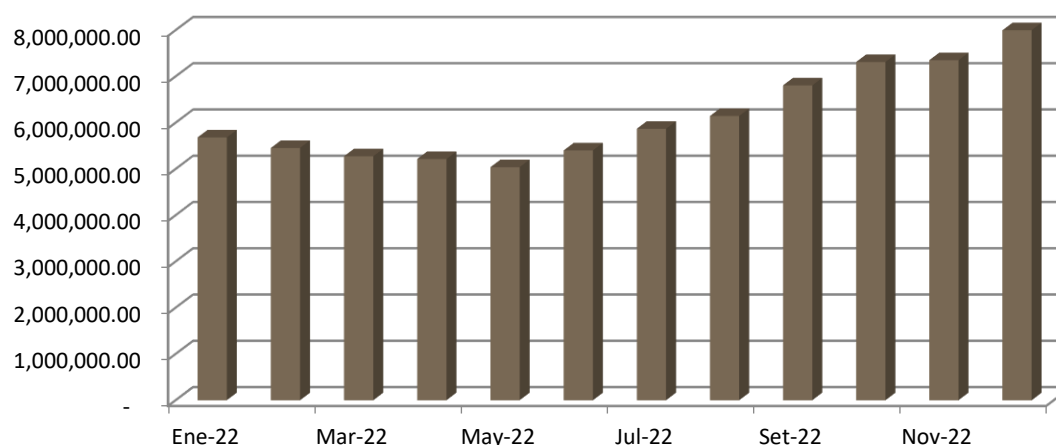
Nota: Información al 31/12/2022

Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Límites del prospecto - Sura Bonos Globales 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                        | 3.89      | Márgenes | Legales |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|----------|---------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                     | % Cartera | Min      | Max     |
| Según Tipo de Instrumentos                                                                                                                                    | 96.11     | -        | -       |
| <b>Cuotas de Fondos Mutuos</b>                                                                                                                                | 96.11     | 75.00    | 3.89    |
| Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o ETF | 96.11     | 75.00    | 3.89    |
| <b>Instrumentos de deuda directa</b>                                                                                                                          | -         | -        | 25.00   |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                                                                              | -         | Al 0     | 25.00   |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                            | -         | Al 0     | 25.00   |
| Instrumentos emitidos por empresas del Sistema Financiero                                                                                                     | -         | Al 0     | 25.00   |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                      | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                           | 96.11     | 75.00    | 3.89    |
| Inversiones en otras monedas USD (posición neta de coberturas)                                                                                                | -         | Al 0     | 25.00   |
| <b>Límite por Origen de Mercado</b>                                                                                                                           | 100.00    | na       | na      |
| Inversiones en el mercado local                                                                                                                               | -         | Al 0     | 100.00  |
| Inversiones en el mercado extranjero                                                                                                                          | 96.11     | Al 0     | 3.89    |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                         | -         | na       | na      |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                             | -         |          |         |
| CP - 1                                                                                                                                                        | -         | Al 0     | 25.00   |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                     | -         | Al 0     | 25.00   |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                             | -         |          |         |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                            | -         | Al 0     | 25.00   |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                         | -         | Al 0     | 25.00   |
| Menor a BBB-                                                                                                                                                  | -         | -        | -       |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                   | -         |          |         |
| Desde A+ hasta A-                                                                                                                                             | -         | -        | 25.00   |
| Desde B+ hasta B-                                                                                                                                             | -         | -        | 25.00   |
| Menor a B-                                                                                                                                                    | -         | -        | -       |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                  | -         |          |         |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3                                                                                                                                | -         | Al 0     | 25.00   |
| Largo Plazo: Desde AAA hasta BBB-                                                                                                                             | -         | Al 0     | 25.00   |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                   | -         | Al 0     | 25.00   |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                               | -         | Al 0     | 25.00   |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                 | -         | Al 0     | -       |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                 | -         | na       | na      |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                          | -         | Al 0     | 25.00   |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                      | -         | Al 0     | 25.00   |

Evolución del patrimonio (US\$)



Patrimonio Administrado

| Fecha  | Cuotas A  | Valor Cuota A | Cuotas B  | Valor Cuota B | US\$          |
|--------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------------|
| Ene-22 | 55,002.08 | 103.2814      | 55,380.09 | 92.3069       | 10,792,656.47 |
| Feb-22 | 53,667.82 | 101.6079      | 54,132.70 | 90.7495       | 10,365,592.87 |
| Mar-22 | 52,297.56 | 100.8424      | 53,826.05 | 89.9518       | 10,115,562.79 |
| Abr-22 | 52,943.87 | 98.4976       | 53,684.05 | 87.7951       | 9,928,043.97  |
| May-22 | 51,016.32 | 98.7688       | 51,620.24 | 87.9740       | 9,580,059.20  |
| Jun-22 | 56,753.21 | 95.1627       | 62,071.02 | 83.7087       | 10,596,672.05 |
| Jul-22 | 59,861.95 | 98.0447       | 60,200.13 | 86.1829       | 11,057,368.42 |
| Ago-22 | 63,641.21 | 96.5529       | 62,812.38 | 84.8101       | 11,471,863.79 |
| Set-22 | 72,216.90 | 94.2568       | 67,318.72 | 82.6594       | 12,371,457.81 |
| Oct-22 | 77,511.64 | 94.3441       | 67,978.87 | 82.6662       | 12,932,322.97 |
| Nov-22 | 75,822.66 | 96.9449       | 70,312.62 | 84.8843       | 13,319,055.87 |
| Dic-22 | 82,417.10 | 97.0478       | 72,694.60 | 83.7602       | 14,087,315.16 |

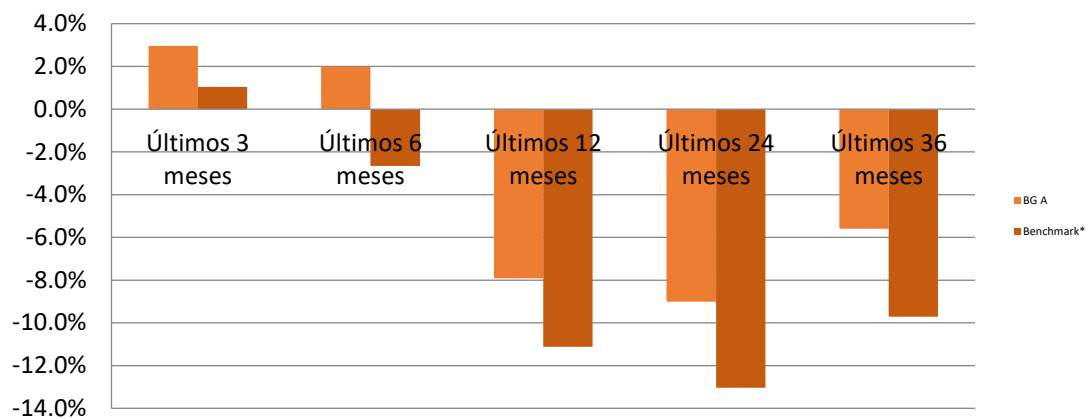
| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 55,003             | 127,664       | 234        |
| Feb-22 | 2,990              | 255,704       | 229        |
| Mar-22 | 63,997             | 233,458       | 227        |
| Abr-22 | 157,088            | 108,197       | 224        |
| May-22 | 209,147            | 578,787       | 227        |
| Jun-22 | 1,544,228          | 166,181       | 244        |
| Jul-22 | 376,243            | 237,132       | 247        |
| Ago-22 | 657,565            | 64,569        | 260        |
| Set-22 | 1,451,580          | 253,409       | 275        |
| Oct-22 | 655,872            | 107,110       | 275        |
| Nov-22 | 512,966            | 480,473       | 282        |
| Dic-22 | 923,940            | 165,612       | 292        |

Rentabilidad de Fondo de Fondos SURA Bonos Globales FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | BG A  | BG B   | Benchmark* |
|------------------|-------|--------|------------|
| Últimos 3 meses  | 3.0%  | 1.3%   | 1.0%       |
| Últimos 6 meses  | 2.0%  | 0.1%   | -2.7%      |
| Últimos 12 meses | -7.9% | -11.1% | -11.1%     |
| Últimos 24 meses | -9.0% | -15.0% | -13.0%     |
| Últimos 36 meses | -5.6% | -14.8% | -9.7%      |

\*El indicador de comparación de rendimientos está compuesto por la evolución de un índice compuesto en un 75% por la evolución del iShares Core Total USD Bond Market ETF y en un 25% por el promedio de las tasas de interés pasivas en moneda extranjera a más de 360 días

### Retorno Histórico Sura Bonos Globales vs Benchmark



A diciembre de 2022, el patrimonio del Fondo de Fondos SURA Bonos Globales fue US\$ 14,087,315. En los últimos 12 meses, la serie A del fondo muestra un rendimiento de -7.9% y la serie B -11.1% mientras que su benchmark rindió -11.1%.

Asimismo, al 31 de diciembre de 2022 el fondo no mantiene excesos de inversión.

### Fondo de Fondo Sura Real Estate Global Income FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 037-2018-SMV/10.2 de fecha 03 de abril de 2018 con el nombre de Fondos de Fondos Sura Real Estate Global Income – FMIV.

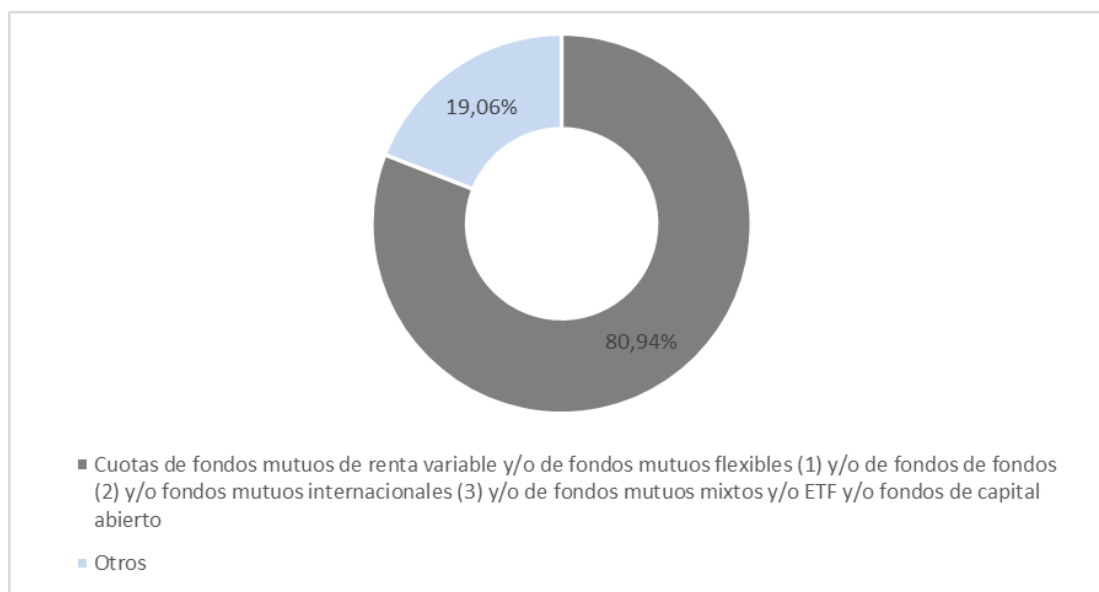
#### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión que le permita acceder a activos inmobiliarios y/o de renta de bienes inmuebles en los Estados Unidos y otros países del mundo. Tiene como objetivo la búsqueda del crecimiento del capital y la generación de flujos de manera periódica.

#### Política de Inversión del Fondo

Las inversiones se realizan principalmente en fondos y ETF's del exterior, de capital abierto (Open Ended) que a su vez invierten en activos inmobiliarios y/o de renta de bienes inmuebles en los Estados Unidos y otros países del mundo, con una exposición mínima de 75%.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

#### Inversiones del Fondo por Emisor

| Emisores                        | %             |
|---------------------------------|---------------|
| OAKTREE REAL ESTATE INCOME      | 45,10%        |
| TA REALTY CORE PROPERTY FUND LP | 26,65%        |
| TA REALTY LOGISTICS FUND LP     | 9,19%         |
| Caja y bancos                   | 19,06%        |
| <b>Total</b>                    | <b>100,0%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Balance al 31 diciembre 2022

| Política de Inversiones                                                                                                                                                                                              | Estado límite | Valor observado | % Mínimo sobre el activo total | % Máximo sobre el activo total |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>Según Tipo de Instrumento</b>                                                                                                                                                                                     |               |                 |                                |                                |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                                                |               |                 |                                |                                |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF y/o fondos de capital abierto. | OK            | 80.36%          | 75%                            | 100%                           |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                                               |               |                 |                                |                                |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú                                                                                                                                 |               |                 | 0%                             | 25%                            |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                                                                                   | OK            | 18.93%          | 0%                             | 25%                            |
| Instrumentos emitidos por empresas del Sistema Financiero e instrumentos representativos de estos.                                                                                                                   |               |                 | 0%                             | 25%                            |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                                                             |               |                 |                                |                                |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de coberturas)                                                                                                                                                  | OK            | 99.29%          | 0%                             | 100%                           |
| Inversiones en otras monedas (posición neta de coberturas)                                                                                                                                                           |               |                 | 0%                             | 100%                           |
| <b>Según Mercado</b>                                                                                                                                                                                                 |               |                 |                                |                                |
| Mercado Local                                                                                                                                                                                                        | OK            | 13.77%          | 0%                             | 100%                           |
| Mercado Extranjero                                                                                                                                                                                                   | OK            | 80.36%          | 0%                             | 100%                           |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                                                |               |                 |                                |                                |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                                                    |               |                 |                                |                                |
| Desde CP - 1+ hasta CP - 1-                                                                                                                                                                                          | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Desde CP - 2+ hasta CP - 3                                                                                                                                                                                           | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Menor a CP - 3-                                                                                                                                                                                                      | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                                                    |               |                 |                                |                                |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                                                   | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                                                | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Menor a BBB-                                                                                                                                                                                                         | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                                                          |               |                 |                                |                                |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                                                    | OK            | 13.77%          | 0%                             | 25%                            |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                                                     | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Menor a B-                                                                                                                                                                                                           | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                                                         |               |                 |                                |                                |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3-                                                                                                                                                                                      | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Corto Plazo: Menor a CP-3                                                                                                                                                                                            | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                                                          | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Largo Plazo: menor a BB-                                                                                                                                                                                             | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                                                      |               |                 |                                |                                |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                                                                                                                                               |               |                 | 0%                             | 0%                             |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                                                        |               |                 |                                |                                |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                                                 |               |                 | 0%                             | 100%                           |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                                                             |               |                 | 0%                             | 50%                            |
| Swap                                                                                                                                                                                                                 |               |                 | 0%                             | 0%                             |
| Inversiones No Permitidas                                                                                                                                                                                            | OK            | 0.000%          |                                | 0%                             |

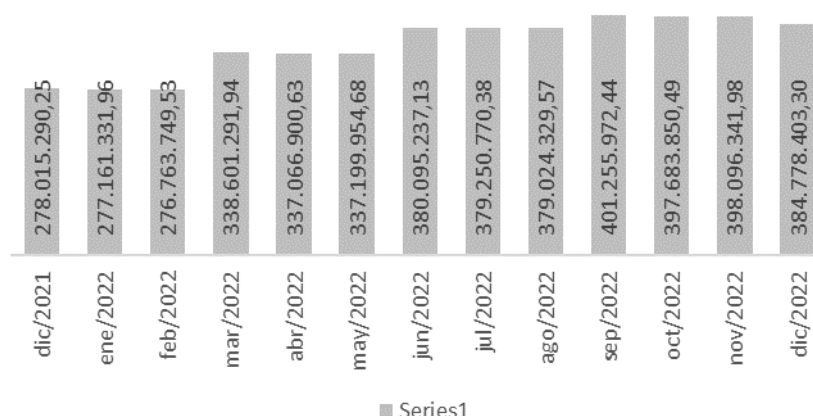
Patrimonio Administrado (USD)

| Fecha      | Cuotas    | Valor Cuota | Patrimonio USD |
|------------|-----------|-------------|----------------|
| 31/12/2021 | 21.372,00 | 13.008,39   | 278.015.291    |
| 31/01/2022 | 21.327,75 | 12.995,34   | 277.161.333    |
| 28/02/2022 | 21.327,75 | 12.976,70   | 276.763.750    |
| 31/03/2022 | 24.462,05 | 13.841,90   | 338.601.292    |
| 30/04/2022 | 24.374,99 | 13.828,39   | 337.066.900    |
| 31/05/2022 | 24.374,99 | 13.833,85   | 337.199.954    |
| 30/06/2022 | 26.420,84 | 14.386,19   | 380.095.238    |
| 31/07/2022 | 26.381,80 | 14.375,13   | 379.241.739    |
| 31/08/2022 | 26.381,80 | 14.366,56   | 379.015.537    |
| 30/09/2022 | 27.733,16 | 14.468,45   | 401.255.972    |
| 31/10/2022 | 27.490,93 | 14.466,00   | 397.683.850    |
| 30/11/2022 | 27.490,93 | 14.481,01   | 398.096.342    |
| 31/12/2022 | 28.013,95 | 13.735,24   | 384.778.403    |

