

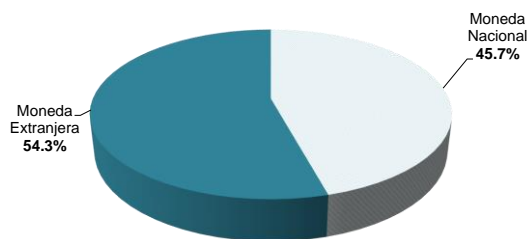
VALOR DEL PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR

DESCRIPCIÓN	A Valor de Mercado		Metodología FCR ¹	
	Equivalente en Millones		Equivalente en Millones	
	USD	S/	USD	S/
Activos Financ. Mcd. Local	3,091	10,924	2,828	9,994
Activos Financ. Mcd. Externo	1,991	7,035	1,991	7,035
Activos Inmobiliarios	154	546	154	546
Acciones Electroperú	1,758	6,213	662	2,340
TOTAL	6,994	24,718	5,635	19,915

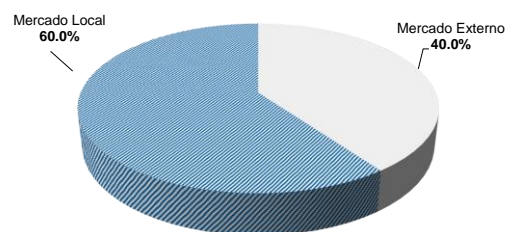
T.C. 3.534 (SBS 30.06.2020)

¹ La metodología FCR considera el 43.09% valor de mercado y el 56.91% a costo amortizado y valor contable

PORTAFOLIO FCR POR MONEDA (%) ²

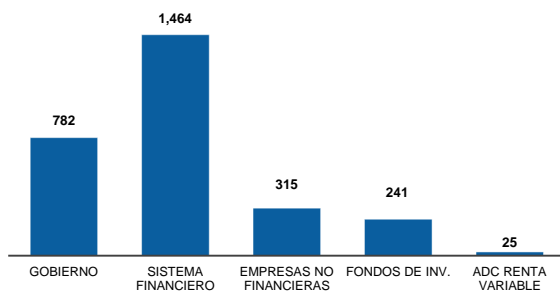


PORTAFOLIO FCR POR MERCADO (%) ²

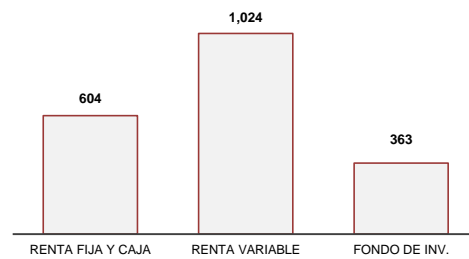


TIPO DE INVERSIONES POR MERCADO (Expresado en Millones USD)

MERCADO LOCAL



MERCADO EXTERNO



PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR	A VALOR DE MERCADO (Expresado en MM USD)	%	METODOLGÍA FCR ¹ (Expresado en MM USD)	%
I. CAJA E INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO	1,232.0	17.6%	1,232.0	21.9%
1. Local	946.0	13.5%	946.0	16.8%
Depósitos y Certificados BCRP	-		-	
Depósitos en el SF	939.8	13.4%	939.8	16.7%
Instrumentos de Corto Plazo	6.2	0.1%	6.2	0.1%
2. Extranjero	285.9	4.1%	285.9	5.1%
Depósitos en el BCRP	-		-	
Depósitos en el SF	285.9	4.1%	285.9	5.1%
Instrumentos de Corto Plazo	-		-	
II. RENTA FIJA	2,196.9	31.4%	1,933.7	34.3%
1. Local	1,878.4	26.9%	1,615.2	28.7%
Gobierno	910.0	13.0%	782.2	13.9%
Bonos SF y EnF	790.2	11.3%	718.9	12.8%
Instrumentos Titulizados	161.4	2.3%	97.3	1.7%
Instrumentos de Mediano y Largo Plazo	-		-	
Fondos de Renta Fija	16.8	0.2%	16.8	0.3%
2. Extranjero	318.5	4.6%	318.5	5.7%
Mandato Renta Fija Defensiva	-		-	
Mandato Core Plus	-		-	
Instrumentos de Deuda	-		-	
Fondos de Renta Fija	318.5	4.6%	318.5	5.7%
III. RENTA VARIABLE	1,048.8	15.0%	1,048.8	18.6%
1. Local	25.3	0.4%	25.3	0.4%
Mandato MILA Plus (Perú)	25.3	0.4%	25.3	0.4%
Fondos Mutuos	-		-	
2. Extranjero	1,023.6	14.6%	1,023.6	18.2%
Mandato ACWI	523.6	7.5%	523.6	9.3%
Mandato MILA Plus (ex Perú)	143.3	2.0%	143.3	2.5%
Instrumentos de Capital	356.7	5.1%	356.7	6.3%
IV. INVERSIONES ALTERNATIVAS	758.5	10.8%	758.5	13.5%
1. Local	395.9	5.7%	395.9	7.0%
Inversiones Inmobiliaria	154.5	2.2%	154.5	2.7%
Fondos de Inversión	241.5	3.5%	241.5	4.3%
2. Extranjero	362.6	5.2%	362.6	6.4%
Mandato de Private Equity	129.1	1.8%	129.1	2.3%
Inversión Directa en Private Equity	91.7	1.3%	91.7	1.6%
Fondo Real Assets	141.8	2.0%	141.8	2.5%
A. PORTAFOLIO FCR	5,236.2	74.9%	4,973.0	88.3%
B. ACCIONES ELECTROPERÚ	1,758.1	25.1%	662.1	11.7%
PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR (A+B)	6,994.3	100.0%	5,635.1	100.0%

