

## Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al 31/08/2020

### 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>	3,183,468	0.07%
<b>Total ME</b>	<b>14,622,298</b>	<b>3.66%</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>	464,260,016	1.19%
Instrumento Corto Plazo	4,901,180	3.33%
Bonos Corporativos	263,252,636	5.43%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.44%
Bonos BAF	6,000,000	4.71%
Bonos Soberanos	319,664,268	5.68%
Bonos Cofide	9,300,000	6.78%
<b>Total MN</b>	<b>1,079,080,083</b>	<b>3.66%</b>

#### 3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	14,622,298	3.66%
Soles	304,480,836	-0.69%
<b>Total Dólares</b>	<b>319,103,134</b>	<b>-0.49%</b>

#### 4. Cartera Medida en Soles

	Inversión <sup>2</sup>	TIR Adquisición
Dólares	51,821,424	5.92%
Soles	1,079,080,083	3.66%
<b>Total Soles</b>	<b>1,130,901,507</b>	<b>3.77%</b>

<b>Rentabilidad Real</b>	<b>2.39%</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%)