



Asset Management SAF

Oportunidad Especial Soles 4

Enero 2020

POLITICA DE INVERSIONES	% MIN	% MAX	% Actual
SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS			
Instrumentos representativos de deudas o pasivos	95%	99.60%	97%
SEGÚN MONEDA			
Inversiones en moneda del valor cuota	100%	100%	100%
Inversiones en moneda distinta al valor cuota	0%	0%	0%
SEGÚN MERCADO			
Inversiones en el mercado local o nacional	0%	100%	71%
Inversiones en el mercado extranjero	0%	100%	29%
SEGÚN CLASIFICACION DE RIESGO (1)			
Inversiones con calificaciones de riesgo local:			
Categoría AAA hasta AA- en Largo Plazo y CP2 en Corto Plazo	0%	99.60%	68%
Inversiones en Entidades Financieras			
Categoría A+ hasta A-	0%	99.60%	0%
Categoría B+ hasta B-	0%	0%	0%
Inversiones con clasificaciones de riesgo internacional:			
Categoría AAA hasta BBB- para la deuda de Largo Plazo	0%	99.60%	29%
Categoría CP1 hasta CP3 para la deuda de Corto Plazo	0%	40%	0%
Instrumentos con riesgo Estado Peruano	0%	99.60%	0%
Instrumentos de deuda sin Clasificación	0%	0%	0%
INSTRUMENTOS DERIVADOS (2)			
Forward a la moneda del valor cuota	0%	99.60%	0%
Opciones financieras o warrants (3)	0.40%	5%	2.56%