

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/03/2020

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	964,400	3.70%
Bonos Titulizados	2,306,435	5.50%
Bonos Corporativos	8,286,323	4.55%
Depósitos a Plazo ¹	2,800,326	1.41%
Total ME	14,357,483	4.03%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	11,837,731	3.68%
Depósitos a Plazo ¹	380,327,144	2.83%
Instrumento Corto Plazo	12,317,348	3.74%
Bonos Corporativos	241,981,333	5.65%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	274,262,343	5.71%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
Total MN	939,025,899	4.49%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,357,483	4.03%
Soles	273,210,910	0.87%
Total Dólares	287,568,393	1.03%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	49,346,669	5.66%
Soles	939,025,899	4.49%
Total Soles	988,372,568	4.54%

Rentabilidad Real	3.13%
--------------------------	--------------

^{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%)