

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/03/2017

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	3,043,500	0.69%
Total ME	12,908,485	3.92%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	7,670,914	6.19%
Depósitos a Plazo	74,530,000	4.66%
Bonos Corporativos	94,235,062	6.84%
Bonos Titulizados	792,804	7.38%
Bonos BAF	6,000,000	5.44%
Bonos Soberanos	67,370,949	6.60%
Bonos Cofide	11,870,000	6.55%
Total MN	262,469,728	6.10%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	12,908,485	3.92%
Soles	80,809,645	8.65%
Total Dólares	93,718,130	8.00%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ¹	TIR Adquisición
Dólares	41,926,759	3.29%
Soles	262,469,728	6.10%
Total Soles	304,396,487	5.71%

Rentabilidad Real	3.42%
--------------------------	--------------

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

Para el cálculo de la rentabilidad real se han considerado los siguientes supuestos:

- Para instrumentos con más de un año de antigüedad de compra se utiliza la variación anualizada de los IPC de compra y cierre.
- Para instrumentos hasta un año de antigüedad de compra se utiliza el rango máximo de inflación del BCRP (3.00%)