

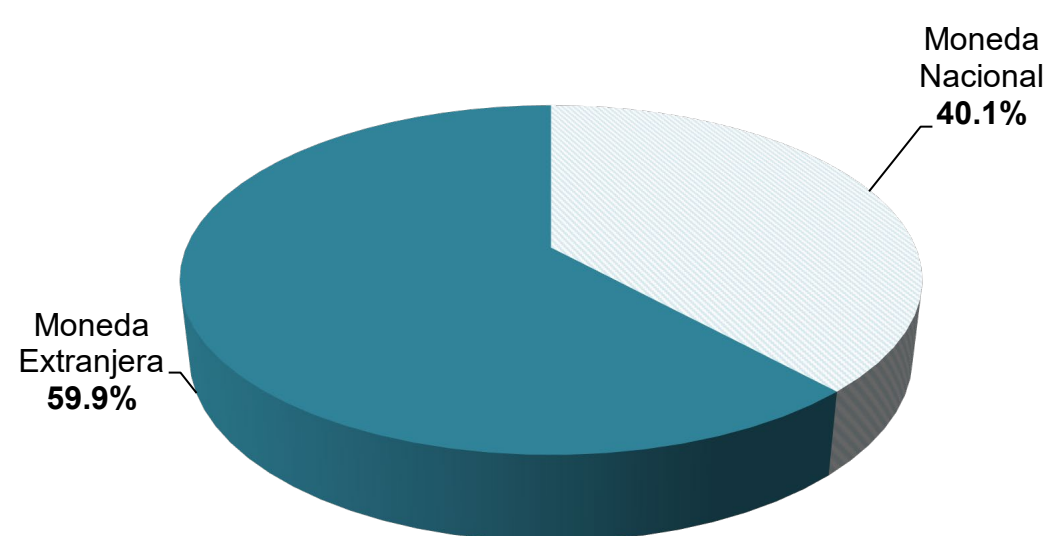
VALOR DEL PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR

DESCRIPCIÓN	A Valor de Mercado		Metodología FCR ¹	
	Equivalente en Millones		Equivalente en Millones	
	USD	S/	USD	S/
Activos Financ. Mcd. Local	2,837	10,197	2,573	9,249
Activos Financ. Mcd. Externo	2,267	8,150	2,267	8,150
Activos Inmobiliarios	152	546	152	546
Acciones Electroperú	1,758	6,320	683	2,457
TOTAL	7,013	25,213	5,675	20,402

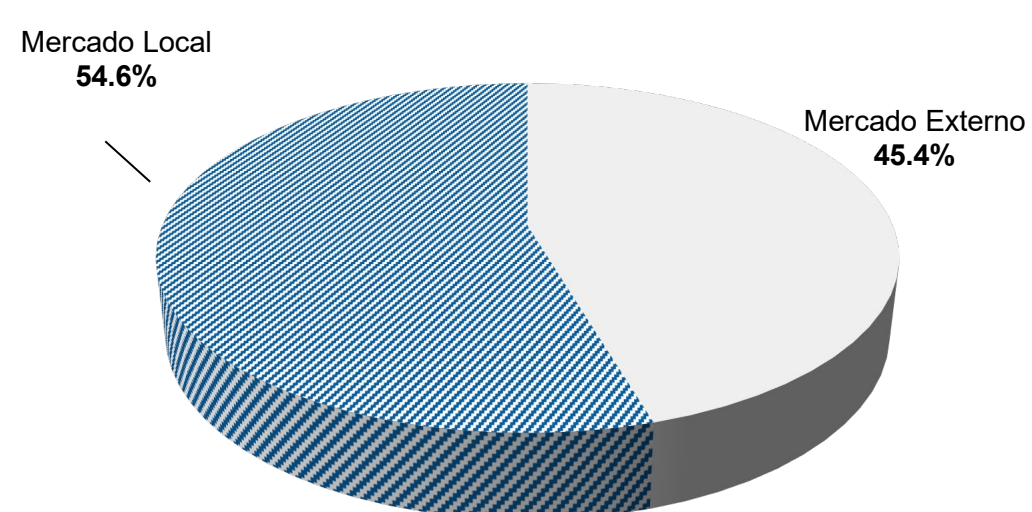
T.C. 3.595 (SBS 30.09.2020)

¹ La metodología FCR considera el 44.48% valor de mercado y el 55.52% a costo amortizado y valor contable

