

GERENCIA DE INVERSIONES

DEPARTAMENTO DE RENTA FIJA

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/10/2017

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos Baf	1,703,200	3.81%
Bonos Titulizados	3,382,960	5.53%
Bonos Corporativos	3,624,469	4.66%
Depósitos a Plazo ¹	4,248,355	1.53%
Instrumento de Corto Plazo	53,000	2.50%
Total ME	13,011,984	3.74%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	7,224,629	5.83%
Depósitos a Plazo ¹	115,729,402	3.52%
Bonos Corporativos	116,760,533	6.69%
Bonos Titulizados	752,786	7.38%
Bonos BAF	3,000,000	5.47%
Bonos Soberanos	108,741,286	6.16%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
Total MN	361,508,636	5.49%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	13,011,984	3.74%
Soles	111,301,920	9.23%
Total Dólares	124,313,904	8.65%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	42,262,924	3.47%
Soles	361,508,636	5.49%
Total Soles	403,771,559	5.28%

Rentabilidad Real	3.73%
--------------------------	--------------

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%)