¹ La metodología FCR considera el 43.09% valor de mercado y el 56.91% a costo amortizado y valor contable

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS AL 30 DE JUNIO DE 2020

(Expresado en USD)

Dic-19	VALORIZACIÓN	%
MERCADO LOCAL	3,490,085,712	63.7%
GOBIERNO	782,213,857	14.3%
Bonos Soberanos	634,355,202	11.6%
Bonos Globales	110,951,954	2.0%
Taboada Finance Ltda ¹	36,906,701	0.7%
ENTIDADES FINANCIERAS	1,177,843,771	21.5%
BANCO CONTINENTAL	206,363,423	3.8%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	1,634	0.0%
Depósitos a Plazo	88,453,822	1.6%
Bonos de Arrendamiento Financiero	11,214,471	0.2%
Bonos Subordinados	11,244,741	0.2%
Otras Captaciones del SF	95,448,755	1.7%
BANCO DE CRÉDITO	109,836,633	2.0%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	142,372	0.0%
Depósitos a Plazo	37,677,900	0.7%
Bonos Subordinados	1,067,755	0.0%
Otras Captaciones del SF	70,432,747	1.3%
Cuentas por cobrar	515,859	0.0%
BIF	49,354,874	0.9%
Depósitos a Plazo	44,320,118	0.8%
Certificado de Depósito	6,214,107	0.1%
Cuentas por pagar	-1,179,351	0.0%
INTERBANK	444,341,911	8.1%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	251,051,648	4.6%
Depósitos a Plazo	193,288,249	3.5%
Cuentas por cobrar	4,028	0.0%
Cuentas por pagar	-2,014	0.0%
BANCO PICHINCHA	9,240,379	0.2%
Depósitos a Plazo	9,240,379	0.2%
BANCO DE LA NACIÓN	598,892	0.0%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	598,892	0.0%
SCOTIABANK PERU S.A.A.	228,471,400	4.2%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	89,504,979	1.6%
Depósitos a Plazo	131,392,057	2.4%
Otras Captaciones del SF	7,574,364	0.1%
BANCO FALABELLA	6,419,103	0.1%
Depósitos a Plazo	6,419,103	0.1%
MIBANCO	32,716,768	0.6%
Depósitos a Plazo	32,716,768	0.6%
COFIDE	20,299,773	0.4%
Otras Captaciones del SF	20,299,773	0.4%
SANTANDER PERÚ	30,664,948	0.6%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	593	0.0%
Depósitos a Plazo	30,097,229	0.5%
Bonos de Arrendamiento Financiero	567,126	0.0%
BANCO GNB PERÚ S.A.	16,894,582	0.3%
Depósitos a Plazo	13,107,360	0.2%
Bonos Subordinados	3,787,223	0.1%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS AL 30 DE JUNIO DE 2020
(Expresado en USD)

