

	Jun-12				Mar-12		
	Valor en Libros	Int. Deveng. y Fluct. de Valores	Valorización		Valor en Libros	Int. Deveng. y Fluct. de Valores	Valorización
MERCADO LOCAL	2,355,905,977	671,912,049	3,027,818,026	2,816,429,191	131,112,723	2,947,541,914	
GOBIERNO	254,131,758	4,745,538	259,861,389	254,560,266	1,663,093	355,330,015	
Bonos de Tesoro	-	-	-	-	-	-	-
Bonos Soberanos	191,397,676	4,745,538	196,143,214	191,732,059	1,663,093	193,395,152	
CD Repos	0	-	0	0	-	0	-
Taboada Finance Ltda	62,734,082	984,093	63,718,176	62,828,207	980,552	63,808,760	
B.C.R.	97,378,277	105,965,290	203,343,567	183,795,949	250,402	184,046,351	
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	-	-	-	-	-	-	-
Depósitos a Plazo	97,378,277	113,118	97,491,395	183,795,949	250,402	184,046,351	
CD BCRP	104,446,812	1,405,361	105,852,172	0	98,126,104	98,126,104	
ENTIDADES FINANCIERAS	1,161,598,500	558,615,035	1,720,213,535	1,538,953,470	27,510,728	1,566,464,198	
CONTINENTAL	81,406,246	399,805,229	481,211,475	440,082,046	8,928,883	449,010,929	
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	1,045,882	-	1,045,882	106,087	-	106,087	
Depósitos a Plazo	19,056,180	397,484,651	416,540,831	396,642,983	8,031,695	404,674,678	
Bonos de Arrendamiento Financiero	5,684,325.84	67,273	5,751,598.43	5,691,886.72	118,567	5,810,453.26	
Bonos Subordinados	3,726,872	32,751	3,759,623	3,731,996	88,018	3,820,015	
Otras Captaciones del SF	50,331,461	2,220,553	52,552,014	33,246,437	690,603	33,937,039	
Cuentas por cobrar	1,561,526	-	1,561,526	662,656	-	662,656	
CREDITO	636,752,220	51,518,734	688,270,954	657,331,366	13,640,838	670,972,204	
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	85,514	-	85,514	805,651	-	805,651	
Depósitos a Plazo	621,184,758	37,868,899	659,053,658	627,564,794	12,939,499	640,504,293	
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-	-	-	-	
Bonos Subordinados	1,744,494	15,060	1,759,555	1,746,602	37,039	1,783,640	
Bonos Hipotecarios	0	-	0	13,643	477	14,120	
Otras Captaciones del SF	13,737,453	13,634,774	27,372,228	27,200,675	663,823	27,864,499	
Cuentas por cobrar	-	-	-	-	-	-	
INTERAMERICANO DE FINANZAS	19,885,403	30,724	19,916,127	16,899,587	112,186	17,011,773	
Depósitos a Plazo	16,632,903	30,318	16,663,221	12,349,587	91,280	12,440,867	
Bonos de Arrendamiento Financiero	2,187,500.00	240	2,187,740.32	3,125,000.00	346	3,125,346.41	
Bonos Hipotecarios	1,065,000	166	1,065,166	1,425,000	20,560	1,445,560	
INTERBANK	117,222,659	354,423	117,577,082	101,203,672	577,055	101,780,727	
Depósitos a Plazo	112,872,659	296,173	113,168,832	96,703,672	452,029	97,155,701	
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-	-	-	-	
Bonos Hipotecarios	600,000	1,539	601,539	750,000	4,688	754,688	
Bonos Subordinados	3,750,000	56,711	3,806,711	3,750,000	120,338	3,870,338	
FINANCIERO	18,726,592	19,213,863	37,940,455	39,384,846	747,093	40,131,939	
Depósitos a Plazo	18,726,592	19,213,863	37,940,455	39,384,846	747,093	40,131,939	
NACION	65,272	-	65,272	259,981	-	259,981	
Depósitos a Plazo	0	-	0	0	-	0	
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	65,272	-	65,272	259,981	-	259,981	
SCOTIABANK PERU S.A.A.	132,510,556	47,272,772	179,783,328	113,136,706	790,976	113,927,682	
Depósitos a Plazo	107,846,442	37,654,869	145,501,311	95,484,735	532,340	96,017,074	
