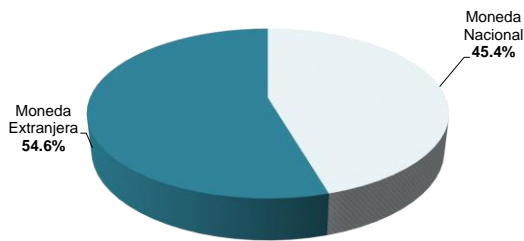


VALOR DEL PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR

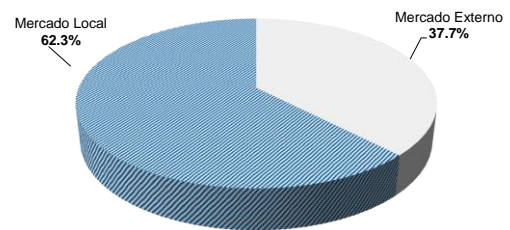
DESCRIPCIÓN	A Valor de Mercado		A Valor Contable	
	Equivalente en Millones		Equivalente en Millones	
	USD	S/	USD	S/
Activos Financ. Mcdo. Local	2,979	9,826	2,861	9,436
Activos Financ. Mcdo. Externo	1,830	6,034	1,830	6,034
Activos Inmobiliarios	166	546	166	546
Acciones Electroperú	1,170	3,858	562	1,854
TOTAL	6,144	20,264	5,418	17,870

T.C. 3.298 (SBS 30.09.2018)

PORTAFOLIO¹ FCR POR MONEDA (%)



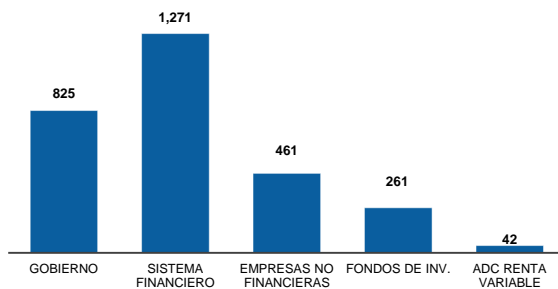
PORTAFOLIO¹ FCR POR MERCADO (%)



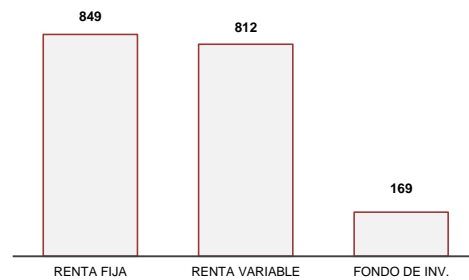
¹ A valor contable. No incluye (i) Acciones de Electroperú, (ii) Activos inmobiliarios.

TIPO DE INVERSIONES POR MERCADO (Expresado en Millones USD)

MERCADO LOCAL



MERCADO EXTERNO



² Activos financieros a valor Contable

PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR	A VALOR DE MERCADO (Expresado en MM USD)	%	A VALOR CONTABLE (Expresado en MM USD)	%
I. CAJA E INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO	1,018.3	16.6%	1,018.3	18.8%
1. Local	811.0	13.2%	811.0	15.0%
Depósitos y Certificados BCRP	-		-	
Depósitos en el SF	807.9	13.1%	807.9	14.9%
Instrumentos de Corto Plazo	3.0	0.0%	3.0	0.1%
2. Extranjero	207.3	3.4%	207.3	3.8%
Depósitos en el BCRP	-		-	
Depósitos en el SF	207.3	3.4%	207.3	3.8%
Instrumentos de Corto Plazo	-		-	
II. RENTA FIJA	2,506.3	40.8%	2,388.1	44.1%
1. Local	1,864.6	30.3%	1,746.5	32.2%
Gobierno	841.3	13.7%	825.1	15.2%
Bonos SF y EnF	826.5	13.5%	788.8	14.6%
Instrumentos Titulizados	179.6	2.9%	115.3	2.1%
Instrumentos de Mediano y Largo Plazo	-		-	
Fondos de Renta Fija	17.3	0.3%	17.3	0.3%
2. Extranjero	641.7	10.4%	641.7	11.8%
Mandato Renta Fija Defensiva	163.9	2.7%	163.9	3.0%
Mandato Core Plus	477.8	7.8%	477.8	8.8%
Instrumentos de Deuda	-		-	
Fondos de Renta Fija	-		-	
III. RENTA VARIABLE	854.0	13.9%	854.0	15.8%
1. Local	42.4	0.7%	42.4	0.8%
Mandato MILA Plus (Perú)	42.4	0.7%	42.4	0.8%
Fondos Mutuos	-		-	
2. Extranjero	811.6	13.2%	811.6	15.0%
Mandato ACWI	520.4	8.5%	520.4	9.6%
Mandato MILA Plus (ex Perú)	188.3	3.1%	188.3	3.5%
Instrumentos de Capital	102.9	1.7%	102.9	1.9%
IV. INVERSIONES ALTERNATIVAS	596.0	9.7%	596.0	11.0%
1. Local	426.9	6.9%	426.9	7.9%
Inversiones Inmobiliaria	165.5	2.7%	165.5	3.1%
Fondos de Inversión	261.4	4.3%	261.4	4.8%
2. Extranjero	169.1	2.8%	169.1	3.1%
Mandato de Private Equity	136.7	2.2%	136.7	2.5%
Inversión Directa en Private Equity	32.4	0.5%	32.4	0.6%
A. PORTAFOLIO FCR	4,974.6	81.0%	4,856.4	89.6%
B. ACCIONES ELECTROPERÚ	1,169.8	19.0%	562.0	10.4%
PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR (A+B)	6,144.4	100.0%	5,418.4	100.0%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS* AL 30 DE SETIEMBRE DE 2018

