

	Jun-11		
	Valor en Libros	Int. Deveng. y Fluct. de Valores	Valorización
MERCADO LOCAL	2,560,500,467	149,266,636	2,709,767,103
GOBIERNO	165,591,695	4,574,985	304,607,304
Bonos de Tesoro	-	-	-
Bonos Soberanos	165,591,695	4,574,985	170,166,680
B.C.R.	-	-	-
Certificados de Depósito	-	-	-
CD BCRP	72,536,908	32,392	72,569,300
TABOADA FINANCE LTD	60,953,421	917,903	61,871,324
B.C.R.	141,921,397	160,071	142,081,468
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	-	-	-
Depósitos a Plazo	141,921,397	160,071	142,081,468
ENTIDADES FINANCIERAS	1,414,248,948	8,156,720	1,422,405,668
	-	-	-
	-	-	-
CITIBANK	-	-	-
Depósitos a Plazo	-	-	-
Otras Captaciones del SF	-	-	0
CONTINENTAL	409,865,161	2,550,878	412,416,040
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	1,337,792	-	1,337,792
Depósitos a Plazo	385,083,697	2,254,319	387,338,016
Bonos de Arrendamiento Financiero	5,541,288.21	65,684	5,606,972.69
Bonos Subordinados	3,619,269	31,817	3,651,086
Otras Captaciones del SF	14,283,115	199,058	14,482,173
Cuentas por cobrar	-	-	-
CREDITO	366,485,776	1,614,222	368,099,998
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	356,626	-	356,626
Depósitos a Plazo	362,695,031	1,585,686	364,280,717
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Subordinados	1,704,629	14,811	1,719,440
Bonos Hipotecarios	26,798	436	27,233
Otras Captaciones del SF	1,702,693	13,289	1,715,982
Cuentas por cobrar	-	-	-
NUEVO MUNDO EN LIQUIDACION	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
INTERAMERICANO DE FINANZAS	32,327,998	152,928	32,480,926
Depósitos a Plazo	26,184,498	152,131	26,336,629
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,987,500.00	452	3,987,952.19
Bonos Hipotecarios	2,156,000	345	2,156,345
INTERBANK	226,629,622	1,509,757	228,139,378
Depósitos a Plazo	221,979,622	1,451,159	223,430,780
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Hipotecarios	900,000	1,887	901,887
Bonos Subordinados	3,750,000	56,711	3,806,711
FINANCIERO	41,848,617	224,584	42,073,201
Depósitos a Plazo	41,848,617	224,584	42,073,201
NACION	2,679,170	-	2,679,170
Depósitos a Plazo	0	-	0
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	2,679,170	-	2,679,170
SCOTIABANK PERU S.A.A.	193,092,832	942,685	194,035,517
Depósitos a Plazo	180,612,354	838,550	181,450,904
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	569,997	-	569,997
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Otras Captaciones del SF	11,910,480	104,135	12,014,616
MIBANCO	51,673,945	342,441	52,016,386
Depósitos a Plazo	51,673,945	342,441	52,016,386
Certificados de Depósito	0	-	-
COFIDE	11,771,009	162,066	11,933,075
Otras Captaciones del SF	11,771,009	162,066	11,933,075
Instrumentos de Corto Plazo	-	-	-
HSBC BANK PERU	45,123,726	296,365	45,420,091
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,639,010.19	31,319	3,670,329.54
Depósitos a Plazo	41,484,716	265,045	41,749,761
SANTANDER PERU	20,014,556	157,219	20,171,775
Depósitos a Plazo	20,014,556	157,219	20,171,775
DEUTCHE BANK PERU	-	-	-
Depósitos a Plazo	0	-	0
COOPERACION ANDINA DE FOMENTO - C	12,736,536	203,576	12,940,111
Otras Captaciones del SF	12,736,536	203,576	12,940,111
EMP. DE ARRENDAMIENTO FINANCIERO	-	-	-
CREDILEASING	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
LATINO LEASING EN LIQUIDACION	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
	-	-	-
ENTIDADES NO FINANCIERAS	838,738,428	1,934,235	840,672,663
TRANSMANTARO	5,000,000	16,735	5,016,735
Bonos Corporativos	5,000,000	16,735	5,016,735
REFINERIA LA PAMPILLA	-	-	-
Instrumentos Corto Plazo	-	-	-
EDEGEL	16,979,622	203,486	17,183,108
Bonos Corporativos	16,979,622	203,486	17,183,108
EDELNOR	22,148,836	329,947	22,478,783
Bonos Corporativos	22,148,836	329,947	22,478,783
ENERSUR	5,536,754	1,679	5,538,433
Bonos Corporativos	5,536,754	1,679	5,538,433
DUKE ENERGY INTERNATIONAL	0	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
ELECTROANDES	0	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
LUZ DELSUR	19,537,846	254,136	19,791,981
Bonos Corporativos	19,537,846	254,136	19,791,981
REP	896,975	10,625	907,600
Bonos Corporativos	896,975	10,625	907,600
ACEROS AREQUIPA	-	-	-
Instrumentos Corto Plazo	-	-	-
TELEFONICA MOVILES	18,485,455	263,560	18,749,015

