

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 28/02/2017

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos Baf	1,117,600	4.35%
Bonos Titulizados	3,419,890	5.52%
Bonos Cofide	636,549	4.05%
Bonos Corporativos	4,690,945	4.71%
Depósitos a Plazo	3,042,112	0.60%
Total ME	12,907,097	3.89%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	9,170,914	6.40%
Depósitos a Plazo	58,769,000	4.65%
Bonos Corporativos	94,350,462	6.84%
Bonos Titulizados	798,382	7.38%
Bonos BAF	6,500,000	5.43%
Bonos Soberanos	68,264,685	6.53%
Bonos Cofide	11,870,000	6.55%
Total MN	249,723,443	6.18%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	12,907,097	3.89%
Soles	76,578,793	7.08%
Total Dólares	89,485,890	6.62%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ¹	TIR Adquisición
Dólares	42,090,043	3.46%
Soles	249,723,443	6.18%
Total Soles	291,813,486	5.78%

Rentabilidad Real	3.12%
--------------------------	--------------

¹ En el caso de bonos que amortizan, considera el capital actual.

Para el cálculo de la rentabilidad real se han considerado las variaciones anualizadas de los IPC de compra y cierre.