Dic-19	VALORIZACIÓN	%
CREDISCOTIA	9,218,539	0.2%
Depósitos a Plazo	9,218,539	0.2%
COMPARTAMOS FINANCIERA	3,254,928	0.1%
Depósitos a Plazo	3,254,928	0.1%
FONDO MIVIVIENDA	10,167,618	0.2%
Otras Captaciones del SF	10,167,618	0.2%
ENTIDADES NO FINANCIERAS	1,504,771,273	27.5%
EDEGEL	1,771,584	0.0%
Bonos Corporativos	1,771,584	0.0%
EDELNOR	38,833,474	0.7%
Bonos Corporativos	38,833,474	0.7%
ENERSUR	19,984,612	0.4%
Bonos Corporativos	19,984,612	0.4%
LUZ DEL SUR	46,569,037	0.8%
Bonos Corporativos	46,569,037	0.8%
REP	11,098,696	0.2%
Bonos Corporativos	11,098,696	0.2%
GLORIA	13,892,653	0.3%
Bonos Corporativos	13,892,653	0.3%
ALICORP	28,718,009	0.5%
Bonos Corporativos	28,718,009	0.5%
TRAVASE OLMOS	18,005	0.0%
Bonos Corporativos	18,005	0.0%
LINEA AMARILLA S.A.C.	42,421,961	0.8%
Bonos Corporativos	42,421,961	0.8%
ABENGOA TRANSMISION NORTE	11,838,091	0.2%
Bonos Titulizados	11,838,091	0.2%
ETEN	18,171,767	0.3%
Bonos Corporativos	18,171,767	0.3%
ABENGOA TRANSMISION SUR	9,860,529	0.2%
Bonos Corporativos	9,860,529	0.2%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS AL 30 DE JUNIO DE 2020
(Expresado en USD)

Dic-19	VALORIZACIÓN	%
CINEPLEX	487,246	0.0%
Bonos Corporativos	487,246	0.0%
C.C. MALL OPEN PLAZA	488,518	0.0%
Bonos Titulizados	488,518	0.0%
ENERGIA EÓLICA SA	20,011,999	0.4%
Bonos Corporativos	20,011,999	0.4%
INTERCORP PERU LTD	21,858,807	0.4%
Bonos Corporativos	21,858,807	0.4%
GyM FERROVIAS S.A.	39,083,012	0.7%
Bonos Corporativos	39,083,012	0.7%
YURA	23,549,215	0.4%
Bonos Corporativos	23,549,215	0.4%
RED DORSAL	49,467,989	0.9%
Bonos Titulizados	49,467,989	0.9%
REDESUR & TESUR	13,169,356	0.2%
Bonos Titulizados	13,169,356	0.2%
LIMA METRO LINEA 2	8,731,253	0.2%
Bonos Titulizados	8,731,253	0.2%
FALABELLA PERÚ	13,983,538	0.3%
Bonos Corporativos	13,983,538	0.3%
NORVIAL	19,640,605	0.4%
Bonos Corporativos	19,640,605	0.4%
INNOVA SCHOOLS	3,526,099	0.1%
Bonos Titulizados	3,526,099	0.1%
JOCKEY PLAZA SHOPPING CENTER	27,780,681	0.5%
Bonos Corporativos	27,780,681	0.5%
CONCESIONARIA LA CHIRA	10,035,287	0.2%
Bonos Titulizados	10,035,287	0.2%
CORPORACIÓN AZUCARERA DEL PERÚ S.A.	10,935,700	0.2%
Bonos Corporativos	10,935,700	0.2%
KALLPA	2,000,454	0.0%
Bonos Corporativos	2,000,454	0.0%
CORPORACION LINDLEY S.A.	10,659,840	0.2%
Bonos Corporativos	10,659,840	0.2%
PRIMAX S.A.	14,383,489	0.3%
Bonos Corporativos	14,383,489	0.3%
INRETAIL	30,421,667	0.6%
Bonos Corporativos	30,421,667	0.6%
HERMES TRANSPORTES BLINDADOS	10,169,578	0.2%
Bonos Corporativos	10,169,578	0.2%
PALMAS DEL ESPÍNO S.A.	5,770,138	0.1%
Bonos Corporativos	5,770,138	0.1%

PORTAFOLIO FCR - ACTIVOS FINANCIEROS AL 30 DE JUNIO DE 2020

(Expresado en USD)

