

GERENCIA DE INVERSIONES

DEPARTAMENTO DE RENTA FIJA

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/08/2017

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 | 4,773,387 | 0.96% |
| Instrumento de Corto Plazo | 53,000 | 2.50% |
| Total ME | 12,899,483 | 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 | 87,846,717 | 4.19% |
| Bonos Corporativos | 111,884,135 | 6.71% |
| Bonos Titulizados | 764,395 | 7.38% |
| Bonos BAF | 3,000,000 | 5.47% |
| Bonos Soberanos | 108,741,286 | 6.19% |
| Bonos Cofide | 9,300,000 | 6.78% |
| Total MN | 328,761,162 | 5.84% |

3. Cartera Medida en Dólares

| | Inversión | TIR Adquisición |
|----------------------|--------------------|-----------------|
| Dólares | 12,899,483 | 3.48% |
| Soles | 101,438,186 | 10.77% |
| Total Dólares | 114,337,669 | 9.95% |

4. Cartera Medida en Soles

| | Inversión ² | TIR Adquisición |
|--------------------|------------------------|-----------------|
| Dólares | 41,807,224 | 3.07% |
| Soles | 328,761,162 | 5.84% |
| Total Soles | 370,568,385 | 5.53% |

| | |
|--------------------------|--------------|
| Rentabilidad Real | 3.70% |
|--------------------------|--------------|

^{1/} Incluye saldos en cuenta corriente.

^{2/} 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%)