PORTAFOLIO FCR POR MONEDA (%) ²

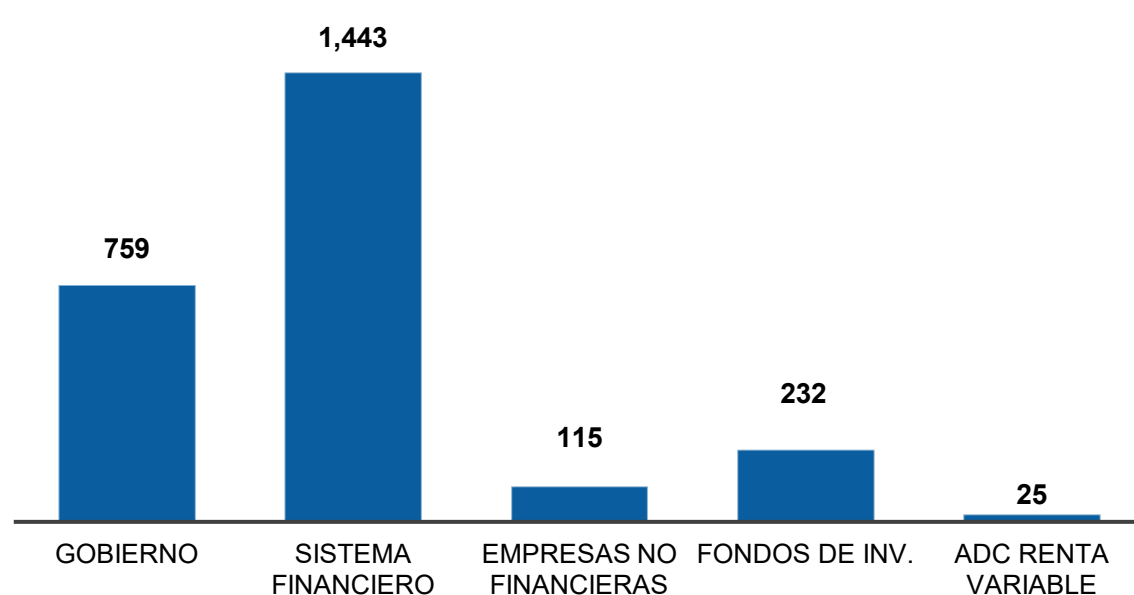


PORTAFOLIO FCR POR MERCADO (%) ²

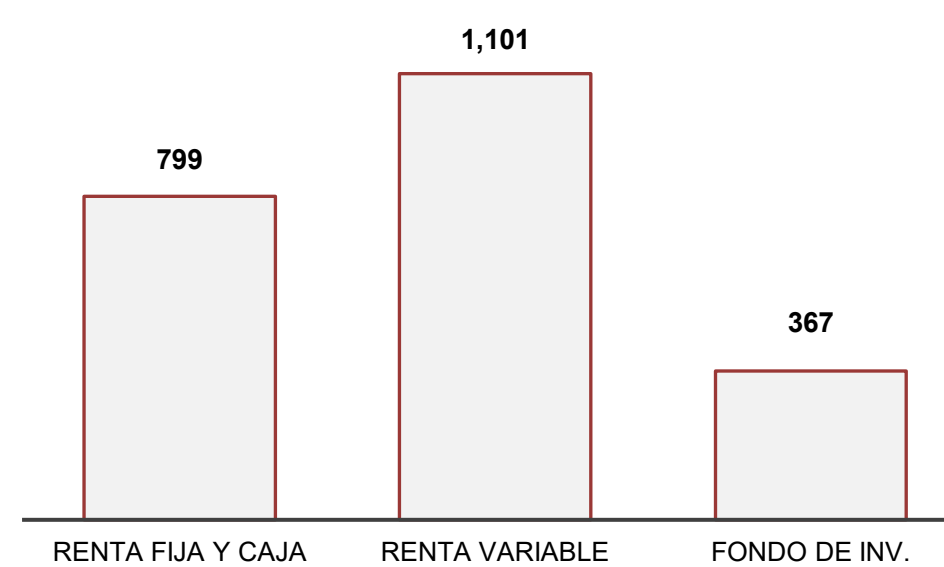


TIPO DE INVERSIONES POR MERCADO (Expresado en Millones USD)