(Expresado en USD)

Set-18	VALORIZACIÓN	%
MERCADO LOCAL	3,423,289,333	65.2%
GOBIERNO	825,060,763	15.7%
Bonos Soberanos	668,432,269	12.7%
Bonos Globales	112,116,980	2.1%
Taboada Finance Ltda **	44,511,514	0.8%
ENTIDADES FINANCIERAS	1,063,747,632	20.3%
BANCO CONTINENTAL	288,742,506	5.5%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	146,309	0.0%
Depósitos a Plazo	172,548,546	3.3%
Bonos de Arrendamiento Financiero	12,155,446	0.2%
Bonos Subordinados	11,426,432	0.2%
Otras Captaciones del SF	92,566,904	1.8%
Cuentas por cobrar	65,721	0.0%
Cuentas por pagar	-166,852	0.0%
BANCO DE CRÉDITO	118,902,911	2.3%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	52,963	0.0%
Depósitos a Plazo	42,153,661	0.8%
Bonos Subordinados	1,161,840	0.0%
Otras Captaciones del SF	75,534,447	1.4%
Cuentas por cobrar	-	0.0%
BIF	83,449,582	1.6%
Depósitos a Plazo	83,449,582	1.6%
INTERBANK	149,500,907	2.8%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	138,847,480	2.6%
Depósitos a Plazo	10,645,549	0.2%
Cuentas por cobrar	42,896	0.0%
Cuentas por pagar	-35,018	0.0%
BANCO FINANCIERO	16,618,685	0.3%
Depósitos a Plazo	16,618,685	0.3%
BANCO DE LA NACIÓN	201,298	0.0%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	201,298	0.0%
SCOTIABANK PERU S.A.A.	236,661,459	4.5%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	63,484	0.0%
Depósitos a Plazo	220,808,723	4.2%
Otras Captaciones del SF	15,774,546	0.3%
Cuentas por cobrar	14,705	0.0%
MIBANCO	48,087,598	0.9%
Depósitos a Plazo	40,335,317	0.8%
Otras Captaciones del SF	7,752,282	0.1%
COFIDE	21,242,627	0.4%
Otras Captaciones del SF	21,242,627	0.4%
SANTANDER PERÚ	24,242,030	0.5%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	946	0.0%
Depósitos a Plazo	23,565,768	0.4%
Bonos de Arrendamiento Financiero	606,989	0.0%
Cuentas por cobrar	114,163	0.00%
Cuentas por pagar	-45,836	0.0%
BANCO GNB PERÚ S.A.	27,705,255	0.5%
Depósitos a Plazo	23,866,763	0.5%
Bonos Subordinados	3,838,491	0.1%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS* AL 30 DE SETIEMBRE DE 2018

(Expresado en USD)