Bonos Corporativos	15,374,818	227,659	15,602,477
Papeles Comerciales	3,110,637	35,901	3,146,538
TELEFONICA	24,925,400	376,330	25,301,730
Bonos Corporativos	24,925,400	376,330	25,301,730
Papeles Comerciales	-	-	-
COMPASS GROUP	13,029,184	-	13,029,184
Fondo de Inversión	13,029,184	-	13,029,184
GLORIA	10,292,940	130,551	10,423,492
Bonos Corporativos	10,292,940	130,551	10,423,492
Papeles Comerciales	-	-	-
E. WONG & METRO	335,444	1,007	336,451
Bonos Titulizados	335,444	1,007	336,451
ATACCOCHA	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
AGUAYTIA	706,800	4,217	711,017
Bonos Titulizados	706,800	4,217	711,017
TGP	15,908,836	62,630	15,971,466
Bonos Corporativos	15,908,836	62,630	15,971,466
DROKASA	-	-	-
Bonos Titulizados	-	-	-
BARRICK MISQUICHILCA	16,423,000	69,825	16,492,825
Bonos Corporativos	16,423,000	69,825	16,492,825
CAHUA	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	0
TRASVASE OLMOS	474,666	2,373	477,040
Bonos Corporativos	474,666	2,373	477,040
SOC. MINERA CERRO VERDE	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	0
SAGA FALABELLA	418,678	4,995	423,673
Bonos Corporativos	418,678	4,995	423,673
Instrumentos Corto Plazo	0	-	0
PLUSPETROL CAMISEA	655,000	1,502	656,502
Bonos Corporativos	655,000	1,502	656,502
CEMENTOS LIMA	14,532,387	126,222	14,658,609
Bonos Corporativos	14,532,387	126,222	14,658,609
ALICORP	1,746,729	31,266	1,777,996
Bonos Corporativos	1,746,729	31,266	1,777,996
YURA	4,187,461	25,391	4,212,852
Bonos Corporativos	4,187,461	25,391	4,212,852
PERU LNG	2,986,056	17,757	3,003,813
Bonos Corporativos	2,986,056	17,757	3,003,813
ELECTROPERÚ S.A.	617,211,385	-	617,211,385
Acciones	617,211,385	-	617,211,385
FONDOS MUTUOS	26,318,973	-	26,318,973
ING Renta Soles	3,595,501	-	3,595,501
ING Renta Acciones	4,373,647	-	4,373,647
ING Renta Balanceada	866,476	-	866,476
BBVA Agresivo Soles	3,425,509	-	3,425,509
BBVA Soles	1,148,473	-	1,148,473
BBVA Largo Plazo (moderado soles)	2,036,961	-	2,036,961
BBVA Balanceado Soles	2,255,875	-	2,255,875
BBVA ASIA GARANTIZADO (1)	0	-	0
BCP Conservador	0	-	0
BCP Acciones FMIV (\$)	2,755,832	-	2,755,832
BCP Equilibrado Soles	3,322,402	-	3,322,402
BCP Moderado Soles	2,538,298	-	2,538,298
ING Renta Fund (\$)	0	-	0
MERCADO EXTERNO	587,721,279	1	587,721,280
Depósitos a Plazo	834	1	836
FLAR	167,029,231	-	167,029,231
ADMINISTRADORES DE CARTERA	420,691,214	-	420,691,214
TOTAL US\$	3,148,221,746	149,266,637	3,297,488,383

TC	2.748
----	-------

Fuente : Sub Dirección de Inversiones Financieras - Dirección de Inversiones.

