

Rentabilidad - Cartera D. Leg. N° 1133 al31/07/2024

TIR de Adquisición

1. Posición de la Cartera en Moneda Extranjera

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	-	0.00%
Bonos Subordinados	11,390,000	7.55%
Bonos Titulizados	5,996,367	5.16%
Bonos Corporativos	35,935,346	5.45%
Depósitos a Plazo	25,358,214	0.00%
Total ME	78,679,927	3.98%
	299,298,441.13	

2. Posición de la Cartera en Moneda Nacional

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	109,651,797	5.91%
Depósitos a Plazo	521,575,774	0.00%
Instrumento Corto Plazo	64,584,108	6.68%
BCRP	227,934,117	5.49%
Bonos Corporativos	739,479,119	6.49%
Bonos Titulizados	3,000,000	7.58%
Bonos BAF	-	0.00%
Bonos Soberanos	831,876,705	6.51%
Bonos Cofide	9,300,000	0.00%
Bonos Subordinados	10,076,238	7.92%
Total MN	2,517,477,858	5.02%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	78,679,927	3.98%
Soles	677,287,559.38	6.80%
Total Dólares	755,967,486	6.51%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión ²	TIR Adquisición
Dólares	292,453,287.51	4.90%
Soles	2,517,477,858	5.02%
Total Soles	2,809,931,146	5.01%

Rentabilidad Real	2.49%
--------------------------	--------------

^{1/} Incluye saldos en cuenta corriente.

^{2/} 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%)

A	Fondo CALCULADO	2,809,931,146
B	Fondo REPORTE	1,460,963
C	Saldos	60,766,155.24
B+C		62,227,118
A-(B+C)	Diferencia	2,747,704,027.97

Rentabilidad CALCULADA	5.01
Rentabilidad REPORTE	7.58
Diferencia	2.57

DOLARES		
Moneda	dolares	
Etiquetas de fila	Suma de Tasa Equiv S/	Suma de Valor Presente MN
Bonos Corporativos		
P00255	0.061740549	4,990,681
P00280	0.063386526	5,479,251
P00937	0.069911579	542,046
P00942	0.069911579	2,738,760
P01840	0.038612157	14,855,814
P02648	0.030135978	4,381,840
P02731	0.03803507	5,137,772
P02965	0.048860648	2,865,270
P03142	0.092370476	578039.9625
P03143	0.09158474	3801026.502
P03144	0.092926311	288965.7874
P03150	0.088633553	2023067.61
P03169	0.065217256	3563302.05
P03179	0.064223539	2854953.36
P03221	0.05676146	3510216.079
P03222	0.056387364	3408515.056
P03240	0.060053026	4590996.795
P03244	0.060287958	3509673.992
P03282	0.061486054	3451946.937
P03358	0.031041592	10024079.94
P03407	0.050509337	3973705.313
P03410	0.049223697	8015245.206
P03423	0.057072202	5430397.613
P03437	0.055857007	6961682.892
P03472	0.049252264	1763854.884
P03487	0.057050541	3559409.533
P03495	0.055144772	3558593.838
P03742	0.058185522	7057529.862
P03763	0.057906936	6262564.702
P03898	0.053922378	4392478.032
Bonos Subordinados		
P03062	0.089763424	20,034,630
P03863	0.068168974	22302000
Bonos Titulizados		
P00160	0.077555937	1,613,490
P00162	0.069395883	1,427,652
P00190	0.075350254	821,303
P00201	0.073635135	2,694,436
P02101	-0.007514993	1,756,024
P02209	0.001332451	1,991,692
P03034	0.067025828	4,272,857
P03041	0.064908021	7,711,041
Depósitos a Plazo		
C01	-0.00277418	59
C02	-0.00277418	1,920
C07	-0.00277418	7,448,929
C09	-0.00277418	2,473
P03867	-0.00277418	18585000
P03888	-0.000107478	3717000
P03889	-0.000107478	9738540
P03892	-0.000107478	11151000
P03894	-2.24132E-05	4928742
P03895	-2.24132E-05	7434000
P03902	-0.000145423	6318900
P03904	-0.000145423	9441180
P03916	-0.000191683	8043588
P03921	0	7445151

Moneda dolares

5.35%

Etiquetas de fila	Suma de Valor Presente	Suma de Rentabilidad
Bonos Corporativos	35,935,346	195,867,333
Bonos Subordinados	11,390,000	85,994,257
Bonos Titulizados	5,996,367	30,947,107
Depósitos a Plazo	25,358,214	-
Total general	78,679,927	312,808,697

