

	Sep-11		
	Valor en Libros	Int. Deveng. y Fluct. de Valores	Valorización
MERCADO LOCAL	2,729,863,270	17,456,572	2,747,319,842
GOBIERNO	321,877,022	1,637,376	325,101,800
Bonos de Tesoro	-	-	-
Bonos Soberanos	173,986,254	1,637,376	175,623,630
B.C.R.	-	-	-
Certificados de Depósito	-	-	-
CD Repos	71,394,654	553,195	71,947,849
CD BCRP	16,070,429	112,023	16,182,453
TABOADA FINANCE LTD	60,425,685	922,183	61,347,868
B.C.R.	155,122,655	130,754	155,253,409
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	-	-	-
Depósitos a Plazo	155,122,655	130,754	155,253,409
ENTIDADES FINANCIERAS	1,431,239,326	11,601,773	1,442,841,099

CITIBANK	-	-	-
Depósitos a Plazo	-	-	-
Otras Captaciones del SF	-	-	0
CONTINENTAL	432,607,298	3,859,247	436,466,546
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	107,316	-	107,316
Depósitos a Plazo	400,234,488	3,242,640	403,477,128
Bonos de Arrendamiento Financiero	5,498,896.10	114,404	5,613,299.64
Bonos Subordinados	3,588,388	84,301	3,672,689
Otras Captaciones del SF	23,178,211	417,903	23,596,114
Cuentas por cobrar	-	-	-
CREDITO	589,601,529	4,286,062	593,887,591
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	189,083	-	189,083
Depósitos a Plazo	586,004,883	4,230,892	590,235,775
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Subordinados	1,692,814	35,770	1,728,584
Bonos Hipotecarios	26,798	937	27,734
Otras Captaciones del SF	1,687,951	18,463	1,706,414
Cuentas por cobrar	-	-	-
NUEVO MUNDO EN LIQUIDACION	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
INTERAMERICANO DE FINANZAS	24,735,726	110,344	24,846,070
Depósitos a Plazo	19,079,726	82,003	19,161,729
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,750,000.00	409	3,750,409.31
Bonos Hipotecarios	1,906,000	27,932	1,933,932
INTERBANK	98,579,294	780,490	99,359,784
Depósitos a Plazo	93,929,294	655,272	94,584,566
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Hipotecarios	900,000	4,880	904,880
Bonos Subordinados	3,750,000	120,338	3,870,338
FINANCIERO	28,860,029	268,710	29,128,739
Depósitos a Plazo	28,860,029	268,710	29,128,739
NACION	198,521	-	198,521
Depósitos a Plazo	0	-	0
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	198,521	-	198,521
SCOTIABANK PERU S.A.A.	156,685,049	1,145,167	157,830,217
Depósitos a Plazo	144,300,144	930,375	145,230,519
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	577,546	-	577,546
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Otras Captaciones del SF	11,807,359	214,793	12,022,152
MIBANCO	38,481,128	274,075	38,755,203
Depósitos a Plazo	38,481,128	274,075	38,755,203
Certificados de Depósito	0	-	-
COFIDE	15,546,580	214,314	15,760,894
Otras Captaciones del SF	15,546,580	214,314	15,760,894
Instrumentos de Corto Plazo	-	-	-
HSBC BANK PERU	26,463,652	219,022	26,682,674
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,607,503.61	76,388	3,683,892.00
Depósitos a Plazo	22,856,149	142,633	22,998,782
SANTANDER PERU	6,854,257	36,230	6,890,487
Depósitos a Plazo	6,854,257	36,230	6,890,487
DEUTSCHE BANK PERU	-	-	-
Depósitos a Plazo	0	-	0
COOPERACION ANDINA DE FOMENTO	12,626,263	408,111	13,034,374
Otras Captaciones del SF	12,626,263	408,111	13,034,374
EMP. DE ARRENDAMIENTO FINANCIERO	-	-	-
CREDILEASING	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
LATINO LEASING EN LIQUIDACION	-	-	-
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
ENTIDADES NO FINANCIERAS	821,624,267	2,499,267	824,123,534
TRANSMANTARO	5,000,000	93,716	5,093,716
Bonos Corporativos	5,000,000	93,716	5,093,716
REFINERIA LA PAMPILLA	-	-	-
Instrumentos Corto Plazo	-	-	-
EDEGEL	16,875,902	313,319	17,189,221
Bonos Corporativos	16,875,902	313,319	17,189,221
EDELNOR	21,957,071	397,018	22,354,089
Bonos Corporativos	21,957,071	397,018	22,354,089
ENERSUR	5,488,817	96,219	5,585,036
Bonos Corporativos	5,488,817	96,219	5,585,036
DUKE ENERGY INTERNATIONAL	0	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
ELECTROANDES	0	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
LUZ DELSUR	18,986,291	380,892	19,367,184
Bonos Corporativos	18,986,291	380,892	19,367,184
REP	805,544	9,532	815,076
Bonos Corporativos	805,544	9,532	815,076
ACEROS AREQUIPA	-	-	-
Instrumentos Corto Plazo	-	-	-
TELEFONICA MOVILES	13,618,326	172,151	13,790,477
Bonos Corporativos	13,618,326	172,151	13,790,477
Papeles Comerciales	-	-	-
TELEFONICA	21,102,092	320,740	21,422,832
Bonos Corporativos	21,102,092	320,740	21,422,832
Papeles Comerciales	-	-	-