Set-18	VALORIZACIÓN	%
CREDISCOTIA	27,150,410	0.5%
Depósitos a Plazo	27,150,410	0.5%
FINANCIERA CONFIANZA	5,056,255	0.1%
Depósitos a Plazo	2,026,054	0.0%
Certificado de Depósito	3,030,201	0.1%
COMPARTAMOS FINANCIERA	5,018,897	0.1%
Depósitos a Plazo	5,018,897	0.1%
FINANCIERA EFECTIVA	457,732	0.0%
Depósitos a Plazo	457,732	0.0%
FONDO MIVIVIENDA	10,709,479	0.2%
Otras Captaciones del SF	10,709,479	0.2%
ENTIDADES NO FINANCIERAS	1,492,046,536	28.4%
EDEGEL	3,852,627	0.1%
Bonos Corporativos	3,852,627	0.1%
EDELNOR	38,507,420	0.7%
Bonos Corporativos	38,507,420	0.7%
ENERSUR	21,659,513	0.4%
Bonos Corporativos	21,659,513	0.4%
LUZ DEL SUR	58,943,057	1.1%
Bonos Corporativos	58,943,057	1.1%
REP	11,941,601	0.2%
Bonos Corporativos	11,941,601	0.2%
GLORIA	26,867,110	0.5%
Bonos Corporativos	26,867,110	0.5%
ALICORP	6,074,810	0.1%
Bonos Corporativos	6,074,810	0.1%
TRAVASE OLMOS	134,600	0.0%
Bonos Corporativos	134,600	0.0%
UNIÓN ANDINA DE CEMENTOS	4,562,479	0.1%
Bonos Corporativos	4,562,479	0.1%
LINEA AMARILLA S.A.C.	45,209,409	0.9%
Bonos Corporativos	45,209,409	0.9%
C.C MALL AVENTURA PLAZA	1,512,705	0.0%
Bonos Titulizados	1,512,705	0.0%
ABENGOA TRANSMISION NORTE	11,927,763	0.2%
Bonos Titulizados	11,927,763	0.2%
ETEN	19,059,159	0.4%
Bonos Corporativos	19,059,159	0.4%
ABENGOA TRANSMISION SUR	10,195,724	0.2%
Bonos Corporativos	10,195,724	0.2%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS* AL 30 DE SETIEMBRE DE 2018
(Expresado en USD)

Set-18	VALORIZACIÓN	%
CINEPLEX	1,435,219	0.0%
Bonos Corporativos	1,435,219	0.0%
C.C. MALL OPEN PLAZA	604,551	0.0%
Bonos Titulizados	604,551	0.0%
ENERGIA EÓLICA SA	20,976,247	0.4%
Bonos Corporativos	20,976,247	0.4%
INTERCORP PERU LTD	22,987,713	0.4%
Bonos Corporativos	22,987,713	0.4%
GyM FERROVIAS S.A.	43,196,112	0.8%
Bonos Corporativos	43,196,112	0.8%
YURA	25,728,974	0.5%
Bonos Corporativos	25,728,974	0.5%
RED DORSAL	54,892,229	1.0%
Bonos Titulizados	54,892,229	1.0%
REDESUR & TESUR	14,877,054	0.3%
Bonos Titulizados	14,877,054	0.3%
LIMA METRO LINEA 2	16,221,424	0.3%
Bonos Titulizados	16,221,424	0.3%
FALABELLA PERÚ	17,465,501	0.3%
Bonos Corporativos	17,465,501	0.3%
NORVIAL	23,152,243	0.4%
Bonos Corporativos	23,152,243	0.4%
INNOVA SCHOOLS	3,801,269	0.1%
Bonos Titulizados	3,801,269	0.1%
JOCKEY PLAZA SHOPPING CENTER	28,334,917	0.5%
Bonos Corporativos	28,334,917	0.5%
CONCESIONARIA LA CHIRA	11,470,727	0.2%
Bonos Titulizados	11,470,727	0.2%
CORPORACIÓN AZUCARERA DEL PERÚ S.A.	11,488,520	0.2%
Bonos Corporativos	11,488,520	0.2%
KALLPA	2,022,472	0.0%
Bonos Corporativos	2,022,472	0.0%
OBRAS DE INGIENERIA S.A.	3,471,085	0.1%
Bonos Corporativos	3,471,085	0.1%
CORPORACION LINDLEY S.A.	11,635,840	0.2%
Bonos Corporativos	11,635,840	0.2%
PRIMAX S.A.	21,952,256	0.4%
Bonos Corporativos	21,952,256	0.4%
INRETAIL	30,852,917	0.6%
Bonos Corporativos	30,852,917	0.6%
HERMES TRANSPORTES BLINDADOS	10,680,073	0.2%
Bonos Corporativos	10,680,073	0.2%
PALMAS DEL ESPÍNO S.A.	13,655,003	0.3%
Bonos Corporativos	13,655,003	0.3%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS* AL 30 DE SETIEMBRE DE 2018

(Expresado en USD)