%
5.45%
7.55%
5.16%
0.00%

Bonos Corporativos	133,571,679.60	728,038,877.43
Bonos Titulizados	22,288,495.32	115,030,395.01
Depósitos a Plazo	94,256,482.59	-
Bonos Subordinados	42,336,630.00	319,640,653.27

45,370,500.11	0.076200015	544726986.2	0.0542718	590,097,486.26
19,951,050.95	0.04388544	3013718.3	0.0757946	22,964,769.25
106,788,118.75	0.027169258	432644338.8	0.0649806	539,432,457.58

7.84%

5.66%

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Bonos BAF	-	0.00%
Bonos Titulizados	3,315,265	4.42%
Bonos Corporativos	12,130,259	4.13%
Depósitos a Plazo	10,531,890	2.81%
Total ME	25,977,415	3.63%

-0.08%

3. Cartera Medida en Dólares

	Inversión	TIR Adquisición
Dólares	25,977,415	3.63%
Soles	460,068,234.57	12.60%
Total Dólares	486,045,649	12.12%

SOLES		
Moneda	soles	
Etiquetas de fila	Suma de Valor Presente	Suma de Rentabilidad
BCRP	227,934,117	1,251,606,239
Bonos Corporativos	739,479,119	4,796,322,922
Bonos Soberanos		5,417,784,272
	831,876,705	
Bonos Subordinados	10,076,238	79,822,002
Bonos Titulizados	3,000,000	22,738,500
Certificado de Depósito	109,651,797	648,420,795
Depósitos a Plazo	521,575,774	-
Instrumento Corto Plazo	64,584,108	431,106,979
Bonos Cofide	9,300,000	63,266,490
Total general	2,517,477,858	12,711,068,199

5.60%
4.81%
5.75%

Instrumento	Inversión	TIR Adquisición
Certificado de Depósito	22,743,238	5.68%
Depósitos a Plazo	432,644,339	6.50%
Instrumento Corto Plazo	13,944,875	6.43%
BCRP	140,197,141	6.06%
Bonos Corporativos	544,726,986	5.43%
Bonos Titulizados	3,013,718	7.58%
Bonos BAF	-	0.00%
Bonos Soberanos	607,151,722	6.11%
Bonos Cofide	-	0.00%
Bonos Subordinados	4,080,274	2.40%
Total MN	1,768,502,294	5.98%

4. Cartera Medida en Soles

	Inversión²	TIR Adquisición
Dólares	99,857,181.53	5.22%
Soles	1,768,502,294	5.98%
Total Soles	1,868,359,475	5.94%

Rentabilidad Real	4.26%
--------------------------	--------------

Certificado de Depósito
Depósitos a Plazo
Instrumento Corto Plazo
BCRP
Bonos Corporativos
Bonos Titulizados
Bonos BAF
Bonos Soberanos
Bonos Subordinados
Total MN

Certificado de Depósito
Depósitos a Plazo
Instrumento Corto Plazo
BCRP

Bonos Corporativos
Bonos Titulizados
Bonos BAF
Bonos Subordinados

Bonos Soberanos

CORTO PLAZO
BONO CORPORATIVO
BONO SOBERANO
Total MN

GRD

%
5.49%
6.49%
6.51%
7.92%
7.58%
5.91%
0.00%
6.68%

		22,743,238	5.68%	22,743,238
615,832,256.24	-	615,832,256.24	6.17%	560,722,811
		13,944,875	6.43%	13,944,875
		140,197,141	6.06%	140,197,141
873,050,798	4,992,190,255	873,050,798	5.60%	
25,288,495	108,732,757	25,288,495	5.00%	
		-	0.00%	-
		607,151,722	6.11%	607,151,722
		4,080,274	2.40%	4,080,274
		2,302,288,800	5.91%	

		22,743,238	5.68%	22,743,238
473,128,925.84	2,925,039,327.85	473,128,925.84	6.17%	473,128,926
		13,944,875	6.43%	13,944,875
		140,197,141	6.06%	140,197,141
		650,014,180	6.14%	
591,355,702	3,006,372,872	591,355,702	5.60%	
15,757,597	37,493,940	15,757,597	5.00%	
		-	0.00%	-
		4,080,274	2.40%	4,080,274
		611,193,573	5.56%	
		607,151,722	6.11%	607,151,722
		607,151,722	6.11%	

		650,014,180	6.14%
		611,193,573	5.56%
		607,151,722	6.11%
		1,868,359,475	5.94%