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	1,213.5	17.3%	1,213.5	21.4%
1. Local	742.1	10.6%	742.1	13.1%
Depósitos en el SF	742.1	10.6%	742.1	13.1%
Instrumentos de Corto Plazo	-	0.0%	-	0.0%
2. Extranjero	471.3	6.7%	471.3	8.3%
Depósitos en el SF	471.3	6.7%	471.3	8.3%
Instrumentos de Corto Plazo	-	-	-	-
II. RENTA FIJA	2,165.6	30.9%	1,901.8	33.5%
1. Local	1,838.0	26.2%	1,574.2	27.7%
Gobierno	881.0	12.6%	759.3	13.4%
Bonos SF y EnF	781.2	11.1%	703.2	12.4%
Instrumentos Titulizados	159.6	2.3%	95.6	1.7%
Fondos de Renta Fija	16.1	0.2%	16.1	0.3%
2. Extranjero	327.7	4.7%	327.7	5.8%
Fondos de Renta Fija	327.7	4.7%	327.7	5.8%
III. RENTA VARIABLE	1,125.7	16.1%	1,125.7	19.8%
1. Local	24.7	0.4%	24.7	0.4%
Mandato MILA Plus (Perú)	24.7	0.4%	24.7	0.4%
Fondos Mutuos	-	-	-	-
2. Extranjero	1,101.0	15.7%	1,101.0	19.4%
Mandato ACWI	572.5	8.2%	572.5	10.1%
Mandato MILA Plus (ex Perú)	140.4	2.0%	140.4	2.5%
Instrumentos de Capital	388.1	5.5%	388.1	6.8%
IV. INVERSIONES ALTERNATIVAS	750.6	10.7%	750.6	13.2%
1. Local	383.6	5.5%	383.6	6.8%
Inversiones Inmobiliaria	151.8	2.2%	151.8	2.7%
Fondos de Inversión	231.8	3.3%	231.8	4.1%
2. Extranjero	367.0	5.2%	367.0	6.5%
Mandato de Private Equity	131.9	1.9%	131.9	2.3%
Inversión Directa en Private Equity	92.3	1.3%	92.3	1.6%
Fondo Real Assets	142.9	2.0%	142.9	2.5%
A. PORTAFOLIO FCR	5,255.4	74.9%	4,991.6	88.0%
B. ACCIONES ELECTROPERÚ	1,758.1	25.1%	683.4	12.0%
PORTAFOLIO CONSOLIDADO FCR (A+B)	7,013.5	100.0%	5,675.0	100.0%

¹ La metodología FCR considera el 44.48% valor de mercado y el 55.52% a costo amortizado y valor contable

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

Set-20	VALORIZACIÓN	%
MERCADO LOCAL	3,256,185,164	59.0%
GOBIERNO	759,256,157	13.7%
Bonos Soberanos	613,018,869	11.1%
Bonos Globales	110,664,293	2.0%
Taboada Finance Ltda ¹	35,572,996	0.6%
ENTIDADES FINANCIERAS	971,175,428	17.6%
BANCO CONTINENTAL	150,965,550	2.7%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	2,585	0.0%
Depósitos a Plazo	34,306,747	0.6%
Bonos de Arrendamiento Financiero	11,151,227	0.2%
Bonos Subordinados	11,426,432	0.2%
Otras Captaciones del SF	94,279,223	1.7%
Cuentas por pagar	-200,664	0.0%
BANCO DE CRÉDITO	259,989,528	4.7%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	27,706	0.0%
Depósitos a Plazo	191,120,242	3.5%
Bonos Subordinados	1,065,855	0.0%
Otras Captaciones del SF	69,871,903	1.3%
Cuentas por pagar	-2,096,179	0.0%
BIF	29,876,642	0.5%
Depósitos a Plazo	30,334,853	0.5%
Cuentas por pagar	-458,210	0.0%
INTERBANK	384,748,009	7.0%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	96,975,312	1.8%
Depósitos a Plazo	289,600,892	5.2%
Cuentas por cobrar	3,959	0.0%
Cuentas por pagar	-1,832,155	0.0%
BANCO PICHINCHA	6,262,014	0.1%
Depósitos a Plazo	6,262,014	0.1%
BANCO DE LA NACIÓN	928,926	0.0%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	928,926	0.0%
SCOTIABANK PERU S.A.A.	8,304,666	0.2%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	941,951	0.0%
Otras Captaciones del SF	7,362,715	0.1%
MIBANCO	29,217,179	0.5%
Depósitos a Plazo	29,217,179	0.5%
COFIDE	19,657,103	0.4%
Otras Captaciones del SF	19,657,103	0.4%
SANTANDER PERÚ	39,249,076	0.7%
Saldos en Cta Cte. y Ahorros	2,371,580	0.0%
Depósitos a Plazo	36,746,631	0.7%
Bonos de Arrendamiento Financiero	564,109	0.0%
Cuentas por pagar	-433,245	0.0%
BANCO GNB PERÚ S.A.	16,846,147	0.3%
Depósitos a Plazo	13,007,656	0.2%
Bonos Subordinados	3,838,491	0.1%

