

	Dic-11		
	Valor en Libros	Int. Deveng. y Fluct. de Valores	Valorización
MERCADO LOCAL	2,826,363,016	23,608,352	2,849,971,367
GOBIERNO	335,730,430	4,716,714	341,873,873
Bonos de Tesoro	-	-	-
Bonos Soberanos	187,101,040	4,716,714	191,817,753
CD Repos	0	-	0
CD BCRP	86,477,257	467,113	86,944,370
TABOADA FINANCE LTD	62,152,134	959,616	63,111,750
B.C.R.	144,712,430	161,451	144,873,882
SalDOS en Cta Cte. y Ahorros	-	-	-
Depósitos a Plazo	144,712,430	161,451	144,873,882
ENTIDADES FINANCIERAS	1,508,148,464	15,446,192	1,523,594,656
CONTINENTAL	438,033,860	3,755,098	441,788,958
SalDOS en Cta Cte. y Ahorros	221,509	-	221,509
Depósitos a Plazo	390,747,752	3,171,112	393,918,865
Bonos de Arrendamiento Financiero	5,637,578.85	67,490	5,705,068.77
Bonos Subordinados	3,691,376	32,804	3,724,179
Otras Captaciones del SF	36,599,258	483,692	37,082,950
Cuentas por cobrar	1,136,386	-	1,136,386
CREDITO	649,719,324	7,637,733	657,357,057
SalDOS en Cta Cte. y Ahorros	219,505	-	219,505
Depósitos a Plazo	620,846,732	7,407,441	628,254,173
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Subordinados	1,731,466	15,075	1,746,541
Bonos Hipotecarios	13,643	225	13,868
Otras Captaciones del SF	26,907,978	214,991	27,122,969
Cuentas por cobrar	-	-	-
INTERAMERICANO DE FINANZAS	24,162,384	142,821	24,305,205
Depósitos a Plazo	18,987,384	142,183	19,129,567
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,750,000.00	414	3,750,413.80
Bonos Hipotecarios	1,425,000	223	1,425,223
INTERBANK	128,355,751	574,467	128,930,219
Depósitos a Plazo	123,855,751	515,240	124,370,991
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Bonos Hipotecarios	750,000	1,825	751,825
Bonos Subordinados	3,750,000	57,403	3,807,403
FINANCIERO	25,974,026	468,878	26,442,904
Depósitos a Plazo	25,974,026	468,878	26,442,904
NACION	104,730	-	104,730
Depósitos a Plazo	0	-	0
SalDOS en Cta Cte. y Ahorros	104,730	-	104,730
SCOTIABANK PERU S.A.A.	103,805,543	1,104,355	104,909,898
Depósitos a Plazo	91,108,781	996,696	92,105,477
SalDOS en Cta Cte. y Ahorros	552,050	-	552,050
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-
Otras Captaciones del SF	12,144,712	107,659	12,252,371
MIBANCO	49,939,689	559,228	50,498,917
Depósitos a Plazo	46,382,189	559,228	46,941,417
Certificados de Depósito	3,557,500	-	3,557,499.91
COFIDE	18,214,566	467,348	18,681,914
Otras Captaciones del SF	18,214,566	467,348	18,681,914
Instrumentos de Corto Plazo	-	-	-
HSBC BANK PERU	28,241,187	401,497	28,642,684
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,710,575.14	32,442	3,743,017.33
Depósitos a Plazo	24,530,612	369,054	24,899,667
SANTANDER PERU	12,987,013	100,223	13,087,236
Depósitos a Plazo	12,987,013	100,223	13,087,236
COOPERACION ANDINA DE FOMENTO - CA	12,987,013	209,886	13,196,899
Otras Captaciones del SF	12,987,013	209,886	13,196,899
CREDISCOTIA	8,196,660	11,610	8,208,270
Depósitos a Plazo	8,196,660	11,610	8,208,270
FINANCIERA EDYCAR	3,716,141	3,570	3,719,711
Depósitos a Plazo	3,716,141	3,570	3,719,711
FALABELLA	3,710,575	9,480	3,720,055
Depósitos a Plazo	3,710,575	9,480	3,720,055
ENTIDADES NO FINANCIERAS	837,771,691	1,857,266	839,628,957
TRANSANTARO	2,500,000	8,965	2,508,965
Bonos Corporativos	2,500,000	8,965	2,508,965
EDEGEL	14,562,152	193,042	14,755,194
Bonos Corporativos	14,562,152	193,042	14,755,194
EDELNOR	21,150,278	342,938	21,493,217
Bonos Corporativos	21,150,278	342,938	21,493,217
ENERSUR	5,645,640	2,780	5,648,420
Bonos Corporativos	5,645,640	2,780	5,648,420
LUZ DELSUR	22,647,495	316,362	22,963,857
Bonos Corporativos	22,647,495	316,362	22,963,857
REP	714,114	8,421	722,535
Bonos Corporativos	714,114	8,421	722,535
TELEFONICA MOVILES	14,007,421	178,222	14,185,643
Bonos Corporativos	14,007,421	178,222	14,185,643
Papeles Comerciales	-	-	-
TELEFONICA	21,322,820	334,290	21,657,110
Bonos Corporativos	21,322,820	334,290	21,657,110

