

GERENCIA DE INVERSIONES

DEPARTAMENTO DE RENTA FIJA

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 30/04/2017

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos Baf	1,117,600	4.35%
Bonos Titulizados	3,407,736	5.53%
Bonos Cofide	636,549	4.05%
Bonos Corporativos	4,690,945	4.71%
Depósitos a Plazo	3,105,200	0.70%
Instrumento de Corto Plazo	53,000	2.50%
Total ME	13,011,031	3.90%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	5,800,936	5.94%
Depósitos a Plazo	75,701,600	4.66%
Bonos Corporativos	102,920,186	6.79%
Bonos Titulizados	787,192	7.38%
Bonos BAF	6,000,000	5.44%
Bonos Soberanos	67,370,949	6.63%
Bonos Cofide	11,870,000	6.55%
Total MN	270,450,862	6.10%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	13,011,031	3.90%
Soles	83,369,563	7.04%
Total Dólares	96,380,594	6.62%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ¹	TIR Adquisición
Dólares	42,207,784	3.31%
Soles	270,450,862	6.10%
Total Soles	312,658,646	5.72%

Rentabilidad Real	3.53%
--------------------------	--------------

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%)