

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 29/02/2020

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	1,026,900	3.79%
Bonos Titulizados	2,306,435	5.50%
Bonos Corporativos	8,286,323	4.55%
Depósitos a Plazo ¹	2,721,545	1.40%
Total ME	14,341,202	4.05%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	11,837,731	3.68%
Depósitos a Plazo ¹	371,597,287	3.02%
Instrumento Corto Plazo	12,317,348	3.74%
Bonos Corporativos	239,971,340	5.68%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	263,723,705	5.73%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
Total MN	917,747,412	4.57%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,341,202	4.05%
Soles	266,090,870	0.15%
Total Dólares	280,432,073	0.35%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	49,462,807	5.93%
Soles	917,747,412	4.57%
Total Soles	967,210,219	4.64%

Rentabilidad Real	3.29%
--------------------------	--------------

^{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%)