Suscripciones, Rescates y Partícipes

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | -                  | 575,249       | 1801       |
| Feb-22 | -                  | -             | 1800       |
| Mar-22 | 43,384,579         | -             | 2150       |
| Abr-22 | 75,000             | 1,279,354     | 2154       |
| May-22 | -                  | -             | 2153       |
| Jun-22 | 29,432,108         | -             | 2370       |
| Jul-22 | 25,000             | 586,540       | 2365       |
| Ago-22 | -                  | -             | 2369       |
| Set-22 | 19,552,210         | -             | 2527       |
| Oct-22 | -                  | 3,503,788     | 2520       |
| Nov-22 | -                  | -             | 2523       |
| Dic-22 | 7,183,824          | -             | 2586       |

Evolución del patrimonio



Rentabilidad de SURA Real Estate Global Incomevs. Benchmark

|                  | SURA REGI | Benchmark |
|------------------|-----------|-----------|
| Últimos 3 meses  | 1,37%     | 0,5%      |
| Últimos 6 meses  | 6,22%     | 1,1%      |
| Últimos 12 meses | 23,52%    | 12,4%     |

\*El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 95% por la evolución del iShares International Developed Real Estate ETF y en un 5% por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

---

\*El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 95% por la evolución del iShares International Developed Real Estate ETF y en un 5% por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

Al cierre de año, el fondo presentó un exceso en la política de inversión por tipo de instrumento, configurado como causa no atribuible no previstas en la política de inversiones.

---

### Fondo de Fondo Deuda Privada Global FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 133-2021-SMV/10.2 de fecha 10 de diciembre de 2021 con el nombre de Fondos de Fondos Deuda Privada Global – FMIV.

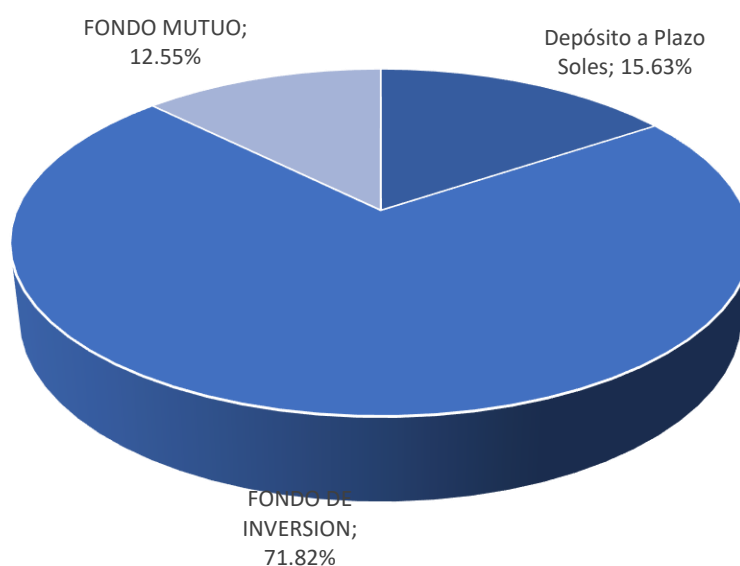
#### Objetivo de Inversión del Fondo

Ofrecer a sus partícipes una alternativa de inversión que le permita acceder a activos de Deuda Privada principalmente en Estados Unidos y Europa. Tiene como objetivo la generación de flujos de manera periódica y la protección del capital.

#### Política de Inversión del Fondo

Las inversiones se realizan principalmente en fondos y ETF's del exterior, de capital abierto (Open Ended) que a su vez invierten sus activos en préstamos directos a compañías, obligaciones de deuda garantizada (Collateralized loan obligations o CLO's), créditos comerciales, créditos residenciales, entre otros, a nivel global, principalmente Estados Unidos y Europa, con una exposición mínima de 75%.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

#### Inversiones del Fondo por Emisor

| Emisores                                 | %             |
|------------------------------------------|---------------|
| PINEBRIDGE FLEXIBLE CREDIT OFFSHORE FUND | 18,59%        |
| CRESCENT SYNDICATED CREDIT SOLUTIONS     | 53,23%        |
| Caja y bancos                            | 28,18%        |
| <b>Total</b>                             | <b>100,0%</b> |

Nota: Información al 31/12/2022

Diversificación del portafolio según la política de inversiones

Balance al 31 diciembre 2022

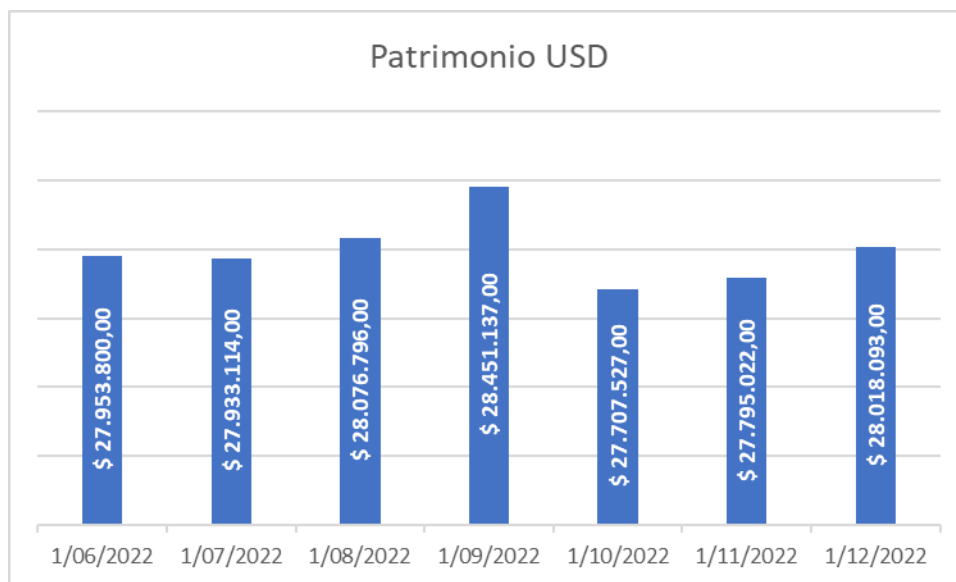
| Política de Inversiones                                                                                                                                                                                                           | Estado límite | Valor observado | % Mínimo sobre el activo total | % Máximo sobre el activo total |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>Según Tipo de Instrumento</b>                                                                                                                                                                                                  |               |                 |                                |                                |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                                                             |               |                 |                                |                                |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF y/o fondos de capital abierto (Open Ended). | EXCESO        | 71.75%          | 75%                            | 100%                           |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                                                            |               |                 |                                |                                |
| Cuotas de fondos mutuos de instrumentos de deuda y/o de fondos mutuos internacionales y/o ETF.                                                                                                                                    | OK            | 12.54%          | 0%                             | 25%                            |
| Depósitos en entidades bancarias o instrumentos representativos de estos                                                                                                                                                          | OK            | 15.62%          | 0%                             | 25%                            |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú.                                                                                                                                             |               |                 | 0%                             | 25%                            |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                                                                          |               |                 |                                |                                |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                                                                                                                                                                             | OK            | 99.92%          | 0%                             | 100%                           |
| Inversiones en otras monedas                                                                                                                                                                                                      |               |                 | 0%                             | 100%                           |
| <b>Según Mercado</b>                                                                                                                                                                                                              |               |                 |                                |                                |
| Mercado Local                                                                                                                                                                                                                     | EXCESO        | 28.17%          | 0%                             | 25%                            |
| Mercado Extranjero                                                                                                                                                                                                                | EXCESO        | 71.75%          | 75%                            | 100%                           |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                                                             |               |                 |                                |                                |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                                                                 |               |                 |                                |                                |
| Desde CP - 1+ hasta CP - 1-                                                                                                                                                                                                       | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Desde CP - 2+ hasta CP - 3                                                                                                                                                                                                        | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Menor a CP - 3-                                                                                                                                                                                                                   | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                                                                 |               |                 |                                |                                |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                                                                | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                                                             | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Menor a BBB-                                                                                                                                                                                                                      | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                                                                       |               |                 |                                |                                |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                                                                 | OK            | 15.62%          | 0%                             | 25%                            |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                                                                  | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Menor a B-                                                                                                                                                                                                                        | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                                                                      |               |                 |                                |                                |
| Corto Plazo: no menor a CP - 4-                                                                                                                                                                                                   | OK            | 0.00%           | 0%                             | 25%                            |
| Corto Plazo: Menor a CP-4                                                                                                                                                                                                         | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                                                                       | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| Largo Plazo: menor a BB-                                                                                                                                                                                                          | OK            | 0.00%           | 0%                             | 0%                             |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                                                                   |               |                 |                                |                                |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                                                                                                                                                                            |               |                 | 0%                             | 0%                             |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                                                                     |               |                 |                                |                                |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                                                              |               |                 | 0%                             | 100%                           |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                                                                          |               |                 | 0%                             | 50%                            |
| Swap                                                                                                                                                                                                                              |               |                 | 0%                             | 50%                            |

Patrimonio Administrado (USD)

| Fecha  | Cuotas   | Valor Cuota | Cuotas B   |
|--------|----------|-------------|------------|
| Ene-22 | 2,795.39 | 10,000.00   | 27,953,901 |
| Feb-22 | 2,795.39 | 9,992.65    | 27,933,334 |
| Mar-22 | 2,795.39 | 10,044.86   | 28,079,283 |
| Abr-22 | 2,795.39 | 10,178.16   | 28,451,920 |
| May-22 | 2,795.39 | 9,912.00    | 27,707,888 |
| Jun-22 | 2,795.39 | 9,943.25    | 27,795,243 |
| Jul-22 | 2,795.39 | 10,023.28   | 28,018,981 |

Suscripciones, Rescates y Partícipes

Evolución del patrimonio



---

Rentabilidad de SURA Deuda Privada Global vs. Benchmark

|                 | SURA DPG | Benchmark |
|-----------------|----------|-----------|
| Últimos 3 meses | 1,78%    | 2,11%     |

\*El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 95% por la evolución de un índice compuesto en una proporción 60/40 entre el *Cliffwater Direct Lending Index* y *Morningstar Leveraged Loan Total Return Index* respectivamente, y en un 5% por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

\*La información se comparte con corte a 30/09/2022, dado que el benchmark no se ha podido actualizar a la fecha.

Al cierre de año, el fondo presentó un exceso en la política de inversión por tipo de instrumento, configurado como causa no atribuible no previstas en la política de inversiones.

## Fondo Sura Deuda Latam Dólares FMIV (Fondo Institucional)

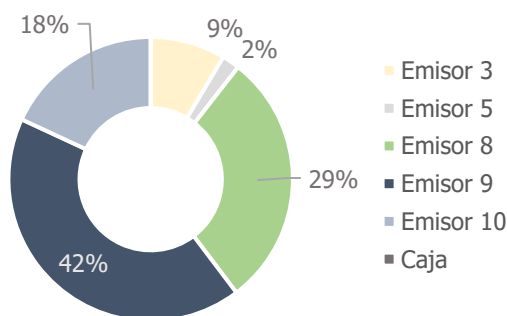
### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

Administrado por Fondos Sura SAF S.A.C, el 07 de diciembre de 2018 se inscribió en los registros de la Superintendencia del Mercado de Valores bajo Régimen Simplificado como Fondo Mutuo dirigido exclusivamente a Inversionistas Institucionales.

### Objetivo de Inversión del Fondo

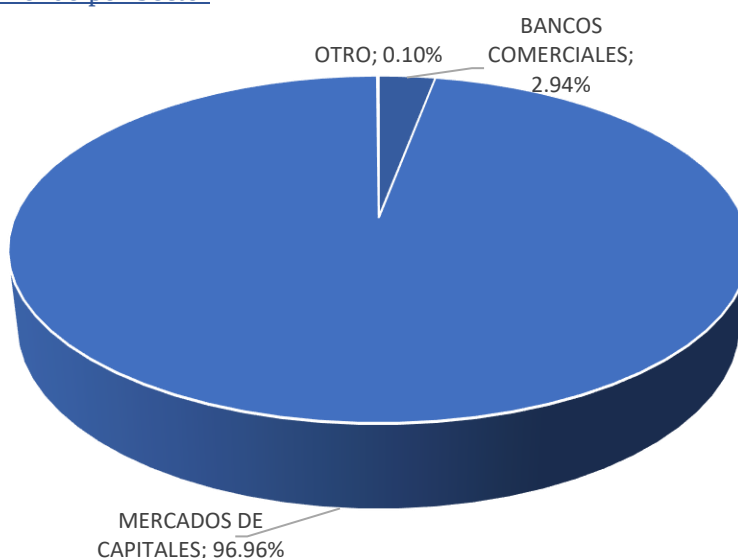
El Fondo tiene por objeto principal invertir en títulos representativos de derechos sobre obligaciones o títulos de deuda, emitidos en el mercado local o internacional, por empresas e instituciones constituidas en el Perú o en el extranjero. Además, podrá invertir en cuotas de fondos mutuos, fondos de inversión y/o ETF que inviertan 100% en instrumentos representativos de deuda. El Fondo mantendrá a vencimiento dichos instrumentos, repartirá flujos trimestrales y/o semestrales producto de la acumulación del cobro de los cupones y/o amortizaciones de los instrumentos representativos de deuda que componen el portafolio, siempre que los emisores cumplan con el pago de estos.