NOTA:

- La duración del fondo será de dos (2) años, prorrogables por periodo mínimo de un (1) año por acuerdo de la Asamblea General de Participes
(*) El 21.10.2004 se llevo a cabo la A.G de Participes de COMPASS. Acordando la reducción y sucesivo aumento de capital del Fondo, en tal sentido el 14.01.2005 fueron suscritas 1'190,545 cuotas pagadas al 100% y 5'357,455 cuotas pagadas al 25%. (1'339,3 en tal sentido el monto devuelto es de US\$ 4'023,804.07 (el 75% de las participaciones suscritas pendiente de pago) considerando el valor cuota de US\$ 1.001421883
A la fecha se ha cancelado en total 3'333'527 cuotas de participación

_ El 10.05.2005 la SAFI fijo pagar el 10% adicional equivalente a US\$ 536,507
_ El 23.06.2005 la SAFI fijo pagar el 5% adicional equivalente a US\$ 268,254.00
_ El 30.06.2005 la SAFI fijo pagar el 5% adicional equivalente a US\$ 268,254.00
_ El 14.12.2005 la SAFI fijo pagar el 5% adicional equivalente a US\$ 268,254.00
_ El 06.01.2006 la SAFI fijo pagar el 5% adicional equivalente a US\$ 268,254.00
_ El 14.03.2006 la SAFI fijo pagar el 10% adicional equivalente a US\$ 536,507.00
_ El 14.12.2006 la SAFI fijo pagar el 10% adicional equivalente a US\$ 536,507.00
_ El 02.01.2008 la SAFI fijo pagar el 10% adicional equivalente a US\$ 536,507.00
_ En Junta General Extraordinaria de Participes del Fondo del 13.01.2006 se acordó ampliar el plazo de duración a cuatro (4) años, prorrogables por periodos mínimos de dos (2) años por acuerdo de la Asamblea General de Participes.

_ En Junta General Extraordinaria de Participes del Fondo del 25.01.2008 se acordó renovar y ampliar el plazo del Fondo por un periodo adicional de dos años, de tal manera que el vencimiento del Plazo del Fondo sea en abril del 2010.

- El 19.06.2008 la SAFI fijo pagar el 15% adicional equivalente a US \$ 804,760.90, de forma que las 5'357,455 cuotas de participación se encuentran pagadas al 100%.

(**) El 20.06.2008 se llevo a cabo la A.U.G.E. de Participes de COMPASS. Acordando el aumento de capital del Fondo, en tal sentido el 09.07.2008 fueron suscritas 5'357,455 cuotas pagadas al 10%, por lo cual se realizó un desembolso equivalente a US \$ 535

(1) El 28.11.2008 se llevó a cabo la A.G de Participes de COMPASS, acordando el cambio de denominación del Fondo de Dólares Americanos a Nuevos Soles a partir del 01.01.2009, tomando en cuenta el tipo de cambio CONASEV al cierre del 31.12.08 presentando un nuevo valor nominal de S/. 3.14

El 17.12.2008 se efectuó el pago correspondiente al 15% adicional de las participaciones suscritas equivalente a US\$ 803,618.18, acumulando el 25% de cuotas de participación pagadas.

Según el Acuerdo N°8-2009 de la Sesión N°7-2009 d e fecha 25.09.2009, el Directorio, autorizó a la Secretaría Técnica a retirar al FCR - **Paramonga** del Macrofondo.

Según el Acuerdo N°18-2009 de la Sesión N°9-2009 de fecha 11.12.2009, el Directorio, autorizó a la Secretaría Técnica a retirar del FCR a: **ENCI**, **ENAFER** y **RTDel** Macrofondo.

El Tesoro Aport el 30 de abril de 2010: S/. 1,110,064 para continuar con el pago de planilla.

El Tesoro aportó el 30 de abril de 2010: S/. 1,110,064 para el pago de planillas del Fondo Paramonga.

En virtud del DU 029-2010 el 30 de abril se hace la transferencia de: S/. 8,095,663.00 para pago de planillas de Electrolima

En Virtud del D.S. 101-2010-EF el 10 de junio se hace la transferencia de US\$ 11'281'071 para constituir el fondo ENAPU Matarani D.S. N°101-2010- EF