

GERENCIA DE INVERSIONES

DEPARTAMENTO DE RENTA FIJA

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 30/07/2017

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos Baf	1,053,200	4.31%
Bonos Titulizados	3,395,427	5.53%
Bonos Corporativos	3,624,469	4.66%
Depósitos a Plazo	4,773,000	0.96%
Instrumento de Corto Plazo	53,000	2.50%
Total ME	12,899,096	3.48%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	7,224,629	5.83%
Depósitos a Plazo	92,068,000	4.24%
Bonos Corporativos	106,573,652	6.75%
Bonos Titulizados	770,147	7.38%
Bonos BAF	3,000,000	5.47%
Bonos Soberanos	91,928,810	6.41%
Bonos Cofide	11,670,000	6.55%
Total MN	313,235,237	5.87%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	12,899,096	3.48%
Soles	96,647,713	9.60%
Total Dólares	109,546,809	8.88%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ¹	TIR Adquisición
Dólares	41,805,970	3.06%
Soles	313,235,237	5.87%
Total Soles	355,041,208	5.54%

Rentabilidad Real	3.82%
--------------------------	--------------

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%)