

FARO CAPITAL
DEUDA GLOBAL FMIV (Institucional)

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
SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS				
Instrumentos representativos de deuda o pasivos	95%	100%	100%	Ok
Instrumentos representativos de participación	0%	5%	0%	Ok
SEGÚN MONEDA				
Inversiones en moneda del valor cuota	0%	100%	96%	Ok
Inversiones en moneda distinta del valor cuota	0%	100%	4%	Ok
SEGÚN MERCADO				
Inversiones en el mercado local o nacional	0%	49%	8%	Ok
Inversiones en el mercado extranjero	0%	100%	92%	Ok
SEGÚN CLASIFICACION DE RIESGO				
Local				
Categoría AAA hasta B- en Largo Plazo	0%	100%	0%	Ok
Categoría CP1 hasta CP3 en Corto Plazo	0%	40%	0%	Ok
Categoría A en Entidades Financieras	0%	60%	1%	Ok
Categoría B+ hasta B- en Entidades Financieras	0%	30%	0%	Ok
Internacional				
Categoría AAA hasta BB- en Largo Plazo	0%	100%	65%	Ok
Categoría B+ a menos en Largo Plazo	0%	70%	26%	Ok
Categoría CP1 hasta CP3 en Corto Plazo	0%	40%	0%	Ok
Estado Peruano (GOBIERNO CENTRAL Y BCRP)	0%	60%	4%	Ok
Sin clasificación	0%	30%	4%	Ok
INSTRUMENTOS DERIVADOS				
Forward:				
A la moneda de valor cuota	0%	100%	1%	Ok
A monedas distintas del valor cuota	0%	70%	0%	Ok
Swaps de cobertura	0%	30%	0%	Ok
Futuros	0%	100%	0%	Ok
Opciones	0%	15%	0%	Ok