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	124,788	-	124,788	22,564	-	22,564	
Bonos de Arrendamiento Financiero	-	-	-	-	-	-	
Otras Captaciones del SF	24,539,326	9,617,903	34,157,229	17,629,407	258,636	17,888,043	
MIBANCO	33,611,189	20,486,858	54,098,047	50,718,633	1,023,185	51,741,818	
Depósitos a Plazo	30,044,944	15,679,904	45,724,848	47,147,037	954,265	48,101,302	
Certificados de Depósito	3,566,245	113,614	3,679,858.91	3,571,596	68,920	3,640,515.66	
Otras Captaciones del SF	4,681,648	11,692	4,693,340.13	-	-	-	
COFIDE	32,275,104	675,751	32,950,855	18,335,106	251,877	18,586,982	
Otras Captaciones del SF	32,275,104	675,751	32,950,855	18,335,106	251,877	18,586,982	
Instrumentos de Corto Plazo	0	-	0	-	-	-	
HSBC BANK PERU	31,839,888	355,169	32,195,057	38,993,908	619,744	39,613,653	
Bonos de Arrendamiento Financiero	3,745,318.35	32,234	3,777,552.65	3,750,937.73	79,426	3,830,363.33	
Depósitos a Plazo	28,094,569	322,935	28,417,504	35,242,971	540,318	35,783,289	
SANTANDER PERU	7,490,637	3,850,843	11,341,479	3,750,938	55,848	3,806,785	
Depósitos a Plazo	7,490,637	3,850,843	11,341,479	3,750,938	55,848	3,806,785	
COOPERACION ANDINA DE FOMENTO - CAF	13,108,614	209,523	13,318,137	13,128,282	424,338	13,552,620	
Otras Captaciones del SF	13,108,614	209,523	13,318,137	13,128,282	424,338	13,552,620	
CREDISCOTIA	22,471,910	10,821,504	33,293,414	31,943,702	210,875	32,154,577	
Depósitos a Plazo	16,853,933	4,089,572	20,943,505	26,317,295	162,728	26,480,023	
Certificados de Depósito	5,617,978	6,731,932	12,349,909.29	5,626,407	48,147	5,674,553.40	
FINANCIERA EDYCAR	7,490,637	3,888,465	11,379,102	8,158,290	61,556	8,219,846	
Depósitos a Plazo	7,490,637	3,888,465	11,379,102	8,158,290	61,556	8,219,846	
FALABELLA	6,741,573	131,177	6,872,750	5,626,407	66,275	5,692,682	
Depósitos a Plazo	6,741,573	131,177	6,872,750	5,626,407	66,275	5,692,682	
ENTIDADES NO FINANCIERAS	842,797,441	1,602,093	844,399,534	839,119,506	2,581,843	841,701,349	
TRANSMANTARO	2,500,000	8,538	2,508,538	2,500,000	47,814	2,547,814	
Bonos Corporativos	2,500,000	8,538	2,508,538	2,500,000	47,814	2,547,814	
EDEGEL	14,651,685	192,697	14,844,382	14,666,167	265,114	14,931,280	
Bonos Corporativos	14,651,685	192,697	14,844,382	14,666,167	265,114	14,931,280	
EDELNOR	19,475,655	312,388	19,788,044	21,380,345	378,363	21,758,708	
Bonos Corporativos	19,475,655	312,388	19,788,044	21,380,345	378,363	21,758,708	
ENERSUR	5,698,502	1,734	5,700,236	5,707,052	100,576	5,807,627	
Bonos Corporativos	5,698,502	1,734	5,700,236	5,707,052	100,576	5,807,627	
LUZ DELSUR	20,518,727	244,142	20,762,869	20,549,512	500,118	21,049,630	
Bonos Corporativos	20,518,727	244,142	20,762,869	20,549,512	500,118	21,049,630	
REP	531,253	6,053	537,305	622,683	7,132	629,816	
Bonos Corporativos	531,253	6,053	537,305	622,683	7,132	629,816	
ACEROS AREQUIPA	-	-	-	-	-	-	
Instrumentos Corto Plazo	-	-	-	-	-	-	
TELEFONICA MOVILES	14,138,577	176,918	14,315,495	14,159,790	180,073	14,339,863	
Bonos Corporativos	14,138,577	176,918	14,315,495	14,159,790	180,073	14,339,863	
Papeles Comerciales	-	-	-	-	-	-	
TELEFONICA	13,823,970	207,137	14,031,107	14,990,623	370,656	15,361,279	
Bonos Corporativos	13,823,970	207,137	14,031,107	14,990,623	370,656	15,361,279	