### Inversiones del Fondo por Emisor



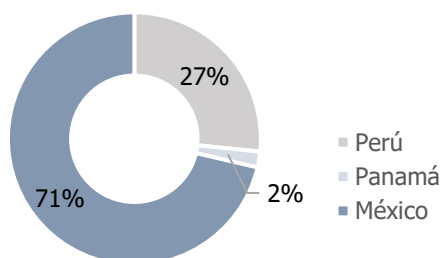
Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Sector



Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por País



Nota: Información al 31/12/2022

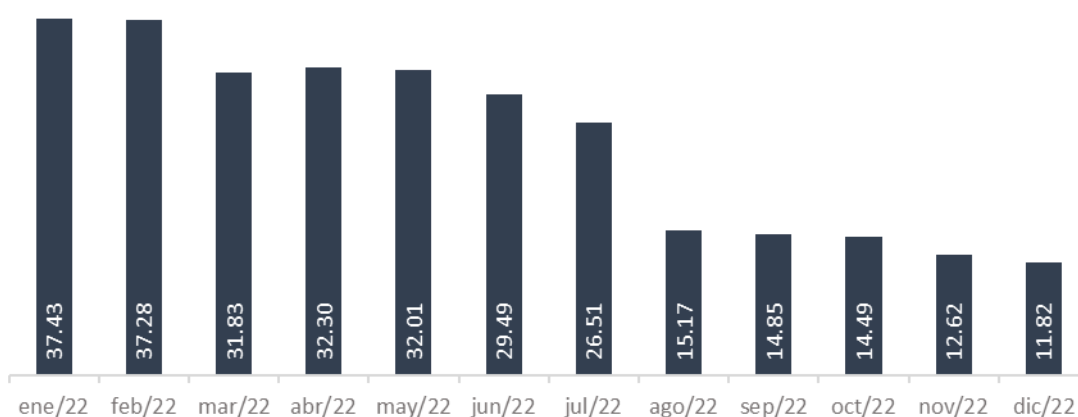
Diversificación del portafolio según la política de inversiones

| Evaluación de Política de Inversión - Límites Fondo Deuda Latam Dólares |           |       |        |         | 31/12/2022 |
|-------------------------------------------------------------------------|-----------|-------|--------|---------|------------|
| Límites por instrumento                                                 |           |       |        |         |            |
| Tipo Instrumento                                                        | % Activo  | % Mín | % Máx  | Márgen  |            |
| Instrumentos representativos de Patrimonio                              | 0.00%     | 0%    | 15%    | 15.00%  |            |
| Instrumentos representativos de Deuda                                   | 99.64%    | 85%   | 100%   | 14.64%  |            |
| Emisiones Gobierno y Banco Central                                      | 0.00%     | 0%    | 100%   | 100.00% |            |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                      | 2.93%     | 0%    | 100%   | 97.07%  |            |
| Emisiones de empresas financieras o corporativas                        | 0.00%     | 0%    | 100%   | 100.00% |            |
| Operaciones de reporte                                                  | 0.00%     | 0%    | 100%   | 100.00% |            |
| Fondos de deuda                                                         | 96.71%    | 0%    | 100%   | 3.29%   |            |
| Límites según moneda                                                    |           |       |        |         |            |
| Moneda                                                                  | % Activo  | % Mín | % Máx  | Márgen  |            |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                   | 99.6%     | 0%    | 100%   | 0%      |            |
| Inversiones en otras monedas                                            | 0.4%      | 0%    | 100%   | 100%    |            |
| Límites según mercado                                                   |           |       |        |         |            |
| Mercado                                                                 | % Activo  | % Mín | % Máx  | Márgen  |            |
| Inversiones en el mercado local                                         | 99.6%     | 0%    | 100%   | 0%      |            |
| Inversiones en el mercado extranjero                                    | 0.0%      | 0%    | 100%   | 100%    |            |
| Límites según calificación                                              |           |       |        |         |            |
| Calificación                                                            | % Activo  | % Mín | % Máx  | Márgen  |            |
| <b>Mercado local</b>                                                    |           |       |        |         |            |
| Instrumentos de corto plazo                                             |           |       |        |         |            |
| desde CP-1+ hasta CP-1-                                                 | 0.0%      | 0.0%  | 25.0%  | 25.0%   |            |
| desde CP-2+ hasta CP-3                                                  | 0.0%      | 0.0%  | 25.0%  | 25.0%   |            |
| Instrumentos de largo plazo                                             |           |       |        |         |            |
| desde AAA hasta A-                                                      | 0.0%      | 0.0%  | 100.0% | 100.0%  |            |
| desde BBB+ hasta BBB-                                                   | 0.0%      | 0.0%  | 50.0%  | 50.0%   |            |
| Menor a BBB-                                                            | 49.3%     | 0.0%  | 0.0%   | -49.3%  |            |
| Entidades financieras                                                   |           |       |        |         |            |
| Desde A+ hasta B+                                                       | 50.3%     | 0.0%  | 100.0% | 49.7%   |            |
| Desde B hasta B-                                                        | 0.0%      | 0.0%  | 50.0%  | 50.0%   |            |
| <b>Mercado internacional</b>                                            |           |       |        |         |            |
| Corto plazo: no menor a CP-2-                                           | 0.0%      | 0.0%  | 25.0%  | 25.0%   |            |
| Largo plazo: no menor a B-                                              | 0.0%      | 0.0%  | 100.0% | 100.0%  |            |
| Largo plazo: menor a B-                                                 | 0.0%      | 0.0%  | 0.0%   | 0.0%    |            |
| Estado Peruano                                                          | 0.0%      | 0.0%  | 25.0%  | 25.0%   |            |
| Inversiones no sujetas a clasificación                                  | 0.0%      | 0.0%  | 25.0%  | 25.0%   |            |
| Derivados                                                               |           |       |        |         |            |
|                                                                         | % Cartera | % Mín | % Máx  | Márgen  |            |
| Forwards en la moneda del valor cuota                                   | 0%        | 0%    | 100%   | 100%    |            |
| Forwards en otras monedas                                               | 0%        | 0%    | 100%   | 100%    |            |
| Swap                                                                    | 17%       | 0%    | 100%   | 83%     |            |
| Futuros                                                                 | 0%        | 0%    | 100%   | 100%    |            |
| Opciones                                                                | 0%        | 0%    | 100%   | 100%    |            |

Patrimonio Administrado (US\$)

| Fecha  | Valor Cuota | Patrimonio       |
|--------|-------------|------------------|
| ene-22 | \$ 9,774.00 | \$ 37,429,997.74 |
| feb-22 | \$ 9,734.57 | \$ 37,279,012.79 |
| mar-22 | \$ 9,495.37 | \$ 31,827,335.57 |
| abr-22 | \$ 9,635.14 | \$ 32,295,826.15 |
| may-22 | \$ 9,548.38 | \$ 32,005,016.61 |
| jun-22 | \$ 9,377.08 | \$ 29,488,639.69 |
| jul-22 | \$ 8,429.46 | \$ 26,508,599.67 |
| ago-22 | \$ 7,387.68 | \$ 15,173,354.09 |
| set-22 | \$ 7,229.71 | \$ 14,848,909.91 |
| oct-22 | \$ 7,055.93 | \$ 14,491,981.24 |
| nov-22 | \$ 6,812.81 | \$ 12,622,835.73 |
| dic-22 | \$ 6,381.72 | \$ 11,824,100.21 |

Patrimonio Administrado (US\$)



Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas | Valor Cuota | US\$       |
|--------|--------|-------------|------------|
| Ene-22 | 3,830  | 9,774.00    | 37,429,998 |
| Feb-22 | 3,830  | 9,734.57    | 37,279,013 |
| Mar-22 | 3,352  | 9,495.37    | 31,827,336 |
| Abr-22 | 3,352  | 9,635.14    | 32,295,826 |
| May-22 | 3,352  | 9,548.38    | 32,005,017 |
| Jun-22 | 3,145  | 9,377.08    | 29,488,640 |
| Jul-22 | 3,145  | 8,429.46    | 26,508,600 |
| Ago-22 | 2,054  | 7,387.68    | 15,173,354 |
| Set-22 | 2,054  | 7,229.71    | 14,848,910 |
| Oct-22 | 2,054  | 7,055.93    | 14,491,981 |
| Nov-22 | 1,853  | 6,812.81    | 12,622,836 |
| Dic-22 | 1,853  | 6,381.72    | 11,824,100 |

| Mes    | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Partícipes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | -                  | -             | 10         |
| Feb-22 | -                  | -             | 10         |
| Mar-22 | -                  | -             | 10         |
| Abr-22 | -                  | -             | 10         |
| May-22 | -                  | -             | 10         |
| Jun-22 | -                  | -             | 10         |
| Jul-22 | -                  | -             | 10         |
| Ago-22 | -                  | 8,270,640     | 10         |
| Set-22 | -                  | -             | 10         |
| Oct-22 | -                  | -             | 10         |
| Nov-22 | -                  | 1,409,850     | 10         |
| Dic-22 | -                  | -             | 10         |

A diciembre de 2022, el patrimonio del Fondo Sura Deuda Latam Dólares FMIV fue US\$ 11,824,100.21 dólares americanos.

De acuerdo con su política de inversión, al cierre de año, el fondo presenta un exceso de inversión del 49.3% en instrumentos de largo plazo con un rating menor de BBB-. Este exceso no es atribuible al Gestor, ha sido informado tanto a los inversionistas como al Regulador y se encuentra en proceso de regularización de acuerdo con los tiempos establecidos en el Reglamento de Participación del fondo.

#### **Hechos Relevantes del Periodo:**

- Durante el periodo en mención, el portafolio del Fondo sufrió una desvalorización producto de la materialización de dos eventos de crédito presentados en los Emisores 8 y 9 del en los meses de febrero y agosto, respectivamente. Los hechos en cuestión han sido informados en espacios formales con inversionistas. En atención a lo anterior, la Sociedad Administradora ha desistido del cobro de comisión de administración desde el 1 de setiembre del 2022.

#### **Fondo de Fondo Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV**

##### **Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores**

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 020-2018-SMV/10.2 de 14 de febrero de 2018 , con el nombre de Fondo de Fondos Sura Acciones Globales – FMIV, mediante OFICIO N° 3944-2021-SMV/10, de fecha 01 de octubre de 2021, la SMV aprobó la modificación de la denominación del fondo mutuo de inversión en valores "Sura Acciones Globales FMIV" a "Fondo de Fondos Sura Acciones Globales Sostenibles FMIV".

##### **Objetivo de Inversión del Fondo**

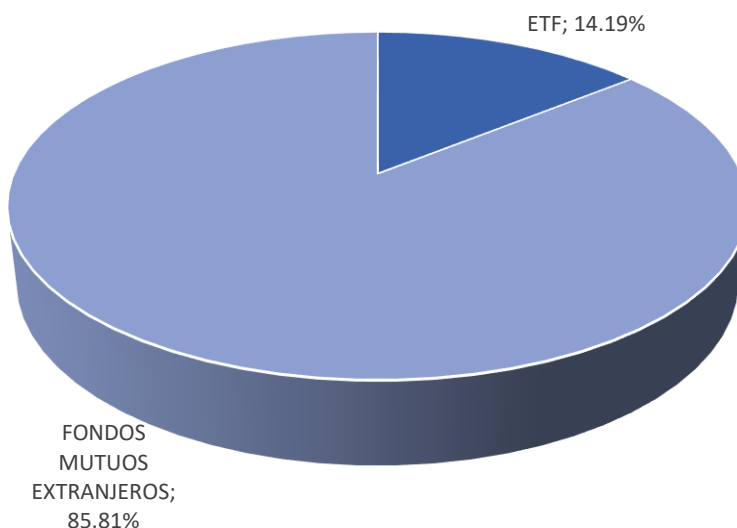
Ofrecer una alternativa de inversión para personas naturales y/o jurídicas interesadas en realizar operaciones financieras en un portafolio diversificado a nivel global con horizonte de mediano y largo plazo asociado a un riesgo alto, a través de una cartera compuesta principalmente por

instrumentos de capitalización nacionales y extranjeros, expuestos a modelos de negocios que sean sustentables bajo criterios ESG.

#### Política de Inversión del Fondo

El Fondo de Fondos SURA Acciones Globales FMIV invierte como mínimo el 75% del patrimonio en cuotas de participación de fondos administrados por la misma sociedad administradora y/o por otras administradoras y/o ETF's; predominantemente en fondos representativos de instrumentos de participación en el patrimonio. Así mismo, el Fondo invertirá entre el 0% y 25% restante del patrimonio en depósitos en entidades bancarias, instrumentos representativos de éstos o en instrumentos representativos de deuda emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                                               | %           |
|--------------------------------------------------------|-------------|
| SCHRODER GLOB SUST GRTH-CA                             | 45.32%      |
| JANUS HENDERSON HORIZON GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY FUNI | 40.49%      |
| MSCI WORLD ESG UCITS ETF                               | 10.10%      |
| ISHARES SUSTAINABLE MSCI GLOBAL IMPACT ETF             | 4.09%       |
| <b>TOTAL</b>                                           | <b>100%</b> |

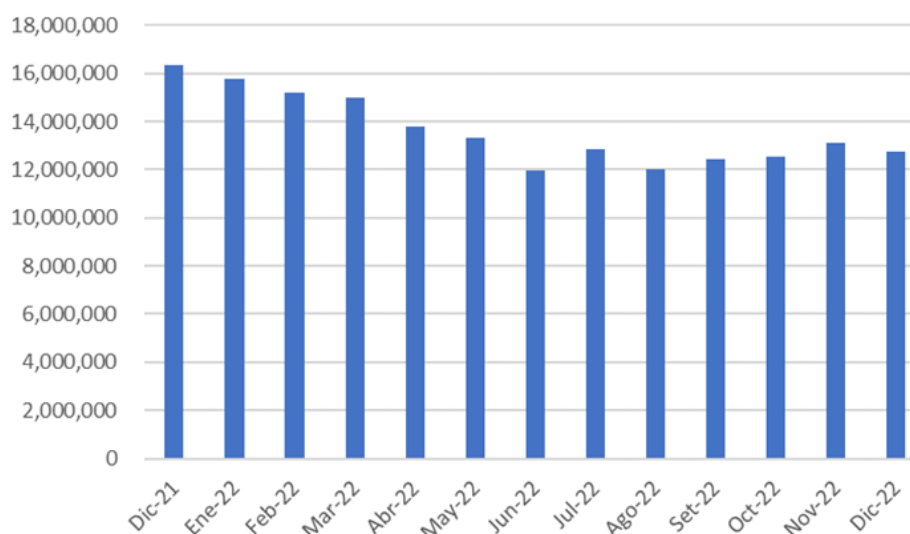
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

### Límites del prospecto - Sura Acciones Globales 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                                                                                                | 1.04          | Márgenes     | Legales       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|---------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                                                                                             | % Cartera     | Min          | Max           |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                                                                                                 | <b>100.00</b> | <b>75.00</b> | <b>Al 100</b> |
| Cuotas de fondos mutuos de renta variable y/o de fondos mutuos flexibles (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o de fondos mutuos mixtos y/o ETF | 98.96         | 75.00        | 1.04          |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                                                                                                | <b>-</b>      | <b>Al 0</b>  | <b>25.00</b>  |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00         |
| Depósitos en el Sistema Financiero                                                                                                                                                    | -             | Al 0         | 25.00         |
| Instrumentos emitidos por empresas del Sistema Financiero                                                                                                                             | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                                                                                              | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Inversiones en moneda del valor cuota (posición neta de cobros)                                                                                                                       | 98.96         | Al 0         | 100.00        |
| Inversiones en otras monedas                                                                                                                                                          | -             | Al 0         | 100.00        |
| <b>Límite por Origen de Mercado</b>                                                                                                                                                   | <b>100.00</b> | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Inversiones en el mercado local                                                                                                                                                       | -             | Al 0         | 100.00        |
| Inversiones en el mercado extranjero                                                                                                                                                  | 98.96         | Al 0         | 100.00        |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                                                                                                 | <b>-</b>      | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>      |
| CP - 1                                                                                                                                                                                | -             | Al 0         | 25.00         |
| Desde CP - 2 hasta CP - 3                                                                                                                                                             | -             | Al 0         | 25.00         |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                                                                                                     | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>      |
| Desde AAA hasta A-                                                                                                                                                                    | -             | Al 0         | -             |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                                                                                                 | -             | Al 0         | -             |
| Menor a BBB-                                                                                                                                                                          | -             | -            | -             |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                                                                                                           | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>      |
| Desde A+ hasta B+                                                                                                                                                                     | -             | Al 0         | 25.00         |
| Desde B hasta B-                                                                                                                                                                      | -             | Al 0         | 25.00         |
| Menor a B-                                                                                                                                                                            | -             | -            | -             |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                                                                                                          | <b>-</b>      | <b>-</b>     | <b>-</b>      |
| Corto Plazo: no menor a CP - 3                                                                                                                                                        | -             | Al 0         | 25.00         |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                                                                                                           | -             | Al 0         | -             |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                                                                                                       | <b>-</b>      | <b>Al 0</b>  | <b>25.00</b>  |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                                                                                                         | <b>-</b>      | <b>Al 0</b>  | <b>-</b>      |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                                                                                                         | <b>na</b>     | <b>na</b>    | <b>na</b>     |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                                                                                                  | -             | Al 0         | 100.00        |
| Forwards a otras monedas                                                                                                                                                              | -             | Al 0         | 50.00         |
| Swaps                                                                                                                                                                                 | -             | -            | 100.00        |
| Futuros                                                                                                                                                                               | -             | -            | 20.00         |
| Opciones                                                                                                                                                                              | -             | -            | 20.00         |

