

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 30/04/2020

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	964,400	3.70%
Bonos Titulizados	2,279,654	5.50%
Bonos Corporativos	8,286,323	4.55%
Depósitos a Plazo ¹	2,922,211	1.17%
Total ME	14,452,588	3.96%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	11,837,731	3.68%
Depósitos a Plazo ¹	374,514,224	2.85%
Instrumento Corto Plazo	12,317,348	3.74%
Bonos Corporativos	241,661,333	5.65%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	294,748,303	5.75%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
Total MN	953,378,939	4.54%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,452,588	3.96%
Soles	282,148,251	2.38%
Total Dólares	296,600,839	2.45%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	48,835,294	4.90%
Soles	953,378,939	4.54%
Total Soles	1,002,214,233	4.56%

Rentabilidad Real	3.15%
--------------------------	--------------

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%)