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

Set-20	VALORIZACIÓN	%
CREDISCOTIA	12,524,191	0.2%
Depósitos a Plazo	12,524,191	0.2%
FINANCIERA CONFIANZA	2,781,680	0.1%
Depósitos a Plazo	2,781,680	0.1%
FONDO MIVIVIENDA	9,824,718	0.2%
Otras Captaciones del SF	9,824,718	0.2%
ENTIDADES NO FINANCIERAS	1,501,036,310	27.2%
EDEGEL	1,769,110	0.0%
Bonos Corporativos	1,769,110	0.0%
EDELNOR	34,722,976	0.6%
Bonos Corporativos	34,722,976	0.6%
ENERSUR	20,020,896	0.4%
Bonos Corporativos	20,020,896	0.4%
LUZ DEL SUR	45,672,487	0.8%
Bonos Corporativos	45,672,487	0.8%
REP	10,955,049	0.2%
Bonos Corporativos	10,955,049	0.2%
GLORIA	11,868,332	0.2%
Bonos Corporativos	11,868,332	0.2%
ALICORP	28,496,716	0.5%
Bonos Corporativos	28,496,716	0.5%
LINEA AMARILLA S.A.C.	40,889,301	0.7%
Bonos Corporativos	40,889,301	0.7%
ABENGOA TRANSMISION NORTE	11,824,600	0.2%
Bonos Titulizados	11,824,600	0.2%
ETEN	17,828,513	0.3%
Bonos Corporativos	17,828,513	0.3%
ABENGOA TRANSMISION SUR	10,028,078	0.2%
Bonos Corporativos	10,028,078	0.2%

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

Set-20	VALORIZACIÓN	%
CINEPLEX	426,694	0.0%
Bonos Corporativos	426,694	0.0%
C.C. MALL OPEN PLAZA	468,833	0.0%
Bonos Titulizados	468,833	0.0%
ENERGIA EÓLICA SA	19,818,054	0.4%
Bonos Corporativos	19,818,054	0.4%
INTERCORP PERU LTD	21,088,589	0.4%
Bonos Corporativos	21,088,589	0.4%
GyM FERROVIAS S.A.	38,258,373	0.7%
Bonos Corporativos	38,258,373	0.7%
YURA	23,603,382	0.4%
Bonos Corporativos	23,603,382	0.4%
RED DORSAL	48,639,486	0.9%
Bonos Titulizados	48,639,486	0.9%
REDESUR & TESUR	12,913,455	0.2%
Bonos Titulizados	12,913,455	0.2%
LIMA METRO LINEA 2	8,632,329	0.2%
Bonos Titulizados	8,632,329	0.2%
FALABELLA PERÚ	13,177,183	0.2%
Bonos Corporativos	13,177,183	0.2%
NORVIAL	18,931,823	0.3%
Bonos Corporativos	18,931,823	0.3%
INNOVA SCHOOLS	3,329,792	0.1%
Bonos Titulizados	3,329,792	0.1%
JOCKEY PLAZA SHOPPING CENTER	27,649,261	0.5%
Bonos Corporativos	27,649,261	0.5%
CONCESIONARIA LA CHIRA	9,766,354	0.2%
Bonos Titulizados	9,766,354	0.2%
CORPORACIÓN AZUCARERA DEL PERÚ S.A.	10,539,399	0.2%
Bonos Corporativos	10,539,399	0.2%
KALLPA	2,025,183	0.0%
Bonos Corporativos	2,025,183	0.0%
CORPORACION LINDLEY S.A.	10,674,548	0.2%
Bonos Corporativos	10,674,548	0.2%
PRIMAX S.A.	14,387,170	0.3%
Bonos Corporativos	14,387,170	0.3%
INRETAIL	30,852,917	0.6%
Bonos Corporativos	30,852,917	0.6%
HERMES TRANSPORTES BLINDADOS	9,797,742	0.2%
Bonos Corporativos	9,797,742	0.2%
PALMAS DEL ESPÍNO S.A.	5,567,918	0.1%
Bonos Corporativos	5,567,918	0.1%