Dic-19	VALORIZACIÓN	%
CONS. TRANSMANTARO	5,048,958	0.1%
Bonos Corporativos	5,048,958	0.1%
ELECTROPERÚ S.A.	662,118,938	12.1%
Acciones	662,118,938	12.1%
ADMINISTRADORES DE CARTERA RENTA VARIABLE	25,256,811	0.5%
Mandato MILA	25,256,811	0.5%
FONDOS DE INVERSION	258,270,486	4.7%
SIGMA	62,311,147	1.1%
AC CAPITALES FONDO INMOBILIARIO II	25,587,960	0.5%
MACROCAPITALES SAFI - SA - FORTALEZA I	9,000,254	0.2%
FIBRA II	41,879,582	0.8%
CARLYLE PERU FUND	34,333,693	0.6%
KANDEO FUND II	41,850,954	0.8%
FARO CAPITAL F INV. EN RETAIL	2,656,000	0.0%
FARO INV. INMOB.	17,056,699	0.3%
MACROINFRAESTRUCTURA	16,790,747	0.3%
CREDICORP CAPITAL	6,803,450	0.1%
MERCADO EXTERNO	1,990,601,102	36.3%
DEPÓSITOS EN BANCOS DEL EXTERIOR	285,943,323	5.2%
FONDOS MUTUOS	720,124,336	13.1%
FONDOS DE INVERSIÓN - MCDO. EXTERNO	317,603,908	5.8%
ADMINISTRADORES DE CARTERA	666,929,535	12.2%
TOTAL ACTIVOS FINANCIEROS (Expresado en USD)	5,480,686,814	100%

PORTAFOLIO FCR - EXPOSICIÓN SECTORIAL EN EL MERCADO LOCAL ¹

SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%	SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%
GOBIERNO	782.2	27.7%	CONSTRUCCIÓN	161.6	5.7%
GOBIERNO CENTRAL	782.2	27.7%	Unión Andina de Cementos	-	
Bonos Soberanos	634.4		Línea Amarilla S.A.C.	42.4	
Bonos Globales	111.0		Eten	18.2	
Taboada Finance Ltda. ²	36.9		GyM Ferrovías S.A.	39.1	
SISTEMA FINANCIERO	1,177.844	41.6%	Yura	23.5	
BANCOS	1,134.9	40.1%	Norvial	19.6	
Continental	206.4		Lima Metro Línea 2	8.7	
Crédito	109.8		Concesionaria La Chira	10.0	
Banco Falabella	6.4				
GNB Perú S.A.	16.9		ENERGÍA	180.2	6.4%
Scotiabank	228.5		Edegel	1.8	
Interbank	444.3		Edelnor	38.8	
BIF	49.4		Luz del Sur	46.6	
MiBanco	32.7		Enersur	20.0	
Banco Santander Perú	30.7		REP	11.1	
Banco de la Nación	0.6		Abengoa Transmisión Norte	11.8	
Banco Pichincha	9.2		Abengoa Transmisión Sur	9.9	
OTRAS INST. FINANCIERAS	42.9	1.5%	Energía Eólica SA	20.0	
COFIDE	20.3		Redesur & Tesur	13.2	
Banco Ripley	-		Kallpa	2.0	
Financiera Confianza	-		Cons. Transmantaro	5.0	
Compartamos Financiera	3.3				
Fondo Mivivienda	10.2		TELECOMUNICACIONES	49.5	1.7%
Crediscotia Financiera	9.2		Red Dorsal	49.5	
FONDOS DE INVERSIÓN	258.3	9.1%	HIDROCARBUROS	14.4	0.5%
AC Capitales	25.6		PRIMAX SA	14.4	
Fortaleza	9.0				
Fibra II	41.9		ALIMENTOS	64.2	2.3%
Kandeo Fund II	41.9		Gloria	13.9	
Carlyle Perú Fund	34.3		Alicorp	28.7	
Sigma	62.3		Corporación Azucarera del Perú S.A.	10.9	
Faro Inv. Inmob.	17.1		Corporación Lindley S.A.	10.7	
Faro Retail	2.7		RETAIL	59.2	2.1%
Credicorp Capital	6.8		Cineplex	0.5	
Macroinfraestructura	16.8		C. C. Mall Open Plaza	0.5	
HMC Capital High Yield FI	-		Jockey Plaza Shopping Center	27.8	
			Inretail Shopping Center	30.4	
ADC RENTA VARIABLE (MILA PLUS PERÚ)	25.3	0.9%	VARIOS	55.3	2.0%
			Transvase Olmos	0.0	
			Intercorp Perú LTD	21.9	
			Falabella Perú	14.0	
			Innova Schools	3.5	
			Hermes Transportes Blindados	10.2	
			Palmas del Espino	5.8	
			TOTAL	2,828.0	100.0%

¹ La metodología FCR considera el 43.09% valor de mercado y el 56.91% a costo amortizado y valor contable

² Instrumento con Garantía del Gobierno.