Patrimonio Administrado (US\$)



Evolución del patrimonio

| Mes    | Cuotas    | Valor Cuota | Patrimonio (US\$) |
|--------|-----------|-------------|-------------------|
| Dic-21 | 1,144,051 | 14.28       | 16,334,578        |
| Ene-22 | 1,199,829 | 13.13       | 15,751,101        |
| Feb-22 | 1,177,970 | 12.88       | 15,177,872        |
| Mar-22 | 1,131,677 | 13.24       | 14,979,919        |
| Abr-22 | 1,123,535 | 12.25       | 13,767,892        |
| May-22 | 1,116,424 | 11.92       | 13,310,657        |
| Jun-22 | 1,102,000 | 10.86       | 11,970,046        |
| Jul-22 | 1,082,950 | 11.86       | 12,844,695        |
| Ago-22 | 1,057,311 | 11.36       | 12,009,286        |
| Set-22 | 1,211,231 | 10.28       | 12,453,750        |
| Oct-22 | 1,161,652 | 10.79       | 12,534,562        |
| Nov-22 | 1,148,793 | 11.44       | 13,140,980        |
| Dic-22 | 1,135,041 | 11.25       | 12,764,930        |

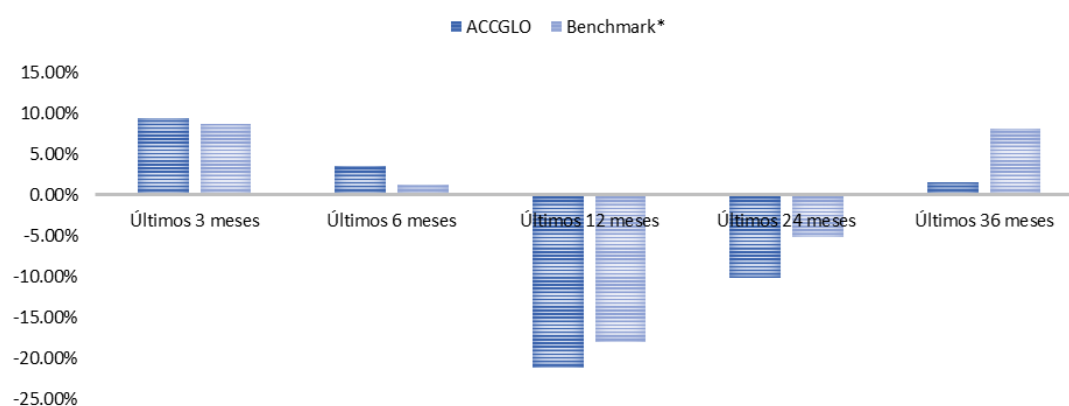
| Fecha  | Suscripciones US\$ | Rescates US\$ | Participes |
|--------|--------------------|---------------|------------|
| Ene-22 | 1,150,272          | 401,449       | 691        |
| Feb-22 | 335,939            | 603,572       | 669        |
| Mar-22 | 295,486            | 879,946       | 653        |
| Abr-22 | 229,393            | 328,320       | 648        |
| May-22 | 73,887             | 153,277       | 636        |
| Jun-22 | 56,630             | 217,591       | 627        |
| Jul-22 | 8,792              | 220,676       | 612        |
| Ago-22 | 121,440            | 420,199       | 599        |
| Set-22 | 2,085,646          | 395,954       | 729        |
| Oct-22 | 2,250              | 509,786       | 698        |
| Nov-22 | 5,542              | 149,667       | 680        |
| Dic-22 | 11,700             | 168,846       | 673        |

Rentabilidad de Fondo de Fondos SURA Acciones Globales Sostenibles FMIV vs. Benchmark

| al 31/12/2022    | ACCGLO  | Benchmark* |
|------------------|---------|------------|
| Últimos 3 meses  | 9.38%   | 8.66%      |
| Últimos 6 meses  | 3.54%   | 1.23%      |
| Últimos 12 meses | -21.23% | -18.00%    |
| Últimos 24 meses | -10.22% | -5.08%     |
| Últimos 36 meses | 1.56%   | 8.22%      |

\*El indicador de comparación de rendimientos es un índice compuesto en un 95% por la evolución del iShares MSCI ACWI ETF y un 5% por el promedio de las tasas pasivas en moneda extranjera de 0 a 30 días, ofrecidas por los cuatro principales bancos del país, ponderadas en función a las obligaciones con el público del banco respectivo.

**RETORNO HISTÓRICO SURA ACCIONES GLOBALES  
SOSTENIBLES VS BENCHMARK**



A diciembre de 2022, “Fondo de Fondos SURA Acciones Globales Sostenibles FMIV” administró un patrimonio de US\$ 12’764,930, obteniendo un rendimiento de -21.23%.

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos por política de inversión.

---

### Fondo de Fondos Sura Corto Plazo Global FMIV

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 047-2022-SMV/10.2 de 26 de abril de 2022, con el nombre de Fondo de Fondos Sura Corto Plazo Global – FMIV.

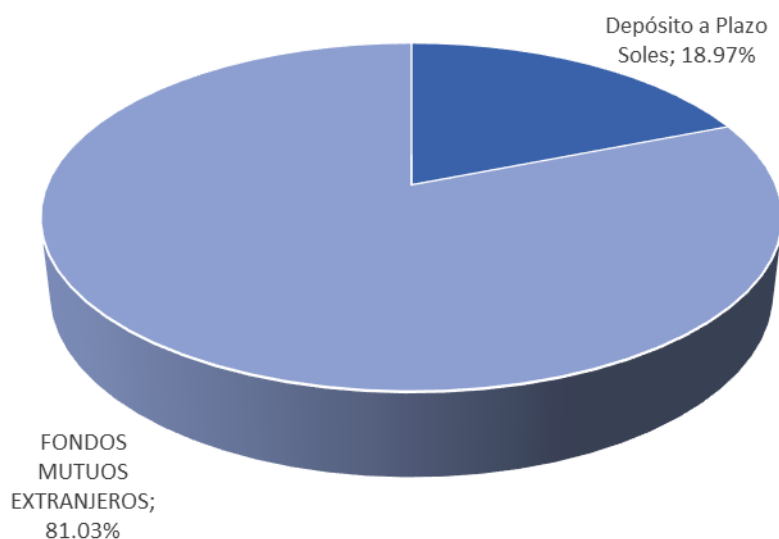
#### Objetivo de Inversión del Fondo

El Fondo tiene como objetivo ofrecer una alternativa de inversión para personas naturales y/o jurídicas interesadas en realizar operaciones financieras en un portafolio diversificado a nivel global, buscando maximizar la relación riesgo y retorno con muy baja volatilidad y manteniendo niveles adecuados de liquidez en un horizonte de inversión de corto plazo, a través de una cartera compuesta principalmente por fondos mutuos e instrumentos representativos de deuda sobre todo de corto plazo.

#### Política de Inversión del Fondo

El Fondo de Fondos SURA Corto Plazo Global FMIV invierte como mínimo el 75% de su activo total en cuotas de participación en fondos mutuos, o fondo de fondos y ETF's del exterior que inviertan en instrumentos representativos de deuda, los cuales podrán ser fondos de muy corto plazo, corto plazo, mediano plazo, largo plazo y de duración flexible. Adicionalmente, el Fondo podrá invertir hasta el 25% de su activo total en instrumentos representativos de deuda de corto plazo, como depósitos en entidades bancarias e instrumentos representativos de éstos, así como en instrumentos representativos de deuda emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú.

#### Inversiones del Fondo por Instrumento



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Emisor

| EMISORES                  | %           |
|---------------------------|-------------|
| ICS USD LIQUIDITY FUND    | 81.03%      |
| SCOTIABANK DEL PERÚ       | 13.71%      |
| BANCO DE CREDITO DEL PERU | 3.84%       |
| BANCO BBVA PERU           | 1.41%       |
| <b>TOTAL</b>              | <b>100%</b> |

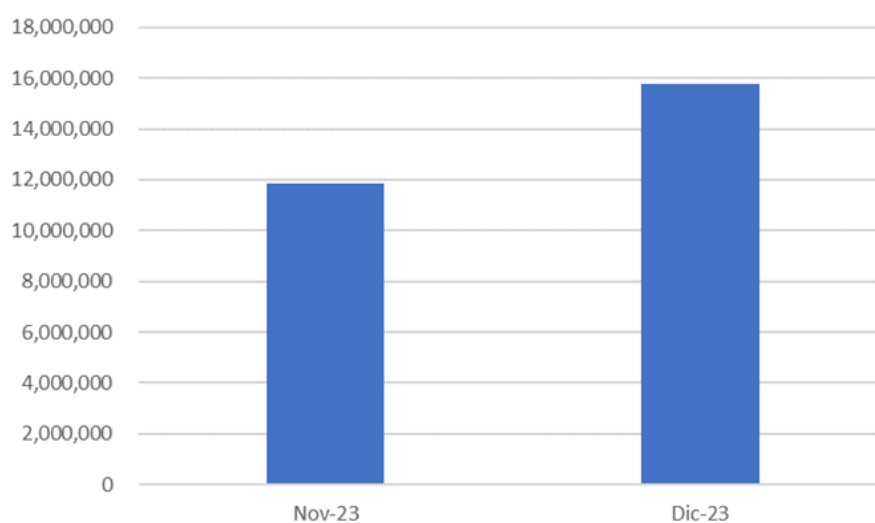
Nota: Información al 31/12/2022

## Diversificación del portafolio según la política de inversiones

### Límites del prospecto - Sura Corto Plazo Global 30/12/2022

| Caja + CxC + Derivados                                                                                    | 1.23         | Márgenes    | Legales      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-------------|--------------|
| Según Tipo de Instrumento                                                                                 | % Cartera    | Min         | Max          |
| <b>Instrumentos Representativos de Participación en el Patrimonio</b>                                     | <b>80.04</b> | <b>5.04</b> | <b>19.96</b> |
| Cuotas de fondos mutuos (1) y/o de fondos de fondos (2) y/o de fondos mutuos internacionales (3) y/o ETF. | 80.04        | 5.04        | 19.96        |
| <b>Instrumentos Representativos de Deuda o Pasivos</b>                                                    | <b>18.73</b> | <b>na</b>   | <b>6.27</b>  |
| Instrumentos emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central                                          | -            | -           | 25.00        |
| Depósitos en entidades bancarias o instrumentos representados                                             | 18.73        | -           | 6.27         |
| <b>Límite por Moneda</b>                                                                                  | <b>98.77</b> | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                                                     | 98.77        | -           | 1.23         |
| Inversiones en otras monedas                                                                              | -            | -           | 100.00       |
| <b>Origen Mercado</b>                                                                                     | <b>98.77</b> | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Mercado Local                                                                                             | 18.73        | na          | 6.27         |
| Mercado Extranjero                                                                                        | 80.04        | 5.04        | 19.96        |
| <b>Límite por Calificación de Riesgo de los Instrumentos de Deuda</b>                                     | <b>-</b>     | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Corto Plazo</b>                                                         | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>-</b>     |
| CP-1                                                                                                      | -            | -           | 25.00        |
| Desde CP-2 hasta CP-3                                                                                     | -            | -           | 25.00        |
| Menor a CP-3                                                                                              | -            | -           | -            |
| <b>Mercado Local: Instrumentos de Largo Plazo</b>                                                         | <b>-</b>     | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Desde AAA hasta A-                                                                                        | -            | -           | -            |
| Desde BBB+ hasta BBB-                                                                                     | -            | -           | -            |
| Menor a BBB-                                                                                              | -            | -           | -            |
| <b>Mercado Local: Entidades Financieras</b>                                                               | <b>18.73</b> | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Desde A+ hasta B+                                                                                         | 18.73        | -           | 6.27         |
| Desde B hasta B-                                                                                          | -            | -           | 25.00        |
| Menor a B-                                                                                                | -            | -           | -            |
| <b>Mercado Internacional</b>                                                                              | <b>-</b>     | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Corto Plazo: no menor a CP-4                                                                              | -            | -           | 25.00        |
| Largo Plazo: no menor a BB-                                                                               | -            | -           | -            |
| Largo Plazo: menor a BB-                                                                                  | -            | -           | -            |
| <b>Estado Peruano (Gobierno Central y BRCP)</b>                                                           | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>25.00</b> |
| <b>Inversiones no sujetas a clasificación</b>                                                             | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>-</b>     |
| <b>Instrumentos Derivados</b>                                                                             | <b>-</b>     | <b>na</b>   | <b>na</b>    |
| Forwards a la moneda del valor cuota                                                                      | -            | -           | 100.00       |
| Forwards a otras monedas                                                                                  | -            | -           | 50.00        |
| <b>Duración</b>                                                                                           | <b>-</b>     | <b>-</b>    | <b>-</b>     |
| Duración de la cartera                                                                                    | 0.002        | 0.00        | 0.998        |

### Patrimonio Administrado (US\$)



\* El fondo inicia operaciones el 15 de noviembre del 2022.

### Evolución del patrimonio

| Fecha  | Cuotas  | Valor Cuota | Patrimonio US\$ |
|--------|---------|-------------|-----------------|
| Ene-22 | 117,705 | 100.55      | 11,834,717      |
| Feb-22 | 156,378 | 100.86      | 15,772,079      |

\* El fondo inicia operaciones el 15 de noviembre del 2022.

A diciembre de 2022, “Fondo de Fondos SURA Corto Plazo Global FMIV” administró un patrimonio de US\$ 15’772,079.

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos por política de inversión.

# FONDOS DE INVERSIÓN

---

**Fondo de Inversión Sura Préstamos Latinoamericanos**

**Comité de Inversiones**

- **Natali Correa Ramirez:**

Asociada de Deuda Privada. Cuenta con más de 11 años de experiencia en finanzas avanzadas, análisis de crédito, estructuración de operaciones crediticias, riesgos de inversión y gestión de cartera en la banca, aseguradoras y fondos de inversión en LATAM. Natali es Economista con especialización en Finanzas de la Universidad Nacional Mayor de San Marcos, tiene una Maestría en Finanzas con especialización en Gestión de Portafolios de Inversión de la Universidad del Pacífico y cuenta con el nivel I del examen CFA aprobado. Adicionalmente, cuenta con la distinción Beta, Gamma, Sigma (BGS) y es candidata al Executive MBA del IE Business School.

- **Luis Manuel Ordoñez Ruiz:**

Profesional de inversiones con experiencia en el mercado de capitales desde el 2007. Es parte de SURA desde el 2016. Actualmente se desempeña como Asociado Senior de Renta Fija en Fondos Sura SAF S.A.C., estando a cargo de la mesa de Renta Fija de Perú. Previamente dentro de Sura Asset Management, se desempeñó como Asociado Senior de Research; especializándose en empresas del sector financiero y aquellas ligadas a la demanda interna. Anteriormente se desempeñó como Head de Research de Inteligo Bank. También ha trabajado como analista de inversiones en fondos de inversión de Private Equity (Aureos Capital y Summa SAFI). Inició su carrera como Trader de Renta Variable Internacional en Horizonte AFP. Bachiller de economía de la Universidad de Pacífico. Cuenta con el nivel I de la certificación CFA (Chartered Financial Analyst) aprobado.

- **Pamela Vega Arce:**

Cuenta con más de 12 años de experiencia en inversiones y actualmente se desempeña como Asociado de Research en Fondos SURA SAF S.A.C. Es miembro del Comité de Inversiones desde noviembre de 2009. Previamente ha realizado otras funciones dentro del área de inversiones de Fondos SURA SAF S.A.C. como Estratega de Inversiones encargada del manejo de los portafolios de renta fija de mediano y corto plazo. También trabajó en AFP Integra en el área de Riesgos de Inversión, a cargo de la evaluación, medición y seguimiento de los riesgos (de Crédito, Liquidez y Mercado) de los 3 portafolios administrados por la AFP. Es Bachiller en Economía de la Universidad del Pacífico y cuenta con la certificación CFA.

---

### Comité de Vigilancia

Mediante Asamblea de Participes de fecha 2 de mayo de 2022, se nombró a las siguientes personas como parte de los miembros del Comité de Vigilancia:

Rolando Augusto Giha Rigacci - Presidente del Comité de Vigilancia.

