

Política de Inversiones al 31/12/2020
Fondo: BBVA PERU SOLES

POLÍTICA DE INVERSIONES	% Actual	% MIN sobre el Activo Total	% MAX sobre el Activo Total
SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS			
Instrumentos representativos de deuda o pasivos	100.00%	100%	100%
Instrumentos representativos de deuda del Estado Peruano	75.27%	75%	100%
SEGÚN MONEDA			
Inversiones en moneda del valor cuota	99.9%	75%	100%
Inversiones en moneda distinta al valor cuota	0.00%	0%	25%
SEGÚN MERCADO			
Inversiones en el mercado local o nacional	99.85%	75%	100%
Inversiones en el mercado extranjero	0.00%	0%	25%
SEGÚN CLASIFICACIÓN DE RIESGO			
LOCAL	24.58%	0%	100%
Inversiones con clasificación de riesgo mejores o iguales a categoría:			
Categoría AAA hasta AA- y CP-1 en Corto Plazo	0.00%	0%	25%
Categoría A+ hasta A- y CP-2 en Corto Plazo	0.00%	0%	25%
Inversiones en Entidades Financieras			
Categoría A+ hasta A-	24.58%	0%	25%
Categoría B+ hasta B-	0.00%	0%	25%
INTERNACIONAL	0.00%	0%	25%
Inversiones con clasificación de riesgo mejores o iguales a categoría:			
BBB- o Mejor	0.00%	0%	25%
BB- o Mejor (2)	0.00%	0%	0%
ESTADO	75.27%	75%	100%
Instrumentos del Banco Central de Reserva del Perú	66.82%	0%	100%
Instrumentos emitidos por el Gobierno Central	8.45%	0%	100%
Instrumentos sin Clasificación		0%	25%
INSTRUMENTOS DERIVADOS (1)			
Forward a la moneda del valor cuota	0.00%	0%	100%
Forward a monedas distintas del valor cuota		0%	25%
Swaps		0%	100%
Duración del Portafolio	0.9503	0.25	1.00

(1) Los porcentajes de inversión en derivados se consideran respecto del activo subyacente, considerando para ello su monto notional o total de los flujos coberturados con respecto al valor total de la cartera del Fondo Mutuo. Adicionalmente a lo señalado, se podrá contratar forwards con el fin de liquidar anticipadamente una determinada posición.