

GERENCIA DE INVERSIONES

DEPARTAMENTO DE RENTA FIJA

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 30/09/2017

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos Baf	1,703,200	3.81%
Bonos Titulizados	3,395,427	5.53%
Bonos Corporativos	3,624,469	4.66%
Depósitos a Plazo	4,124,513	0.96%
Instrumento de Corto Plazo	53,000	2.50%
Total ME	12,900,609	3.58%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	7,224,629	5.83%
Depósitos a Plazo	97,300,492	3.86%
Bonos Corporativos	114,678,735	6.72%
Bonos Titulizados	758,608	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	341,003,750	5.71%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	12,900,609	3.58%
Soles	104,442,190	10.08%
Total Dólares	117,342,799	9.36%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	42,120,487	3.50%
Soles	341,003,750	5.71%
Total Soles	383,124,237	5.46%

Rentabilidad Real	3.65%
--------------------------	--------------

¹¹ Incluye saldos en cuenta corriente.

¹² 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%)