Luis Javier Ferrand Aspillaga - Vice - Presidente del Comité de Vigilancia.

Alejandro Christian Sandoval Zavala

José Antonio De Rivero Salazar

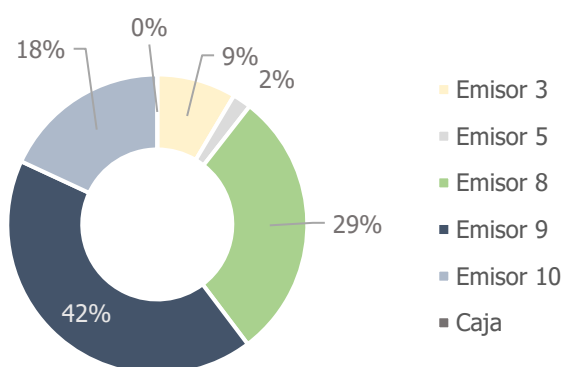
### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores

El 03 de setiembre de 2019 el fondo paso de ser un Fondo de Inversión Privado a ser un Fondo de Inversión Público inscrito en los registros de la Superintendencia del Mercado de Valores bajo Régimen Simplificado, administrado por Fondos Sura SAF S.A.C.

### Objetivo de Inversión del Fondo

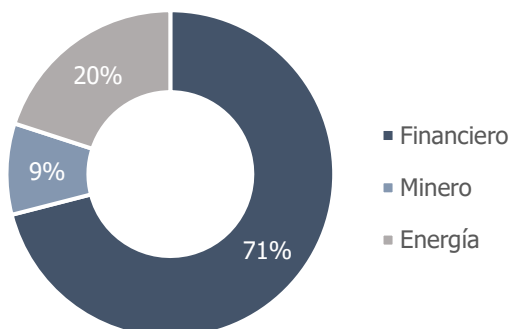
El Fondo tiene por objeto principal invertir sus recursos en títulos representativos de derechos sobre obligaciones o títulos de deuda emitidos en el mercado local o internacional, por empresas latinoamericanas medianas y grandes constituidas en el Perú o en el extranjero, cuotas de Fondos de Inversión y cuotas de Fondos Mutuos, de acuerdo con límites establecidos en el artículo 31 del Reglamento de Participación del Fondo de Inversión Sura Préstamos Latinoamericanos. Las inversiones serán a mediano plazo, mantenidas a vencimiento y buscan obtener una rentabilidad esperada derivada de los intereses y/o cupones devengan. Asimismo, el Fondo invierte a través del vehículo subyacente SURA Deuda LATAM FMIV. La composición mostrada corresponde al vehículo subyacente.

### Inversiones del Fondo por Emisor



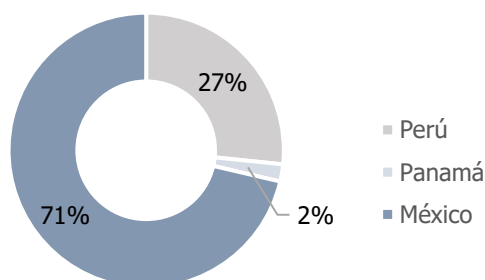
Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por Sector



Nota: Información al 31/12/2022

## Inversiones del Fondo por País

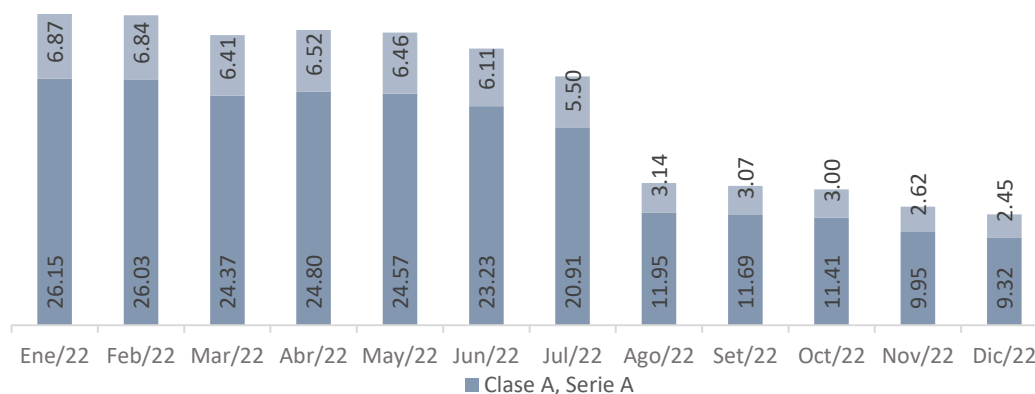


Nota: Información al 31/12/2022

## Patrimonio Administrado (US\$)

| Fecha  | Valor Cuota Clase A | Valor Cuota Clase A, Serie A-1 | Patrimonio Clase A | Patrimonio Clase A, Serie A-1 | Patrimonio Total |
|--------|---------------------|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|------------------|
| ene/22 | 953.59              | 953.59                         | 26,149,481         | 6,874,598                     | 33,024,078.69    |
| feb/22 | 949.14              | 949.14                         | 26,027,407         | 6,842,505                     | 32,869,912.69    |
| mar/22 | 923.30              | 923.30                         | 24,368,376         | 6,406,352                     | 30,774,728.67    |
| abr/22 | 939.81              | 939.81                         | 24,804,253         | 6,520,943                     | 31,325,196.15    |
| may/22 | 931.08              | 931.08                         | 24,573,909         | 6,460,386                     | 31,034,294.50    |
| jun/22 | 911.50              | 911.50                         | 23,234,233         | 6,108,191                     | 29,342,424.30    |
| jul/22 | 820.53              | 820.53                         | 20,914,719         | 5,498,399                     | 26,413,117.88    |
| ago/22 | 647.74              | 647.74                         | 11,951,632         | 3,142,038                     | 15,093,669.93    |
| set/22 | 617.35              | 617.35                         | 11,693,067         | 3,074,062                     | 14,767,129.27    |
| oct/22 | 602.50              | 602.50                         | 11,411,814         | 3,000,122                     | 14,411,936.05    |
| nov/22 | 581.68              | 581.68                         | 9,947,399          | 2,615,134                     | 12,562,532.94    |
| dic/22 | 544.89              | 544.89                         | 9,318,169          | 2,449,711                     | 11,767,880.61    |

## Evolución del Patrimonio (US\$)



A diciembre de 2022, el patrimonio del Fondo de Inversión Sura Prestamos Latinoamericanos fue US\$ 11,767,880.61 dólares americanos.

## Evaluación de la Política de Inversión – Límites de Inversión

| Evaluación de Política de Inversión - Límites Fondo Préstamos Latinoamericanos |              |        |       |        | 31/12/2022 |
|--------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------|-------|--------|------------|
| Límites por instrumento                                                        |              |        |       |        |            |
| Tipo Instrumento                                                               | % Cartera    | % Min  | % Máx | Márgen |            |
| Instrumentos representativos de pasivos                                        | 100%         | 100%   | 100%  | 0.0%   |            |
| Instrumentos representativos de participación en patrimonio                    | 0%           | 0%     | 0%    | 0.0%   |            |
| Forwards en moneda del valor cuota                                             | 0%           | 0%     | 100%  | 100%   |            |
| Forwards en otras monedas                                                      | 0%           | 0%     | 0%    | 0.0%   |            |
| Swaps                                                                          | 0%           | 0%     | 0%    | 0.0%   |            |
| Límites según moneda                                                           |              |        |       |        |            |
| Moneda                                                                         | % Activo     | % Min  | % Máx | Márgen |            |
| Inversiones en moneda del valor cuota                                          | 100%         | 0%     | 100%  | 0%     |            |
| Inversiones en otras monedas                                                   | 0%           | 0%     | 100%  | 100%   |            |
| Límites según mercado                                                          |              |        |       |        |            |
| Mercado                                                                        | % Cartera    | % Min  | % Máx | Márgen |            |
| Inversiones en el mercado local                                                | 100.0%       | 0%     | 100%  | 0%     |            |
| Inversiones en el mercado extranjero                                           | 0.0%         | 0%     | 100%  | 100%   |            |
| Límites según calificación                                                     |              |        |       |        |            |
| Según calificación de riesgo                                                   | % Activo     | % Min  | % Máx | Márgen |            |
| BB- o mejor                                                                    | 100.0%       | 100.0% | 100%  | 0%     |            |
| B+ o peor                                                                      | 0.0%         | 0.0%   | 0%    | 0%     |            |
| Límites según endeudamiento                                                    |              |        |       |        |            |
| Endeudamiento                                                                  | % Patrimonio | % Min  | % Máx | Márgen |            |
| Financiamientos o emisiones de bonos (1)                                       | 40.3%        | 0.0%   | 100%  | 60%    |            |

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos en la política de inversión.

## Procedimiento de selección de la Sociedad Auditora

Mediante Asamblea de Partícipes de fecha 2 de mayo de 2022 se delegó en el Comité de Vigilancia la designación de la sociedad auditora para 2022 y mediante Comité de Vigilancia de fecha 7 de julio de 2022, se aprobó designar como auditores externos del Fondo a la firma Caipo y Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada. representantes de KPMG para el periodo 2022.

---

Hechos Relevantes del Periodo:

- Durante el periodo en mención, el portafolio del Fondo sufrió una desvalorización producto de la materialización de dos eventos de crédito presentados en los Emisores 8 y 9 en los meses de febrero y agosto, respectivamente. Los hechos en cuestión han sido informados en Asamblea de Partícipes, Comités de Vigilancia y demás espacios formales con inversionistas y, adicionalmente, han sido documentados en Reportes periódicos compartidos con los partícipes del Fondo. En atención a lo anterior, la Sociedad Administradora ha desistido del cobro de comisión de administración desde el 1 de setiembre del 2022.

---

**Fondo de Inversión en Renta De Bienes Inmuebles Sura Asset Management I**

---

Comité de Inversiones

- **Iván Zárate Aima:**

Posee más de 15 años de experiencia administrando fondos de inversión, portafolios inmobiliarios y de productos. Previo a ingresar a Fondos SURA en el año 2017, estuvo a cargo de la gestión del portafolio inmobiliario de Seguros SURA (2013-2017), Analista senior de inversiones inmobiliarias en InVita Seguros (2011-2013). Previo a ello se desempeñó en Movistar Perú (2008-2011). Ingeniero Industrial de la Universidad Nacional de Ingeniería (UNI), con MBA de IE España (2023); maestría en Marketing de Centrum/EADA – España y Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico. Cuenta con un Diplomado Professional Certificate en Real Estate Finance and Development del Massachusetts Institute of Technology (MIT), CAIA charterholder y nivel 1 del CFA aprobado.

- **Alonso Jaimes Gil:**

Cuenta con más de 15 años de experiencia en el negocio inmobiliario (generación y control de productos hipotecarios para el desarrollo de vivienda de interés social, financiamiento de proyectos inmobiliarios, y gestión de activos en fondos de inversión inmobiliarios). Se desempeña desde el 2016 en Fondos Sura SAF como Asociado de Gestión de Activos Inmobiliarios, posición desde la cual lidera la gestión de activos para Sura en Perú. Anteriormente se desarrolló como Analista Senior de Negocios Inmobiliarios en Hipotecaria Sura EAH del 2012 al 2016, posición desde la cual realizó el control y seguimiento de las líneas de financiamiento otorgadas de los proyectos inmobiliarios, a través de fideicomisos de flujos y garantías. Anteriormente se desarrolló como Analista de Operaciones Crediticias en el Fondo MIVIVIENDA, del 2008 al 2012. Posee una Licenciatura en administración de empresas con mención en finanzas por la Pontificia Universidad Católica del Perú (Lima, Perú). También cuenta con una especialización en finanzas por EADA Business School (Barcelona, España). Asimismo, con el grado de Magister en Finanzas Corporativas y Riesgo Financiero en CENTRUM Business School (Lima, Perú). Forma parte del Comité de Inversiones del FONDO DE INVERSION EN RENTA DE BIENES INMUEBLES (FIRBI) SURA ASSET MANAGEMENT desde el inicio de operaciones del fondo.

- **Joao Atauje Palomino:**

Cuenta con más de 14 años de experiencia en estructuración y gestión de fondos, inversiones y manejo de activos. Se incorporó a Fondos SURA SAF S.A.C como Asociado Senior de Estructuración en febrero 2022 y anteriormente se desarrolló como Asociado Senior de Gestión de Productos. Anteriormente se desarrolló como Sub-Gerente de Desarrollo de Productos de Inversión en SURA Asset Management Perú; del 2017 al 2018 se desempeñó como Jefe de Desarrollo de Productos de Inversión en Fondos SURA SAF S.A.C. También se desempeñó como Analista Senior de Inversiones en Real Estate en Seguros SURA. Posee una Maestría en la Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas y es bachiller en Administración de Empresas de la Universidad San Ignacio de Loyola. Asimismo, cuenta con un certificado en valorización de activos en NYU Stern y un certificado en fundamentos de inversión del CFA Institute. Parte del Comité de Inversiones desde el 21 de diciembre de 2020.

---

Comité de Vigilancia

Mediante Asamblea de Participes de fecha 29 de abril de 2022, se nombró a las siguientes personas como parte de los miembros del Comité de Vigilancia:

- **Anthony Davis Scott**

Miembro titular y Presidente del Comité de Vigilancia.

Ejecutivo Senior, con grado de Bachiller en Ciencias de Ingeniería Electrónica en Northrop Institute of Technology (California, USA). Experiencia laboral de más de 40 años en Perú. Cuenta con vasta experiencia en el gerenciamiento de empresas proveedoras de la industria minera. Desde el 2011 hasta el 2015 fue Vicepresidente de Synthetic Wears Operations en Metso Corporation (Finlandia), periodo durante el cual se logró estandarizar los procedimientos de producción en todas las unidades, maximizar la utilización de equipos y mano de obra en diversas operaciones y enfocar programas de seguridad mediante el intercambio de Buenas Prácticas y la implementación de Auditorías Externas para reducir el Índice de Frecuencia de Tiempo Perdido. Previamente, desde el 2001 hasta el 2014, se desempeñó como Director Gerente General en Metso Perú S.A., en donde fue responsable de la operación de la entidad legal en Perú y de la supervisión de la operación general en los países de la Región Andina. Durante este periodo adquirió un terreno industrial en Arequipa y coordinó la construcción de un centro de servicios para la reparación de equipo minero. La puesta en marcha fue en julio de 2014.

- **Miguel Del Río Pérez**

Miembro titular del Comité de Vigilancia.

Ingeniero Civil por la Universidad Nacional de Ingeniería. Hasta septiembre de 2018, se desempeñó como Presidente de Directorio de la empresa HV Contratistas S.A y Director de Inmobiliaria de Turismo S.A. Anteriormente y durante 10 años, se ha desempeñado como director de CAPECO. Además, ha sido Director de Bandesco (1991-1996), Presidente del Banco de Vivienda (1990-1991), así como también, Director de la Beneficencia y Caja de Ahorros de Lima (1980-1985).

- **César Ricardo Padilla Freyre**

Miembro titular del Comité de Vigilancia.

Abogado de profesión por la Pontificia Universidad Católica del Perú, con más de 20 años de experiencia en el rubro minero y actividades conexas de la consultoría técnica. Gerente General de Opalo S.A. y Geodesia Peruana S.A.C.

- **David Lemor**

Miembro alterno del Comité de Vigilancia.

Ingeniero Industrial graduado en la Universidad Estatal de Carolina del Norte – EEUU, "NorthCarolina State University" - NCSU, USA. Posee experiencia como Consultor de Empresas de Energía y Comercio Exterior, Miembro del Consejo Directivo de la Sociedad Nacional de Industrias, Miembro del Directorio de FONCOPES, entre otros cargos relevantes a lo largo de su trayectoria profesional.

---

Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 018-2016-SMV/10.2, de fecha 4 de marzo de 2016 e inicio operaciones el 08 de junio de 2016.

