

FARO CAPITAL
DEUDA GLOBAL FMIV (Institucional)

CUMPLIMIENTO DE LA POLÍTICA DE INVERSIONES AL 30 DE SETIEMBRE DE 2024

	% Mínimo sobre activos totales	% Máximo sobre activos totales	Al 30.09.2024 (sobre el total de activos)	Alerta
SEGÚN TIPO DE INSTRUMENTOS				
Instrumentos representativos de deuda o pasivos	80%	100%	100%	Ok
Instrumentos representativos de participación	0%	20%	0%	Ok
SEGÚN MONEDA				
Inversiones en moneda del valor cuota	0%	100%	98%	Ok
Inversiones en moneda distinta del valor cuota	0%	100%	2%	Ok
SEGÚN MERCADO				
Inversiones en el mercado local o nacional	0%	49%	3%	Ok
Inversiones en el mercado extranjero	0%	100%	97%	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%	0%	Ok
Categoría B+ hasta B- en Entidades Financieras	0%	30%	0%	Ok
Internacional				
Categoría AAA hasta BB- en Largo Plazo	0%	100%	61%	Ok
Categoría B+ a menos en Largo Plazo	0%	70%	27%	Ok
Categoría CP1 hasta CP3 en Corto Plazo	0%	40%	6%	Ok
Estado Peruano (GOBIERNO CENTRAL Y BCRP)	0%	60%	0%	Ok
Sin clasificación	0%	30%	6%	Ok
INSTRUMENTOS DERIVADOS				
Forward:				
A la moneda de valor cuota	0%	100%	0%	Ok
A monedas distintas del valor cuota	0%	70%	0%	Ok
Swaps de cobertura	0%	100%	0%	Ok
Futuros	0%	100%	0%	Ok
Opciones	0%	15%	0%	Ok