

## Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/07/2020

### TIR de Adquisición

#### 1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	900,000	3.61%
Bonos Titulizados	2,252,508	5.50%
Bonos Corporativos	8,286,323	4.55%
Depósitos a Plazo <sup>1</sup>	3,165,771	0.07%
<b>Total ME</b>	<b>14,604,602</b>	<b>3.67%</b>

#### 2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	8,701,983	3.42%
Depósitos a Plazo <sup>1</sup>	453,553,480	1.57%
Instrumento Corto Plazo	4,901,180	3.33%
Bonos Corporativos	253,266,545	5.58%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	303,016,668	5.73%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
<b>Total MN</b>	<b>1,041,739,855</b>	<b>3.86%</b>

#### 3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,604,602	3.67%
Soles	295,445,223	-2.53%
<b>Total Dólares</b>	<b>310,049,824</b>	<b>-2.24%</b>

#### 4. Cartera Medida en Soles

	Inversión <sup>2</sup>	TIR Adquisición
Dólares	51,495,825	5.84%
Soles	1,041,739,855	3.86%
<b>Total Soles</b>	<b>1,093,235,680</b>	<b>3.96%</b>

<b>Rentabilidad Real</b>	<b>2.51%</b>
--------------------------	--------------

<sup>1/</sup> Incluye saldos en cuenta corriente.

<sup>2/</sup> 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%)