COMPASS GROUP	15,067,414	-	15,067,414	14,883,646	-	14,883,646	
Fondo de Inversión	15,067,414	-	15,067,414	14,883,646	-	14,883,646	
GLORIA	7,629,157	97,156	7,726,313	8,618,970	166,185	8,785,155	
Bonos Corporativos	7,629,157	97,156	7,726,313	8,618,970	166,185	8,785,155	
E. WONG & METRO	282,472	848	283,320	298,612	949	299,562	
Bonos Titulizados	282,472	848	283,320	298,612	949	299,562	
AGUAYTIA	0	-	0	0	-	0	
Bonos Titulizados	0	-	0	0	-	0	
TGP	14,514,976	59,953	14,574,929	14,874,508	61,151	14,935,659	
Bonos Corporativos	14,514,976	59,953	14,574,929	14,874,508	61,151	14,935,659	
BARRICK MISQUICHILCA	12,500,000	65,002	12,565,002	16,423,000	168,497	16,591,497	
Bonos Corporativos	12,500,000	65,002	12,565,002	16,423,000	168,497	16,591,497	
TRASVASE OLMOS	438,460	2,192	440,652	447,782	2,336	450,118	
Bonos Corporativos	438,460	2,192	440,652	447,782	2,336	450,118	
SAGA FALABELLA	0	-	0	0	-	0	
Bonos Corporativos	0	-	0	0	-	0	

PLUSPETROL CAMISEA	607,074	1,559	608,633	623,049	1,663	624,712
Bonos Corporativos	607,074	1,559	608,633	623,049	1,663	624,712
CEMENTOS LIMA	14,956,929	129,936	15,086,864	14,979,370	172,878	15,152,248
Bonos Corporativos	14,956,929	129,936	15,086,864	14,979,370	172,878	15,152,248
ALICORP	1,498,135	26,817	1,524,951	1,500,383	4,016	1,504,399
Bonos Corporativos	1,498,135	26,817	1,524,951	1,500,383	4,016	1,504,399
YURA	1,000,534	9,640	1,010,174	4,065,749	76,359	4,142,108
Bonos Corporativos	1,000,534	9,640	1,010,174	4,065,749	76,359	4,142,108
PERU LNG	2,986,039	17,757	3,003,796	2,986,043	52,711	3,038,755
Bonos Corporativos	2,986,039	17,757	3,003,796	2,986,043	52,711	3,038,755
TOTTUS	1,305,927	41,626	1,347,552	1,307,886	25,251	1,333,137
Papeles Comerciales	1,305,927	41,626	1,347,552	1,307,886	25,251	1,333,137
ELECTROPERÚ S.A.	635,242,280	-	635,242,280	636,195,381	-	636,195,381
Acciones	635,242,280	-	635,242,280	636,195,381	-	636,195,381
FONDOS MUTUOS	43,429,676	-	43,429,676	27,338,954	-	27,338,954
Sura Soles	2,219,547	-	2,219,547	2,173,810	-	2,173,810
Sura Acciones	4,757,067	-	4,757,067	5,282,544	-	5,282,544
Sura Renta Balanceada	973,677	-	973,677	1,015,159	-	1,015,159
BBVA Tipo III Agresivo	3,511,223	-	3,511,223	3,842,386	-	3,842,386
BBVA Soles	1,263,106	-	1,263,106	1,245,364	-	1,245,364
BBVA Largo Plazo	2,194,522	-	2,194,522	2,225,396	-	2,225,396
BBVA Balanceado Soles	1,743,675	-	1,743,675	1,807,958	-	1,807,958
BCP Acciones FMIV (\$)	2,940,404	-	2,940,404	3,212,648	-	3,212,648
BCP Equilibrado Soles	3,604,913	-	3,604,913	3,736,099	-	3,736,099
BCP Moderado Soles	2,767,499	-	2,767,499	2,797,589	-	2,797,589
AC CAPITALES FONDO INMOBILIARIO II	250,000	-	250,000	0	-	0
Línea Amarilla S.A.C.	17,204,042	-	17,204,042			
MERCADO EXTERNO	619,204,822	0	619,204,822	610,435,480	0	610,435,480
Depósitos a Plazo	101	0	101	101	0	101
FLAR	168,501,790	-	168,501,790	168,022,658	-	168,022,658
ADMINISTRADORES DE CARTERA	450,702,931	-	450,702,931	442,412,721	-	442,412,721
		-				
TOTAL US\$	2,975,110,799	671,912,049	3,647,022,848	3,426,864,670	131,112,723	3,557,977,393

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 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 de fecha 11.12.2009, el Directorio, autorizó a la Secretaría Técnica a retirar del FCR a: ENCI, ENAFER y RTPdel 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