Objetivo de Inversión Del Fondo

El Fondo tiene por objeto principal invertir sus recursos en Inversiones Inmobiliarias, dentro de lo que se incluye la adquisición o construcción de Bienes Raíces que se destinen a su arrendamiento u otra forma onerosa de cesión en uso. Las Inversiones Inmobiliarias serán mayoritariamente de mediano plazo, y se encontrarán ubicadas exclusivamente en el Perú de acuerdo con los límites establecidos en el artículo 19 del Reglamento de Participación del Fondo de Inversión En Renta De Bienes Inmuebles Sura AM.

Segmento de Inversión del Fondo

El Fondo pretende desarrollar sus Inversiones Inmobiliarias en los sectores industria, comercio, salud, servicios, educación, entretenimiento, vivienda, turismo y oficinas.

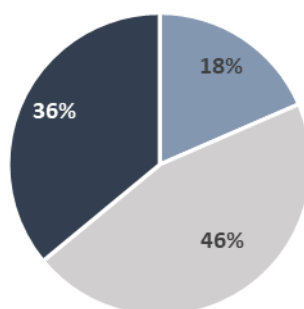
Inversiones del Fondo

Al 31 de diciembre de 2022, el portafolio del Fondo estaba compuesto por tres activos:

Torre Real Ocho con el 18%, Torre Navarrete con el 46% y Torre Platinum Plaza con el 36% de participación sobre el valor total de la cartera.

**Inversiones Inmobiliarias**

■ Torre Real Ocho   ■ Torre Navarrete   ■ Torre Platinum Plaza



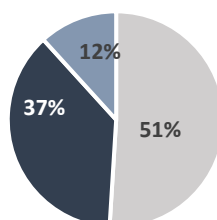
Nota: Información al 31/12/2022

---

Ingresos del Fondo por Edificio

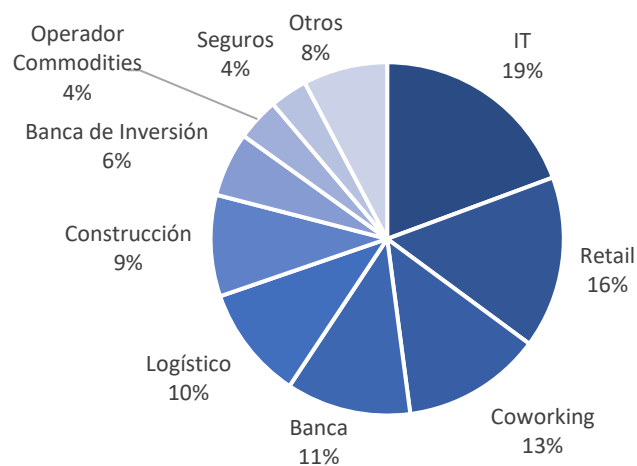
**Ingresos Portafolio por Activo**

■ Torre Navarrete ■ Torre Platinum Plaza ■ Torre Real Ocho



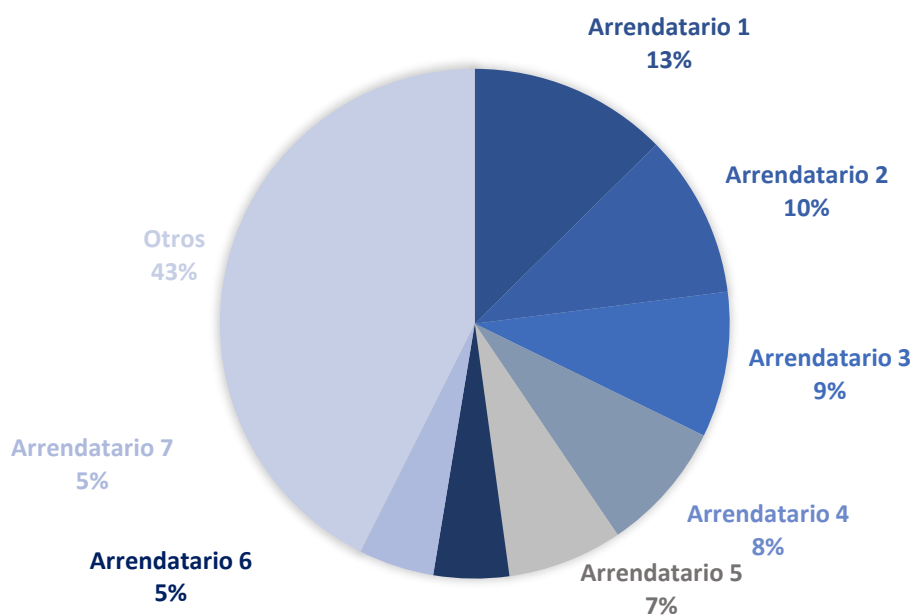
Nota: Información al 31/12/2022

Ingresos del Fondo por Rubro



Nota: Información al 31/12/2022

Ingresos del Fondo por Arrendatario

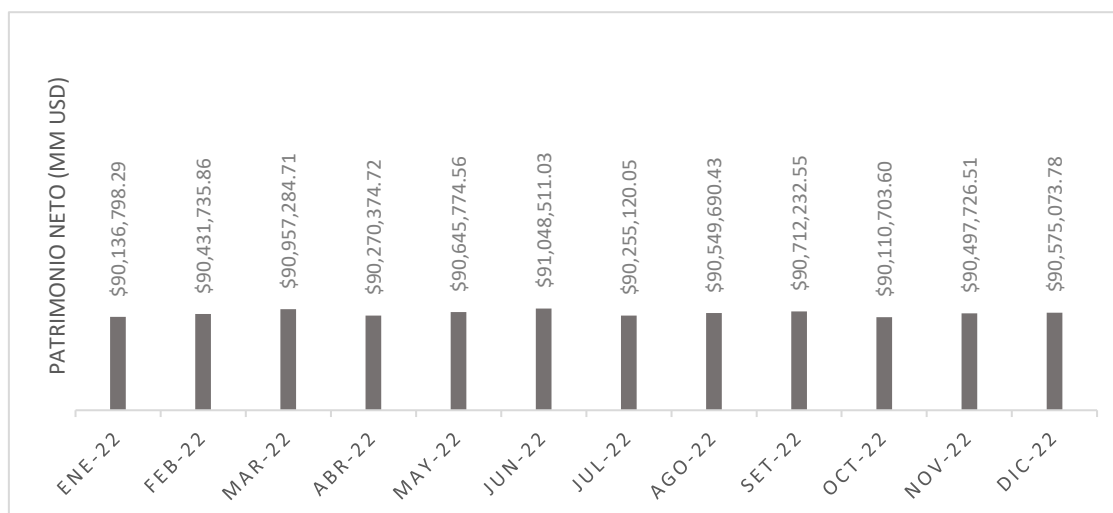


Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (US\$)

| Fecha  | Valor Cuota Serie A | Cuotas A  | AUM Serie A      | Valor Cuota Serie B | Cuotas B  | AUM Serie B      | AUM Total        |
|--------|---------------------|-----------|------------------|---------------------|-----------|------------------|------------------|
| Ene-22 | \$ 925.62           | 66,213.30 | \$ 61,288,425.01 | \$ 925.81           | 31,160.00 | \$ 28,848,373.28 | \$ 90,136,798.29 |
| Feb-22 | \$ 928.65           | 66,213.30 | \$ 61,488,967.51 | \$ 928.84           | 31,160.00 | \$ 28,942,768.35 | \$ 90,431,735.86 |
| Mar-22 | \$ 934.05           | 66,213.30 | \$ 61,846,313.92 | \$ 934.24           | 31,160.00 | \$ 29,110,970.79 | \$ 90,957,284.71 |
| Abr-22 | \$ 926.99           | 66,213.30 | \$ 61,379,250.17 | \$ 927.19           | 31,160.00 | \$ 28,891,124.55 | \$ 90,270,374.72 |
| May-22 | \$ 930.85           | 66,213.30 | \$ 61,634,502.91 | \$ 931.04           | 31,160.00 | \$ 29,011,271.65 | \$ 90,645,774.56 |
| Jun-22 | \$ 934.98           | 66,213.30 | \$ 61,908,343.17 | \$ 935.18           | 31,160.00 | \$ 29,140,167.87 | \$ 91,048,511.03 |
| Jul-22 | \$ 926.84           | 66,167.08 | \$ 61,326,035.68 | \$ 927.03           | 31,206.22 | \$ 28,929,084.36 | \$ 90,255,120.05 |
| Ago-22 | \$ 929.86           | 66,167.08 | \$ 61,526,188.69 | \$ 930.05           | 31,206.22 | \$ 29,023,501.74 | \$ 90,549,690.43 |
| Set-22 | \$ 931.53           | 66,167.08 | \$ 61,636,631.89 | \$ 931.72           | 31,206.22 | \$ 29,075,600.66 | \$ 90,712,232.55 |
| Oct-22 | \$ 925.35           | 66,167.08 | \$ 61,227,908.42 | \$ 925.55           | 31,206.22 | \$ 28,882,795.18 | \$ 90,110,703.60 |
| Nov-22 | \$ 929.33           | 66,167.08 | \$ 61,490,880.54 | \$ 929.52           | 31,206.22 | \$ 29,006,845.97 | \$ 90,497,726.51 |
| Dic-22 | \$ 930.12           | 66,167.08 | \$ 61,543,436.03 | \$ 930.32           | 31,206.22 | \$ 29,031,637.75 | \$ 90,575,073.78 |

## Evolución del patrimonio



A diciembre de 2022, el patrimonio del Fondo de Inversión en Renta de Bienes Inmuebles Sura Asset Management I fue US\$ 90,575,073.78 dólares americanos.

## Cambios en el Reglamento de Participación

Durante el 2022, no se realizaron cambios al Reglamento de Participación del Fondo de Inversión en Renta de Bienes Inmuebles Sura Asset Management I.

## Evaluación de la Política de Inversión – Límites de Inversión

| CAPÍTULO III - LÍMITES DE INVERSIÓN DEL FONDO                                                                                                                                                                  |               |                 |                 |                 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| SEGÚN TIPO DE INVERSIÓN                                                                                                                                                                                        | Estado límite | Valor observado | Límite inferior | Límite superior |
| BIENES RAÍCES                                                                                                                                                                                                  | OK            | 93.23%          | 70.00%          | 100.00%         |
| OTRAS INVERSIONES                                                                                                                                                                                              | OK            | 0.61%           | 0.00%           | 30.00%          |
| Depósitos en entidades del Sistema Financiero Nacional en moneda nacional o extranjera, así como en Instrumentos representativos de éstos, los cuales deben tener una clasificación de riesgo no menor a CP-3. | OK            | 0.61%           | CP-3            | CP - 1+         |
| Depósitos en entidades bancarias del exterior o financieras del exterior, así como en Instrumentos representativos de éstos, los cuales deben tener una clasificación de riesgo no menor a CP-3.               | OK            | 0.00%           | CP-3            | CP - 1+         |
| Instrumentos financieros emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú, los cuales comparten la clasificación de riesgo que le es otorgada al país.                                  |               | 0.00%           |                 |                 |
| SEGÚN MERCADO                                                                                                                                                                                                  | Estado límite | Valor observado | Límite inferior | Límite superior |
| Mercado local                                                                                                                                                                                                  | OK            | 93.23%          | 70%             | 100%            |
| Mercado extranjero                                                                                                                                                                                             | OK            | 0.00%           | 0%              | 30%             |
| SEGÚN MONEDA                                                                                                                                                                                                   | Estado límite | Valor observado | Límite inferior | Límite superior |
| Inversiones en activos expresados en Nuevos Soles                                                                                                                                                              | OK            | 0.00%           | 0%              | 100%            |
| Inversiones en activos expresados en Dólares Americanos                                                                                                                                                        | OK            | 93.23%          | 0%              | 100%            |

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos en la política de inversión.

## Procedimiento de selección de la Sociedad Auditora

Mediante Asamblea de Partícipes de fecha 29 de abril de 2022 se delegó en el Comité de Vigilancia la designación de la sociedad auditora para 2022 y mediante Comité de Vigilancia de fecha 8 de agosto de 2022, se aprobó designar como auditores externos del Fondo a la firma Caipo y Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada. representantes de KPMG para el periodo 2022.

---

**Fondo de Inversión en Renta De Bienes Inmuebles SURA Asset Management II**

**Comité de Inversiones**

- **David Aguirre:**  
Gerente de Inversiones (Chief Investment Officer) del área de Mercados Privados de Sura Asset Management S.A.S. para Latino América (México, Colombia, Perú, Chile y Uruguay). Desde inicios de 2014 hasta abril de 2018 se desempeñó como Gerente (Head) de Activos Alternativos de la Unidad de Investment Management de Sura Asset Management. Anteriormente se desempeñó como Vicepresidente de Mercados de Capitales en Banca de Inversión Bancolombia, donde realizó transacciones por un valor agregado de aproximadamente US\$ 500 millones. Adicionalmente, fue Director de Portafolios de Terceros en Bolsa y Renta S.A. (hoy BTG Pactual Colombia). El señor Aguirre es Ingeniero de Producción y Especialista en Finanzas por la Universidad EAFIT. Adicionalmente, es Especialista en Economía por la Universidad de Los Andes y Master of Science (MSc) in Investment Management por Cass Business School.
- **Juan Guillermo Londoño:**  
El señor Londoño es miembro independiente del Comité Inmobiliario Regional de Sura Asset Management. Hasta el 2015, se desempeñó como Gerente General (Chief Executive Officer) de Celsia, la compañía del sector energético de Grupo Argos de Colombia. Actualmente se desempeña como Presidente de Trilium y participa en diversas juntas directivas, comités de inversiones y consejos directivos; entre los que se destacan Smurfit Kappa-Cartón de Colombia, URBANSA, Corporación Ruta N, FCP 4G|Credicorp Capital – Sura Asset Management, Universidad de Antioquia. Asimismo, ha participado en juntas directivas de Almacenes Éxito, Coltabaco, Colpapel, EPSA, Grupo SURA, Consorcio CCC de la Central Hidroeléctrica Porce III, ANDI, FIABCI, ANDESCO, Coninsa Ramón. El señor Londoño es Administrador de Negocios por la Universidad EAFIT. Ha recibido diversas condecoraciones, entre las que se destacan la Gran Cruz de Antioquía en Categoría Oro 2015, Inmobiliario Distinguido Lonja de Propiedad Raíz de Medellín - Antioquia 1996, Orden al Mérito Inmobiliario Federación Internacional de Profesionales Inmobiliarios FIABCI (Colombia) 1995.
- **Iván Zárate Aima:**  
Posee más de 15 años de experiencia administrando fondos de inversión, portafolios inmobiliarios y de productos. Previo a ingresar a Fondos SURA en el año 2017, estuvo a cargo de la gestión del portafolio inmobiliario de Seguros SURA (2013-2017), Analista senior de inversiones inmobiliarias en InVita Seguros (2011-2013). Previo a ello se desempeñó en Movistar Perú (2008-2011). Ingeniero Industrial de la Universidad Nacional de Ingeniería (UNI), con MBA de IE España (2023); maestría en Marketing de Centrum/EADA – España y Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico. Cuenta con un Diplomado Profesional Certificate en Real Estate Finance and Development del Massachusetts Institute of Technology (MIT), CAIA charterholder y nivel 1 del CFA aprobado.
- **Alejandro Vargas Iriarte:**  
El señor Vargas cuenta con más 20 años de experiencia en Asset Management, se incorporó a SURA en el año 2019 como director de Asset Management Regional, desde donde lidera la gestión de activos inmobiliarios en renta y desarrollo en Chile, Perú, Colombia y México. Antes de incorporarse a SURA, durante 8 años fue el gerente de gestión de activos en el PEI, uno de los vehículos de inversión inmobiliaria líderes en Colombia con más de USD 1.5Bn en AUM, 140 activos y más de 960,000 m2 en GLA. En sus más de 20 años de

---

experiencia profesional ha liderado compañías del sector retail y de construcción, y ha participado en el Consejo de Administración de los principales centros comerciales en Colombia. Tiene estudios de postgrado en Administración de Empresas de la Universidad del Rosario y es Arquitecto de la Universidad Javeriana.