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

Set-20	VALORIZACIÓN	%
CONS. TRANSMANTARO	5,107,708	0.1%
Bonos Corporativos	5,107,708	0.1%
ELECTROPERÚ S.A.	683,419,483	12.4%
Acciones	683,419,483	12.4%
ADMINISTRADORES DE CARTERA RENTA VARIABLE	24,717,269	0.4%
Mandato MILA	24,717,269	0.4%
FONDOS DE INVERSION	247,884,576	4.5%
SIGMA	62,934,690	1.1%
AC CAPITALES FONDO INMOBILIARIO II	25,763,117	0.5%
MACROCAPITALES SAFI - SA - FORTALEZA I	7,051,858	0.1%
FIBRA II	36,159,014	0.7%
CARLYLE PERU FUND	32,314,694	0.6%
KANDEO FUND II	40,879,461	0.7%
FARO CAPITAL F INV. EN RETAIL	2,055,500	0.0%
FARO INV. INMOB.	16,454,894	0.3%
MACROINFRAESTRUCTURA	16,130,934	0.3%
CREDICORP CAPITAL	8,140,414	0.1%
MERCADO EXTERNO	2,266,974,852	41.0%
SALDOS EN CUSTODIO	-17,800	
DEPÓSITOS EN BANCOS DEL EXTERIOR	471,351,227	8.5%
FONDOS MUTUOS	758,522,187	13.7%
FONDOS DE INVERSIÓN - MCDO. EXTERNO	324,308,007	5.9%
ADMINISTRADORES DE CARTERA	712,811,232	12.9%
TOTAL ACTIVOS FINANCIEROS (Expresado en USD)	5,523,160,017	100%

PORTAFOLIO FCR - EXPOSICIÓN SECTORIAL EN EL MERCADO LOCAL ¹

SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%	SECTOR	VALORIZACIÓN (Millones USD)	%
GOBIERNO	759.3	29.5%	CONSTRUCCIÓN	157.9	6.1%
GOBIERNO CENTRAL	759.3	29.5%	Unión Andina de Cementos	-	
Bonos Soberanos	613.0		Línea Amarilla S.A.C.	40.9	
Bonos Globales	110.7		Eten	17.8	
Taboada Finance Ltda. ²	35.6		GyM Ferrovías S.A.	38.3	
SISTEMA FINANCIERO	971.175	37.7%	Yura	23.6	
BANCOS	926.4	36.0%	Norvial	18.9	
Continental	151.0		Lima Metro Línea 2	8.6	
Crédito	260.0		Concesionaria La Chira	9.8	
GNB Perú S.A.	16.8				
Scotiabank	8.3		ENERGÍA	174.9	6.8%
Interbank	384.7		Edegel	1.8	
BIF	29.9		Edelnor	34.7	
MiBanco	29.2		Luz del Sur	45.7	
Banco Santander Perú	39.2		Enersur	20.0	
Banco de la Nación	0.9		REP	11.0	
Banco Pichincha	6.3		Abengoa Transmisión Norte	11.8	
OTRAS INST. FINANCIERAS	44.8	1.7%	Abengoa Transmisión Sur	10.0	
COFIDE	19.7		Energía Eólica SA	19.8	
Banco Ripley	-		Redesur & Tesur	12.9	
Financiera Confianza	2.8		Kallpa	2.0	
Compartamos Financiera	-		Cons. Transmantaro	5.1	
Fondo Mivivienda	9.8		TELECOMUNICACIONES	48.6	1.9%
Crediscotia Financiera	12.5		Red Dorsal	48.6	
FONDOS DE INVERSIÓN	247.9	9.6%	HIDROCARBUROS	14.4	0.6%
AC Capitales	25.8		PRIMAX SA	14.4	
Fortaleza	7.1		ALIMENTOS	61.6	2.4%
Fibra II	36.2		Gloria	11.9	
Kandeo Fund II	40.9		Alicorp	28.5	
Carlyle Perú Fund	32.3		Corporación Azucarera del Perú S.A.	10.5	
Sigma	62.9		Corporación Lindley S.A.	10.7	
Faro Inv. Inmob.	16.5		RETAIL	59.4	2.3%
Faro Retail	2.1		Cineplex	0.4	
Credicorp Capital	8.1		C. C. Mall Open Plaza	0.5	
Macroinfraestructura	16.1		Jockey Plaza Shopping Center	27.6	
HMC Capital High Yield FI	-		Inretail Shopping Center	30.9	
ADC RENTA VARIABLE (MILA PLUS PERÚ)	24.7	1.0%	VARIOS	53.0	2.1%
			Transvase Olmos	-	
			Intercorp Perú LTD	21.1	
			Falabella Perú	13.2	
			Innova Schools	3.3	
			Hermes Transportes Blindados	9.8	
			Palmas del Espino	5.6	
			TOTAL	2,572.8	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.