Set-18	VALORIZACIÓN	%
ELECTROPERÚ S.A.	562,016,561	10.7%
Acciones	562,016,561	10.7%
ADMINISTRADORES DE CARTERA RENTA VARIABLE	42,434,402	0.8%
Mandato MILA	42,434,402	0.8%
FONDOS DE INVERSION	278,679,653	5.3%
COMPASS GROUP	26,533	0.0%
SIGMA	49,959,328	1.0%
AC CAPITALES	33,842,939	0.6%
FORTALEZA	11,081,650	0.2%
FIBRA II	32,813,767	0.6%
CARLYLE PERU FUND	39,988,543	0.8%
KANDEO FUND II	57,890,230	1.1%
FARO RETAIL	11,880,750	0.2%
FARO INV. INMOB.	17,973,601	0.3%
HMC CAPITAL HIGH YIELD FI	6,045,020	0.1%
MACROINFRAESTRUCTURA	11,205,424	0.2%
CREDICORP CAPITAL	5,971,867	0.1%
MERCADO EXTERNO	1,829,632,035	34.8%
DEPÓSITOS EN BANCOS DEL EXTERIOR	207,321,118	3.9%
INSTRUMENTOS DE CAPITAL	102,858,841	2.0%
FONDOS DE INVERSIÓN - MCDO. EXTERNO	169,099,123	3.2%
ADMINISTRADORES DE CARTERA	1,350,352,954	25.7%
TOTAL USD	5,252,921,368	100.0%

* A valor contable

** Instrumento con Garantía del Gobierno

PORTAFOLIO FCR - EXPOSICIÓN SECTORIAL¹ EN EL MERCADO LOCAL

SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%	SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%
GOBIERNO	825.1	28.8%	CONSTRUCCIÓN	192.1	6.7%
GOBIERNO CENTRAL	825.1	28.8%	Unión Andina de Cementos	4.6	
Bonos Soberanos	668.4		Línea Amarilla S.A.C.	45.2	
Bonos Globales	112.1		Eten	19.1	
Taboada Finance Ltda. ²	44.5		GyM Ferrovías S.A.	43.2	
SISTEMA FINANCIERO	1,063.748	37.2%	Yura	25.7	
BANCOS	994.1	34.7%	Norvial	23.2	
Continental	288.7		Lima Metro Línea 2	16.2	
Crédito	118.9		Concesionaria La Chira	11.5	
GNB Perú S.A.	27.7		Obras de Ingeniería S.A.	3.5	
Scotiabank	236.7		ENERGÍA	194.9	6.8%
Interbank	149.5		Edegel	3.9	
BIF	83.4		Edelnor	38.5	
MiBanco	48.1		Luz del Sur	58.9	
Banco Santander Perú	24.2		Enersur	21.7	
ICBC			REP	11.9	
Banco de la Nación	0.2		Abengoa Transmisión Norte	11.9	
Banco Financiero	16.6		Abengoa Transmisión Sur	10.2	
OTRAS INST. FINANCIERAS	69.6	2.4%	Energía Eólica SA	21.0	
COFIDE	21.2		Redesur & Tesur	14.9	
Financiera Confianza	5.1		Kallpa	2.0	
Financiera Efectiva	0.5		TELECOMUNICACIONES	54.9	1.9%
Compartamos Financiera	5.0		Red Dorsal	54.9	
Fondo Mivivienda	10.7		HIDROCARBUROS	22.0	0.8%
Crediscotia Financiera	27.2		PRIMAX SA	22.0	
FONDOS DE INVERSIÓN	278.7	9.7%	ALIMENTOS	56.1	2.0%
Compass Group	0.0		Gloria	26.9	
AC Capitales	33.8		Alicorp	6.1	
Fortaleza	11.1		Corporación Azucarera del Perú S.A.	11.5	
Fibra II	32.8		Corporación Lindley S.A.	11.6	
Kandeo Fund II	57.9		RETAIL	62.7	2.2%
Carlyle Perú Fund	40.0		Cineplex	1.4	
Sigma	50.0		C. C. Mall Open Plaza	0.6	
Faro Inv. Inmob.	18.0		Jockey Plaza Shopping Center	28.3	
Faro Retail	11.9		Inretail Shopping Center	30.9	
Credicorp Capital	6.0		C. C. Mall Aventura Plaza	1.5	
Macroinfraestructura	11.2		VARIOS	68.7	2.4%
HMC Capital High Yield FI	6.0		Transvase Olmos	0.1	
ADC RENTA VARIABLE (MILA PLUS PERÚ)	42.4	1.5%	Intercorp Perú LTD	23.0	
			Falabella Perú	17.5	
			Innova Schools	3.8	
			Hermes Transportes Blindados	10.7	
			Minera Volcan	-	
			Palmas del Espino	13.7	
			TOTAL	2,861.3	100.0%

¹ A valor contable. No incluye (i) Acciones de Electroperú, (ii) Activos Inmobiliarios

² Instrumento con Garantía del Gobierno.