#### Comité de Vigilancia

Mediante Asamblea de Partícipes de fecha 28 de abril de 2022, se nombró a las siguientes personas como parte de los miembros del Comité de Vigilancia:

- **José Antonio De Rivero Salazar** - Presidente del Comité de Vigilancia.

Ejecutivo Senior con experiencia en Dirección General y Dirección de Auditoría, Finanzas, Riesgos y Procesos, en empresas del sistema financiero, del cuidado de la salud y de retail. Consultor Internacional en Supervisión Bancaria. Economista, MBA, Coach certificado.

- **Jorge Armando Zegarra Nieto** - Vice-Presidente del Comité de Vigilancia.

Ejecutivo de Finanzas especializado en Planificación Financiera y Finanzas Corporativas. Doce años de experiencia en subgerencias corporativas con experiencia en Planeamiento Financiero, Valorización de Empresas y Proyectos de Inversión, Gestión de Inversiones, Gestión de Tesorería, Riesgos, Planeamiento Estratégico y Control de Gestión. Ingeniero Industrial por la PUCP, Master en Finanzas y MBA del CENTRUM-EADA (España).

- **Pacifico Compañía de Seguros y Reaseguros.**

#### Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 041-2019-SMV/10.2, de fecha 3 de mayo de 2019, inicio operaciones el 12 de julio de 2019.

#### Objetivo de Inversión del Fondo

El Fondo tiene por objeto principal invertir sus recursos en Inversiones Inmobiliarias. Estas inversiones consistirán principalmente la adquisición directa de derechos sobre Bienes Raíces para destinarlos a su arrendamiento, usufructo o cualquier otra modalidad onerosa de cesión en uso. Las Inversiones Inmobiliarias serán mayoritariamente de largo plazo, y se encontrarán ubicadas exclusivamente en el Perú. Asimismo, se sujetarán a los límites establecidos en el Artículo 22 del presente Reglamento de Participación.

#### Segmento de Inversión del Fondo

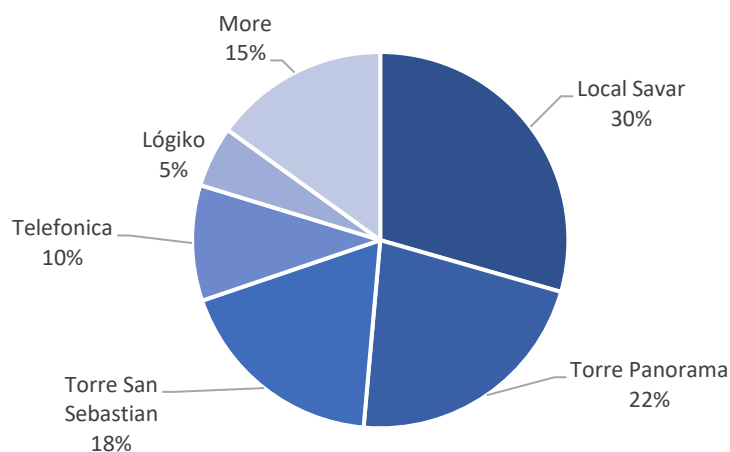
El Fondo pretende desarrollar sus Inversiones Inmobiliarias en los sectores industria, comercio, salud, servicios, educación, entretenimiento, vivienda, turismo y oficinas.

---

### Inversiones del Fondo

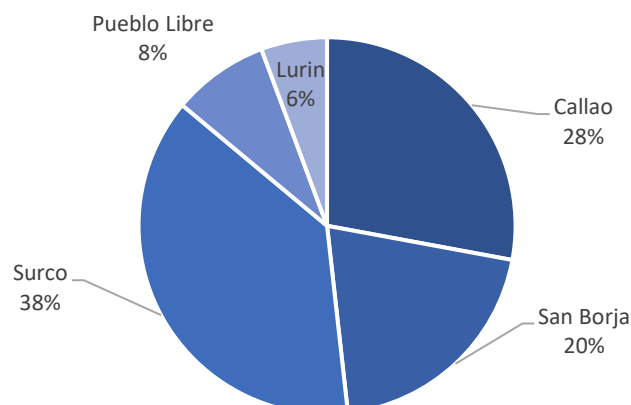
Al 31 de diciembre de 2022, el portafolio del Fondo estaba compuesto por seis activos:

Local Savar con el 29% de participación sobre el valor total de la cartera, Torre San Sebastián con el 18%, Torre Panorama con el 22%, Lógiko con el 5%, More con el 15% y Telefónica con el 10% restante.



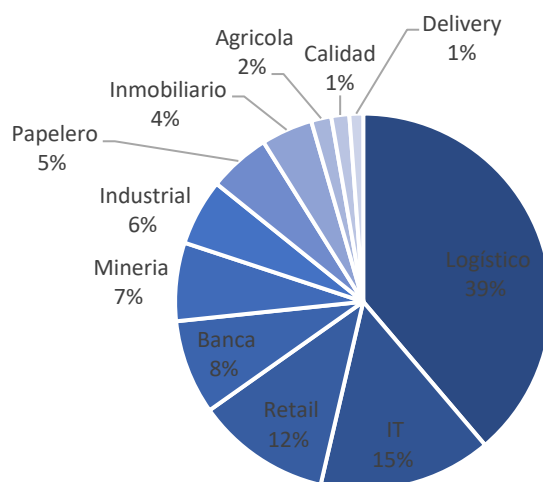
Nota: Información al 31/12/2022

### Ingresos del Fondo por Edificio



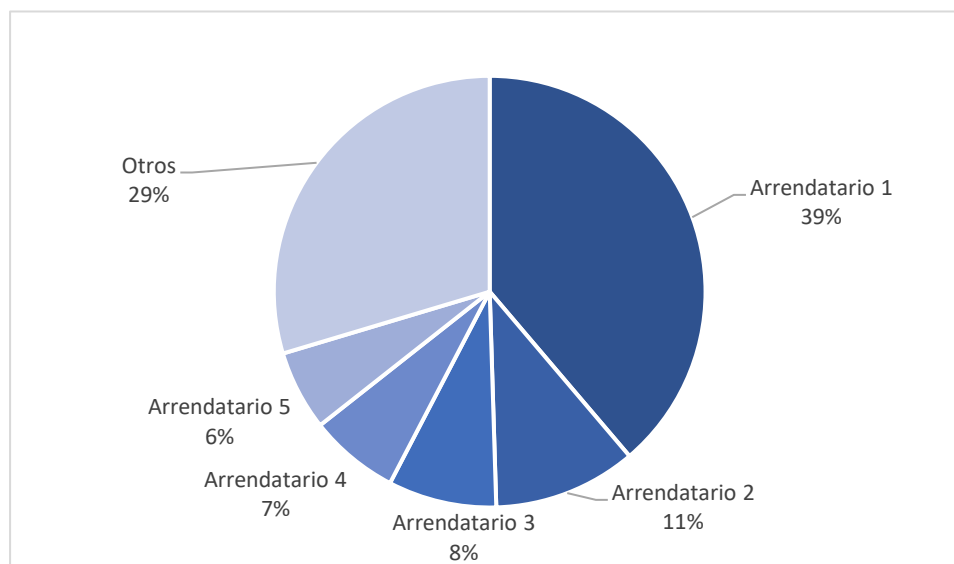
Nota: Información al 31/12/2022

### Ingresos del Fondo por Rubro



Nota: Información al 31/12/2022

### Ingresos del Fondo por Arrendatario

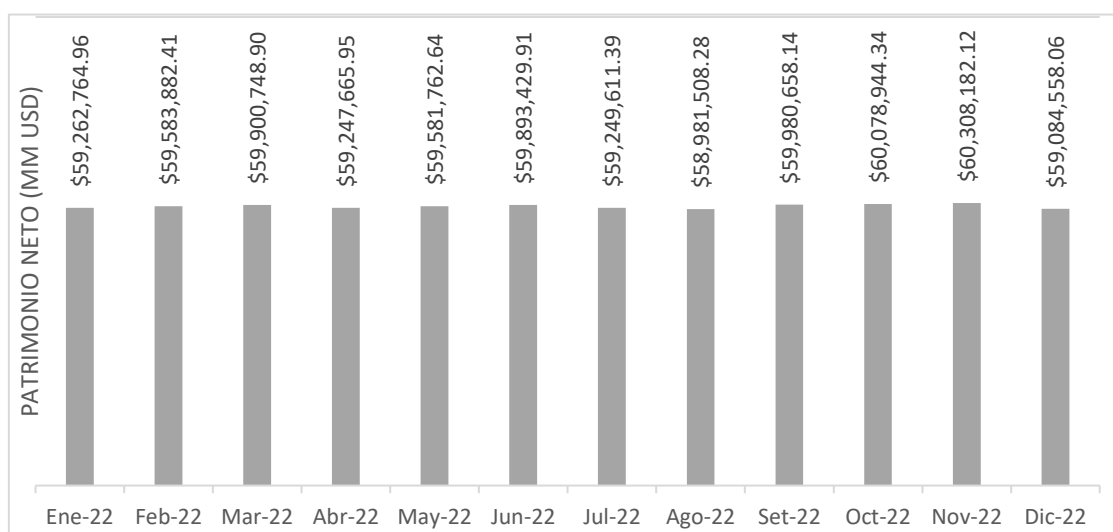


Nota: Información al 31/12/2022

Patrimonio Administrado (US\$)

| Fecha  | Valor Cuota Serie A | Cuotas A  | AUM Serie A     | Valor Cuota Serie B | Cuotas B  | AUM Serie B     | AUM Total        |
|--------|---------------------|-----------|-----------------|---------------------|-----------|-----------------|------------------|
| Ene-22 | \$ 997.05           | 42,402.70 | \$42,277,722.38 | \$ 997.26           | 17,031.70 | \$16,985,042.59 | \$ 59,262,764.96 |
| Feb-22 | \$ 1,002.46         | 42,402.70 | \$42,506,805.76 | \$ 1,002.66         | 17,031.70 | \$17,077,076.66 | \$ 59,583,882.41 |
| Mar-22 | \$ 1,007.79         | 42,402.70 | \$42,732,856.52 | \$ 1,008.00         | 17,031.70 | \$17,167,892.38 | \$ 59,900,748.90 |
| Abr-22 | \$ 996.80           | 42,402.70 | \$42,266,950.83 | \$ 997.01           | 17,031.70 | \$16,980,715.12 | \$ 59,247,665.95 |
| May-22 | \$ 1,002.42         | 42,402.70 | \$42,505,293.52 | \$ 1,002.63         | 17,031.70 | \$17,076,469.12 | \$ 59,581,762.64 |
| Jun-22 | \$ 1,007.66         | 42,402.70 | \$42,727,635.19 | \$ 1,007.87         | 17,031.70 | \$17,165,794.71 | \$ 59,893,429.91 |
| Jul-22 | \$ 996.83           | 42,402.70 | \$42,268,338.69 | \$ 997.04           | 17,031.70 | \$16,981,272.70 | \$ 59,249,611.39 |
| Ago-22 | \$ 992.38           | 42,402.70 | \$42,079,590.61 | \$ 992.38           | 17,031.70 | \$16,901,917.67 | \$ 58,981,508.28 |
| Set-22 | \$ 996.61           | 43,149.58 | \$43,003,197.57 | \$ 996.82           | 17,031.70 | \$16,977,460.58 | \$ 59,980,658.14 |
| Oct-22 | \$ 998.24           | 43,149.58 | \$43,073,663.96 | \$ 998.45           | 17,031.70 | \$17,005,280.38 | \$ 60,078,944.34 |
| Nov-22 | \$ 1,002.05         | 43,149.58 | \$43,238,016.24 | \$ 1,002.26         | 17,031.70 | \$17,070,165.88 | \$ 60,308,182.12 |
| Dic-22 | \$ 981.72           | 43,149.58 | \$42,360,737.65 | \$ 981.92           | 17,031.70 | \$16,723,820.42 | \$ 59,084,558.06 |

Evolución del patrimonio



A diciembre de 2022, el patrimonio del Fondo de Inversión en Renta de Bienes Inmuebles SURA Asset Management II fue \$ 59,084,558.06 dólares americanos.

Cambios en el Reglamento de Participación del Fondo

Durante el 2022, no se realizaron cambios al Reglamento de Participación del Fondo de Inversión en Renta de Bienes Inmuebles Sura Asset Management II.

## Evaluación de la Política de Inversión – Límites de Inversión

| CAPÍTULO III - LÍMITES DE INVERSIÓN DEL FONDO                                                                                                                                                                                 |               |                 |                 |                 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| SEGÚN TIPO DE INVERSIÓN                                                                                                                                                                                                       | Estado límite | Valor observado | Límite inferior | Límite superior |
| A) Inversiones Inmobiliarias                                                                                                                                                                                                  | OK            | 91.93%          | 70.00%          | 100.00%         |
| Adquisición directa de Bienes Raíces                                                                                                                                                                                          |               | 91.93%          | 0%              | 100%            |
| Construcción y/o remodelación de Bienes Raíces                                                                                                                                                                                |               | 0.00%           | 0%              | 100%            |
| B) Otras Inversiones                                                                                                                                                                                                          | OK            | 0.00%           | 0.00%           | 30.00%          |
| B.1) Depósitos en entidades bancarias del Sistema Financiero Nacional en moneda nacional o extranjera, así como en instrumentos representativos de éstos, los cuales deben tener una clasificación de riesgo no menor a CP-3. | OK            | 0.52%           | CP-3            | CP - 1+         |
| B.2) Depósitos en entidades bancarias del exterior, así como en instrumentos representativos de éstos, los cuales deben tener una clasificación de riesgo no menor a CP-3.                                                    | OK            | 2.77%           | CP-3            | CP - 1+         |
| B.3) Instrumentos financieros emitidos por el Gobierno Central y el Banco Central de Reserva del Perú, los cuales comparten la clasificación de riesgo que le es otorgada al país.                                            |               | 0.00%           |                 |                 |

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos en la política de inversión.

## Procedimiento de selección de la Sociedad Auditora

Mediante Asamblea Extraordinaria de Participes de fecha 20 de junio del 2022 se aprobó designar como auditores externos del Fondo a la firma Caipo y Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada. representantes de KPMG para el periodo 2022.

---

## Fondo de Inversión Factor Sura

### Comité de Inversiones

En el periodo 2022 se realizaron modificaciones en el Comité de Inversiones del Fondo Factor Sura, siendo al cierre de diciembre 2022 sus miembros:

- **Luis Caballero Vizconde:**

Asociado en Deuda Privada. Profesional de inversiones con más de 15 años de experiencia en temas relacionados a la gestión de Fondos de Inversión y manejo de activos. Se incorporó a Sura Investment Management en Junio del 2019. Previamente trabajó en Compass Group SAFI como SubGerente de Fondos de Inversión, gestionando activos de corto plazo por S/ 600 millones. Tiene experiencia en el sector financiero donde ocupó distintas posiciones comerciales en entidades bancarias de primer nivel (Scotiabank y Citibank), así como en Fondos de Inversión. Es Bachiller de Administración de Empresas en la Universidad de Lima y posee una maestría en Finanzas de Centrum y EADA (España)

- **Natali Correa Ramirez:**

Asociada de Deuda Privada. Cuenta con más de 112 años de experiencia en finanzas avanzadas, análisis de crédito, estructuración de operaciones crediticias, riesgos de inversión y gestión de cartera en la banca, aseguradoras y fondos de inversión en LATAM. Natali es Economista con especialización en Finanzas de la Universidad Nacional Mayor de San Marcos, tiene una Maestría en Finanzas con especialización en Gestión de Portafolios de Inversión de la Universidad del Pacífico y cuenta con el nivel I del examen CFA aprobado. Adicionalmente, cuenta con la distinción Beta, Gamma, Sigma (BGS) y es candidata al Executive MBA del IE Business School.

