

**FARO CAPITAL**  
**CORTO PLAZO DOLARES FMIV**

**CUMPLIMIENTO DE LA POLÍTICA DE INVERSIONES AL 31 DE ENERO DE 2024**

	% Mínimo sobre activos totales	% Máximo sobre activos totales	Al 31.01.2024 (sobre el total de activos)	Alerta
<b>SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS</b>				
<b>Instrumentos representativos de deuda o pasivos <sup>1</sup></b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	
Largo Plazo (duración mayor a 1080 días calendario)	0%	40%	0%	Ok
Mediano Plazo (duración mayor a 360 días calendario y hasta 1080 días calendario)	0%	50%	0%	Ok
Corto Plazo (duración mayor a 90 días calendario y hasta 360 días calendario)	0%	100%	0%	Ok
Muy Corto Plazo (duración hasta 90 días calendario)	0%	100%	100%	Ok
Cuotas de Fondos de Inversión de instrumentos representativos de deuda	0%	25%	0%	Ok
Cuotas de Fondos Mutuos de instrumentos representativos de deuda	0%	25%	0%	Ok
<b>Instrumentos representativos de participación</b>	<b>0%</b>	<b>0%</b>	<b>0%</b>	
Cuotas de fondos mutuos y/o cuotas de fondos de inversión de instrumentos representativos de participación	0%	0%	0%	Ok
<b>SEGÚN MONEDA</b>				
Inversiones en moneda del valor cuota	65%	100%	67%	Ok
Inversiones en moneda distinta del valor cuota	0%	35%	32%	Ok
<b>SEGÚN MERCADO</b>				
Inversiones en el mercado local o nacional	0%	100%	100%	Ok
Inversiones en el mercado extranjero	0%	100%	0%	Ok
<b>SEGÚN CLASIFICACION DE RIESGO</b>				
<b>Local</b>				
Desde AAA hasta A- en Largo Plazo	0%	100%	0%	Ok
Desde BBB+ hasta BBB- en Largo Plazo	0%	50%	0%	Ok
Menor a BBB- en Largo Plazo	0%	0%	0%	Ok
CP-1 en Corto Plazo	0%	100%	0%	Ok
Desde CP-2 hasta CP-3 en Corto Plazo	0%	50%	0%	Ok
Menor a CP-3 en Corto Plazo	0%	0%	0%	Ok
<b>Entidades Financieras</b>				
Desde A+ hasta B+ <sup>2</sup>	0%	100%	100%	Ok
Desde B hasta B- <sup>2</sup>	0%	50%	0%	Ok
Menor a B-	0%	0%	0%	Ok
<b>Internacional</b>				
Mayor o igual a BB- en Largo Plazo <sup>3,4</sup>	0%	100%	0%	Ok
Menor o igual a B+ en Largo Plazo	0%	0%	0%	Ok
No menor a CP-3 en Corto Plazo	0%	100%	0%	Ok
Menor a CP-3 en Corto Plazo	0%	0%	0%	Ok
<b>Estado Peruano (Gobierno Central y BCRP)</b>	<b>0%</b>	<b>100%</b>	<b>0%</b>	<b>Ok</b>
<b>Sin clasificación <sup>5</sup></b>	<b>0%</b>	<b>35%</b>	<b>0%</b>	<b>Ok</b>
<b>Instrumentos derivados <sup>6</sup></b>				
<b>Forward:</b>				
A la moneda de valor cuota	0%	100%	33%	Ok
A monedas distintas del valor cuota	0%	35%	0%	Ok
Swaps de cobertura	0%	100%	0%	Ok
Futuros	0%	30%	0%	Ok