

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 30/06/2020

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	900,000	3.61%
Bonos Titulizados	2,279,654	5.50%
Bonos Corporativos	8,286,323	4.55%
Depósitos a Plazo ¹	3,023,626	0.10%
Total ME	14,489,603	3.71%

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	8,701,983	3.42%
Depósitos a Plazo ¹	427,954,711	1.83%
Instrumento Corto Plazo	10,401,180	3.61%
Bonos Corporativos	250,196,649	5.59%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	297,817,742	5.73%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
Total MN	1,013,372,265	4.02%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,489,603	3.71%
Soles	286,425,174	-3.36%
Total Dólares	300,914,777	-3.02%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	51,264,216	6.11%
Soles	1,013,372,265	4.02%
Total Soles	1,064,636,481	4.12%

Rentabilidad Real	2.78%
--------------------------	--------------

^{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%)