- **Luis Manuel Ordoñez Ruiz:**

Profesional de inversiones con experiencia en el mercado de capitales desde el 2007. Es parte de SURA desde el 2016. Actualmente se desempeña como Asociado Senior de Renta Fija en Fondos Sura SAF S.A.C., estando a cargo de la mesa de Renta Fija de Perú. Previamente dentro de Sura Asset Management, se desempeñó como Asociado Senior de Research; especializándose en empresas del sector financiero y aquellas ligadas a la demanda interna. Anteriormente se desempeñó como Head de Research de Inteligo Bank. También ha trabajado como analista de inversiones en fondos de inversión de Private Equity (Aureos Capital y Summa SAFI). Inició su carrera como Trader de Renta Variable Internacional en Horizonte AFP. Bachiller de economía de la Universidad de Pacífico. Cuenta con el nivel I de la certificación CFA (Chartered Financial Analyst) aprobado.

### Comité de Vigilancia

- **Zoila Patricia Mascaró Diaz** - Presidente del Comité de Vigilancia.

Especialista en Ciencias de la Computación por la Universidad Nacional Mayor de San Marcos con Diplomado en Finanzas en Esan. Cuenta con más de 39 años de experiencia laboral como Gerente en importantes empresas nacionales y multinacionales. Su experiencia se ha desarrollado principalmente en el Sector de Energía en los ámbitos de Compras y Contrataciones, Comercial y Desarrollo de

---

Proyectos de Tecnología y Telecomunicaciones. Actualmente se dedica a actividades de apoyo social.

- **George Ode Segebre - Vice - Presidente del Comité de Vigilancia.**

Abogado egresado de la Universidad Católica del Perú con experiencia en diversos sectores. Empresario con larga trayectoria en el sector textil y transportes.

- **Cirilo Roberto Atencio Mucha**

Ingeniero de Minas, con Maestría en Sistema Integrado de Seguridad, Salud Ocupacional y Medio Ambiente, con experiencia en la Gran, Mediana y Pequeña Minería, administrando sistemas de gestión de seguridad. Aplicación (implementación y mantenimiento) de programas de seguridad, políticas, estándares y procedimientos, herramientas de seguridad. Gestión de riesgos, elaboración de pets, identificación de peligros y recomendación de controles de peligros, valoración de riesgos, Inspecciones, Investigación de Incidentes. Una carrera de 28 años, 16 años en operaciones mina y 12 años en la industria de construcción y montaje.

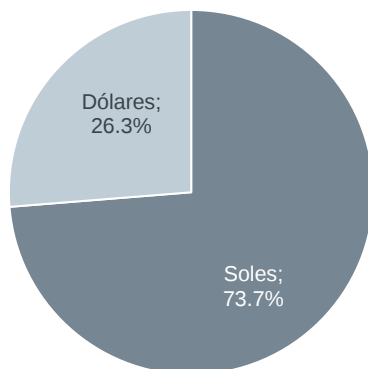
Datos relativos a su inscripción en Registro Público de Mercado de Valores.

El Fondo fue inscrito en el Registro Público del Mercado de Valores de la Superintendencia de Mercado de Valores, mediante Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 052-2021-SMV/10.2, de fecha 23 de abril de 2021.

Objetivo de Inversión del Fondo

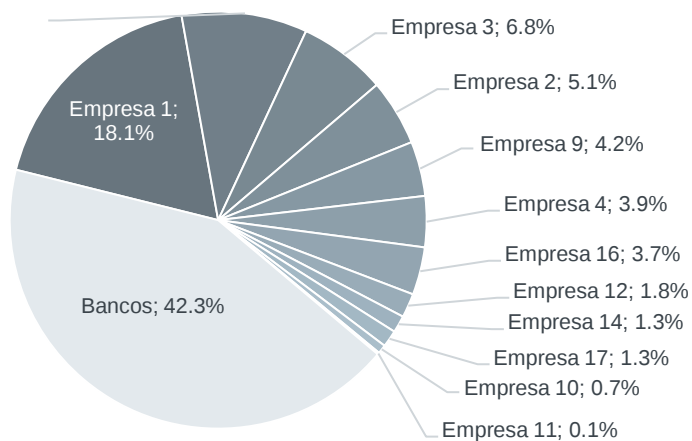
El Fondo invierte principalmente en acreencias de corto plazo de proveedores de empresas corporativas y grandes empresas de diversos sectores económicos en el Perú, las cuales pueden ser en soles y/o dólares americanos. El portafolio de activos tendrá un plazo promedio máximo de ciento ochenta (180) días, ofreciendo así una alta liquidez de los subyacentes del Fondo. Adicionalmente, el Fondo podrá realizar Inversiones Temporales para efectos de administrar la liquidez del Fondo.

### Inversiones del Fondo por Moneda



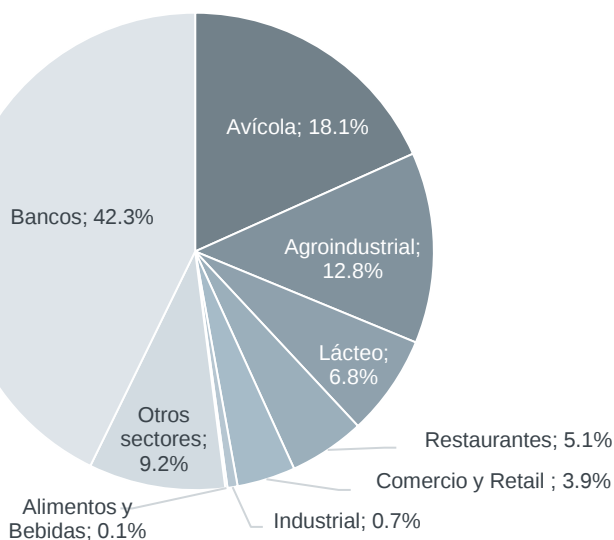
Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Empresas Pagadora



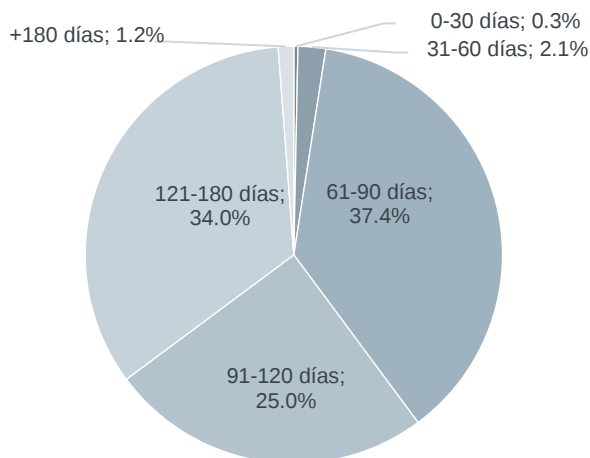
Nota: Información al 31/12/2022

### Inversiones del Fondo por Sector



Nota: Información al 31/12/2022

Inversiones del Fondo por Plazo de Vencimiento

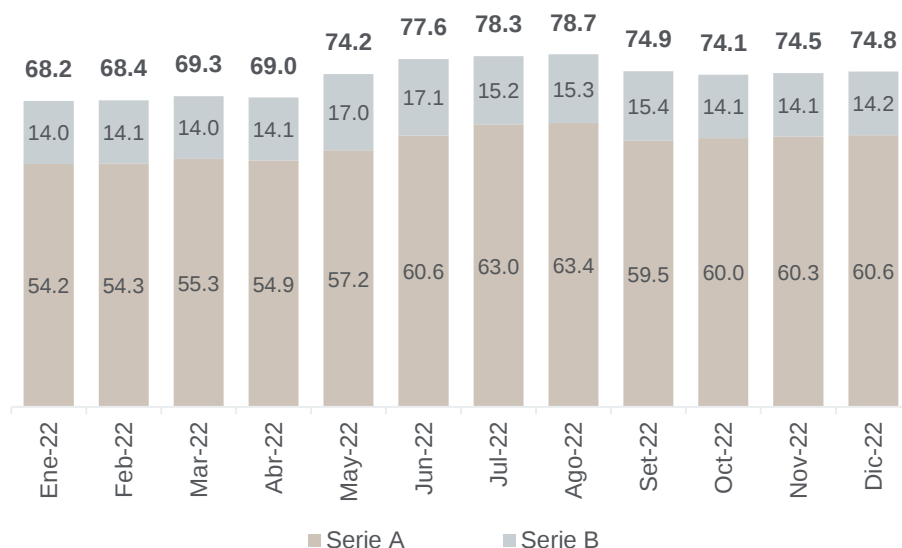


Nota: Información al 31/12/2021

Patrimonio Administrado (S/.)

| Fecha  | Valor Cuota Clase A | Patrimonio Clase A | Valor Cuota Clase B | Patrimonio Clase B | Patrimonio Total |
|--------|---------------------|--------------------|---------------------|--------------------|------------------|
| Ene-22 | S/1,014.43          | S/54,203,688.72    | S/1,002.09          | S/14,029,312.54    | S/68,233,001.25  |
| Feb-22 | S/1,017.09          | S/54,346,004.36    | S/1,004.72          | S/14,066,147.49    | S/68,412,151.85  |
| Mar-22 | S/1,021.10          | S/55,318,326.13    | S/1,001.63          | S/14,022,757.21    | S/69,341,083.34  |
| Abr-22 | S/1,014.17          | S/54,943,017.69    | S/1,004.87          | S/14,068,232.42    | S/69,011,250.11  |
| May-22 | S/1,019.65          | S/57,247,416.05    | S/1,000.00          | S/17,000,000.00    | S/74,247,416.05  |
| Jun-22 | S/1,024.90          | S/60,557,780.38    | S/1,003.57          | S/17,060,751.36    | S/77,618,531.74  |
| Jul-22 | S/1,015.77          | S/63,037,494.10    | S/1,002.48          | S/15,237,741.58    | S/78,275,235.68  |
| Ago-22 | S/1,021.00          | S/63,362,032.68    | S/1,007.64          | S/15,316,190.69    | S/78,678,223.37  |
| Set-22 | S/1,026.43          | S/59,500,662.56    | S/1,013.00          | S/15,397,641.89    | S/74,898,304.45  |
| Oct-22 | S/1,014.41          | S/60,010,033.56    | S/1,005.11          | S/14,071,491.42    | S/74,081,524.98  |
| Nov-22 | S/1,019.45          | S/60,308,618.36    | S/1,010.11          | S/14,141,505.27    | S/74,450,123.63  |
| Dic-22 | S/1,024.64          | S/60,615,119.42    | S/1,015.24          | S/14,213,375.36    | S/74,828,494.78  |

### Evolución del Patrimonio (S/.)



Al cierre de diciembre del 2022, el patrimonio del Fondo de Inversión Factor SURA fue S/74,828,494.78

### Evaluación de la Política de Inversión – Límites de Inversión

| Evaluación de Política de Inversión - Límites Fondo Factor Sura |             |             |             |             | 31/12/2022 |
|-----------------------------------------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|------------|
| Límites por instrumento                                         |             |             |             |             |            |
| Tipo Instrumento                                                | % Cartera   | % Mín       | % Máx       | Márgen      |            |
| Facturas negociables                                            | 57.5%       | 0%          | 100%        | 42.5%       |            |
| Letras de cambio y pagarés                                      | 0.0%        | 0%          | 100%        | 100.0%      |            |
| Depósitos a plazo                                               | 42.5%       | 0%          | 100%        | 57.5%       |            |
| Fondos mutuos CP                                                | 0.0%        | 0%          | 40%         | 40.0%       |            |
| Fondos de inversión de acreencias CP                            | 0.0%        | 0%          | 30%         | 30.0%       |            |
| <b>Total instrumentos deuda</b>                                 | <b>100%</b> | <b>100%</b> | <b>100%</b> | <b>0.0%</b> |            |
| Derivados financieros                                           | 0%          | 0%          | 100%        | 100.0%      |            |
| Límites según moneda                                            |             |             |             |             |            |
| Moneda                                                          | % Cartera   | % Mín       | % Máx       | Márgen      |            |
| Soles                                                           | 83.9%       | 50%         | 100%        | 16.1%       |            |
| Dólares                                                         | 16.1%       | 0%          | 50%         | 33.9%       |            |
| Límites según mercado                                           |             |             |             |             |            |
| Mercado                                                         | % Cartera   | % Mín       | % Máx       | Márgen      |            |
| Local                                                           | 100.0%      | 100.0%      | 100%        | 0.0%        |            |
| Límites según clasificación de riesgo externa                   |             |             |             |             |            |
| Entidades financieras*                                          | % Cartera   | % Mín       | % Máx       | Márgen      |            |
| Desde A+ hasta B+                                               | 100.0%      | 0%          | 100%        | 0.0%        |            |
| Menor a B+                                                      | 0.0%        | 0%          | 0%          | 0.0%        |            |
| Instrumentos Derivados Financieros                              |             |             |             |             |            |
| A la moneda del valor cuota                                     | 0.0%        | 0%          | 100%        | 100.0%      |            |
| A monedas distintas del valor cuota                             | 0.0%        | 0%          | 50%         | 50.0%       |            |
| Swap                                                            | 0.0%        | 0%          | 0%          | 0.0%        |            |
| Límites según plazo                                             |             |             |             |             |            |
| Plazo                                                           | Cantidad    | Máximo      | Márgen      |             |            |
| Facturas con plazo > 365 días                                   | 0           | 0           | 0           |             |            |

Al cierre de año, el fondo no presentó excesos en la política de inversión.

---

Procedimiento de selección de la Sociedad Auditora

Mediante Asamblea de Participes de fecha 02 de mayo de 2022 se delegó en el Comité de Vigilancia la designación de la sociedad auditora para 2022 y mediante Comité de Vigilancia de fecha 11 de julio de 2022, se aprobó designar como auditores externos del Fondo a la firma Caipo y Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada. representantes de KPMG , para el periodo 2022.

---

## **EQUIPO DE VENTAS Y SERVICIOS**

Al cierre de 2022, Fondos SURA SAF S.A.C. cuenta con un equipo compuesto por 33 Asesores de Inversión, 9 Asesores Patrimoniales, 55 Asesores Comisionistas, 6 Asesores Institucionales, 1 Banqueros de Inversión, 4 Banqueros Patrimoniales y 5 Asesores de Servicio al Cliente.

## **PROCEDIMIENTO DE SUSCRIPCIÓN**

La participación en los fondos de inversión administrados por Fondos SURA SAF S.A.C. se realiza de acuerdo con lo establecido en el Reglamento de Participación del Fondo, con la firma de contrato de suscripción de cuotas o el contrato de transferencia de cuotas. Una vez firmado el contrato – previa información y evaluación del cliente - se hace entrega del Reglamento de Participación, el código único de cliente y la respectiva contraseña del cliente.

## **PROCEDIMIENTO DE RESCATE**

Por la naturaleza de los Fondos de Inversión no se permite el rescate de cuotas hasta la liquidación del Fondo.

## **COMISIONES**

Las comisiones unificadas aplicables a los fondos bajo administración al finalizar el ejercicio 2022 fueron:

| <b>FONDO</b>                               | <b>MONEDA</b> | <b>COMISION UNIFICADA</b> |
|--------------------------------------------|---------------|---------------------------|
| FIRBI SURA Asset Management - Clase A      | Dólares       | 1.50% + IGV               |
| FIRBI SURA Asset Management - Clase B      | Dólares       | 1.25% + IGV               |
| FIRBI SURA Asset Management - Clase C      | Dólares       | 1.00% + IGV               |
| FIRBI SURA Asset Management II - Clase A   | Dólares       | 1.50% + IGV               |
| FIRBI SURA Asset Management II - Clase B   | Dólares       | 1.25% + IGV               |
| SURA Préstamos Latinoamericanos - Clase A  | Dólares       | 0.00% + IGV               |
| SURA Préstamos Latinoamericanos - Clase A1 | Dólares       | 0.00% + IGV               |
| Factor SURA – Clase A                      | Soles         | 1.50% + IGV               |
| Factor SURA – Clase B                      | Soles         | 1.50% + IGV               |

## **CONTINGENCIAS SIGNIFICATIVAS**

Al cierre del ejercicio ninguno de los Fondos de Inversión administrados por Fondos SURA SAF S.A.C. registra procesos judiciales, administrativos o arbitrales iniciados o que sea previsible se inicien en contra o a favor, que tengan un impacto significativo sobre los resultados de operación y la posición financiera de los Fondos.