COMPASS GROUP	14,506,040	-	14,506,040
Fondo de Inversión	14,506,040	-	14,506,040
GLORIA	9,063,701	116,853	9,180,554
Bonos Corporativos	9,063,701	116,853	9,180,554
E. WONG & METRO	310,946	999	311,946
Bonos Titulizados	310,946	999	311,946
AGUAYTIA	0	-	0
Bonos Titulizados	0	-	0
TGP	15,226,559	62,892	15,289,451
Bonos Corporativos	15,226,559	62,892	15,289,451
BARRICK MISQUICHILCA	16,423,000	75,972	16,498,972
Bonos Corporativos	16,423,000	75,972	16,498,972
TRASVASE OLMOS	456,922	2,410	459,332
Bonos Corporativos	456,922	2,410	459,332
SAGA FALABELLA	0	-	0
Bonos Corporativos	0	-	0
PLUSPETROL CAMISEA	639,024	1,582	640,607
Bonos Corporativos	639,024	1,582	640,607
CEMENTOS LIMA	14,818,182	131,054	14,949,236
Bonos Corporativos	14,818,182	131,054	14,949,236
ALICORP	1,632,659	29,546	1,662,205
Bonos Corporativos	1,632,659	29,546	1,662,205
YURA	4,021,999	24,068	4,046,067
Bonos Corporativos	4,021,999	24,068	4,046,067
PERU LNG	2,986,047	17,952	3,004,000
Bonos Corporativos	2,986,047	17,952	3,004,000
TOTTUS	1,293,812	8,916	1,302,729
Papeles Comerciales	1,293,812	8,916	1,302,729
ELECTROPERÚ S.A.	629,349,494	-	629,349,494
Acciones	629,349,494	-	629,349,494
FONDOS MUTUOS	24,493,384	-	24,493,384
ING Renta Soles	2,113,575	-	2,113,575
ING Renta Acciones	4,364,028	-	4,364,028
ING Renta Balanceada	904,570	-	904,570
BBVA Agresivo Soles	3,485,853	-	3,485,853
BBVA Soles	1,212,691	-	1,212,691
BBVA Largo Plazo (moderado soles)	2,104,610	-	2,104,610
BBVA Balanceado Soles	1,642,634	-	1,642,634
BCP Acciones FMIV (\$)	2,674,463	-	2,674,463
BCP Equilibrado Soles	3,367,447	-	3,367,447
BCP Moderado Soles	2,623,512	-	2,623,512
MERCADO EXTERNO	606,954,442	1	606,954,444
Depósitos a Plazo	54	1	55
FLAR	167,723,895	-	167,723,895
ADMINISTRADORES DE CARTERA	439,230,493	-	439,230,493
		-	
TOTAL US\$	3,433,317,458	23,608,353	3,456,925,811

TC	2.695
----	-------

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

NOTA:

- La duración del fondo será de dos (2) años, prorrogables por periodo minimo de un (1) año por acuerdo de la Asamblea General de Partícipes

(*) El 21.10.2004 se llevo a cabo la A.G de Partícipes 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 Partícipes 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 Partícipes.

_ En Junta General Extraordinaria de Partícipes 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 fijó 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 Partícipes 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 Partícipes 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 de 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 d e fecha 11.12.2009, el Directorio, autorizó a la Secretaría Técnica a retirar del FCR a: **ENCI, ENAFER y RTP**del Macrofondo.

El Tesoro Aportó 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