COMPASS GROUP	13,109,196	-	13,109,196
Fondo de Inversión	13,109,196	-	13,109,196
GLORIA	9,752,886	185,336	9,938,222
Bonos Corporativos	9,752,886	185,336	9,938,222
Papeles Comerciales	-	-	-
E. WONG & METRO	317,424	964	318,388
Bonos Titulizados	317,424	964	318,388
ATACCOCHA	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	-
AGUAYTIA	624,900	3,770	628,670
Bonos Titulizados	624,900	3,770	628,670
TGP	15,571,284	61,301	15,632,585
Bonos Corporativos	15,571,284	61,301	15,632,585
DROKASA	-	-	-
Bonos Titulizados	-	-	-
BARRICK MISQUICHILCA	16,423,000	156,545	16,579,545
Bonos Corporativos	16,423,000	156,545	16,579,545
CAHUA	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	0
TRASVASE OLMOS	465,882	2,355	468,237
Bonos Corporativos	465,882	2,355	468,237
SOC. MINERA CERRO VERDE	-	-	-
Bonos Corporativos	0	-	0
SAGA FALABELLA	209,143	2,502	211,645
Bonos Corporativos	209,143	2,502	211,645
Instrumentos Corto Plazo	0	-	0
PLUSPETROL CAMISEA	655,000	1,502	656,502
Bonos Corporativos	655,000	1,502	656,502
CEMENTOS LIMA	14,406,566	165,657	14,572,223
Bonos Corporativos	14,406,566	165,657	14,572,223
ALICORP	1,587,307	4,027	1,591,334
Bonos Corporativos	1,587,307	4,027	1,591,334
YURA	4,151,206	79,205	4,230,411
Bonos Corporativos	4,151,206	79,205	4,230,411
PERU LNG	2,986,052	52,516	3,038,568
Bonos Corporativos	2,986,052	52,516	3,038,568
ELECTROPERÚ S.A.	611,867,564	-	611,867,564
Acciones	611,867,564	-	611,867,564
FONDOS MUTUOS	25,662,814	-	25,662,814
ING Renta Soles	3,669,126	-	3,669,126
ING Renta Acciones	4,162,464	-	4,162,464
ING Renta Balanceada	857,554	-	857,554
BBVA Agresivo Soles	3,257,289	-	3,257,289
BBVA Soles	1,162,548	-	1,162,548
BBVA Largo Plazo (moderado soles)	2,017,108	-	2,017,108
BBVA Balanceado Soles	2,204,327	-	2,204,327
BBVA ASIA GARANTIZADO (1)	0	-	0
BCP Conservador	0	-	0
BCP Acciones FMIV (\$)	2,579,766	-	2,579,766
BCP Equilibrado Soles	3,234,199	-	3,234,199
BCP Moderado Soles	2,518,433	-	2,518,433
ING Renta Fund (\$)	0	-	0
MERCADO EXTERNO	602,060,467	0	602,060,467
Depósitos a Plazo	67	0	67
FLAR	167,554,119	-	167,554,119
ADMINISTRADORES DE CARTERA	434,506,291	-	434,506,291
TOTAL US\$	3,331,923,737	17,456,572	3,349,380,309

TC	2.772
----	-------

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 llevo 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°16-2009 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 **RTP** del 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