

Categoría de Riesgo de Inversiones de Corto y Largo Plazo

(En miles de Nuevos Soles) Al 31-05-2020



	PRO0		PRO1		PRO2		PRO3	
	Monto	%	Monto	%	Monto	%	Monto	%
I. INVERSIONES LOCALES	942 133	100.11%	3 168 813	60.08%	970 000	3.32%	1 835 103	42.57%
Instrumentos de Corto Plazo	940 142	99.90%	46 100	0.87%	970 000	3.32%	21 500	0.50%
CP-1	940 142	99.90%	46 100	0.87%	970 000	3.32%	21 500	0.50%
Instrumentos de Largo Plazo	-	0.00%	1 671 035	31.68%	3 741 938	12.81%	53 180	1.23%
AAA	-	0.00%	478 432	9.07%	1 092 369	3.74%	13 372	0.31%
AA	-	0.00%	394 577	7.48%	746 800	2.56%	21 332	0.49%
A	-	0.00%	15 592	0.30%	43 368	0.15%	-	0.00%
A-	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
AF	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
AAF	-	0.00%	56 289	1.07%	208 420	0.71%	12 970	0.30%
BBB+	-	0.00%	101 369	1.92%	304 938	1.04%	-	0.00%
BBB	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
A(e)	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
BBB(e)	-	0.00%	324 572	6.15%	635 135	2.17%	5 506	0.13%
B(e)	-	0.00%	9 718	0.18%	20 575	0.07%	-	0.00%
CCC(e)	-	0.00%	24 625	0.47%	172 374	0.59%	-	0.00%
BB(e)	-	0.00%	265 862	5.04%	517 959	1.77%	-	0.00%
Instrumentos de LP del Exterior (1)	-	0.00%	10 161	0.19%	215 722	0.74%	13 665	0.32%
A(e)	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
BBB(e)	-	0.00%	10 161	0.19%	205 173	0.70%	13 665	0.32%
BBB+	-	0.00%	-	0.00%	10 550	0.04%	-	0.00%
Cuotas de Participación de Fondos de Inversión	-	0.00%	22	0.00%	646 348	2.21%	264 197	6.13%
A	-	0.00%	9	0.00%	402 763	1.38%	178 653	4.14%
BBB	-	0.00%	-	0.00%	102 470	0.35%	34 186	0.79%
E / V	-	0.00%	13	0.00%	19 991	0.07%	2 394	0.06%
4 (5)	-	0.00%	-	0.00%	121 125	0.41%	48 965	1.14%
Instrumentos sin Categoría de Riesgo Equivalente	-	0.00%	1 438 038	27.27%	9 731 160	33.32%	1 390 673	32.26%
Títulos de Deuda del Gobierno (2)	-	0.00%	1 249 840	23.70%	7 156 476	24.50%	2 342	0.05%
Certificados Banco Central de Reserva (3)	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
Fondos Mutuos	-	0.00%	50 006	0.95%	242 251	0.83%	24 962	0.58%
Acciones y Valores representativos sobre Acciones	-	0.00%	138 192	2.62%	2 332 434	7.99%	1 363 369	31.63%
Cuenta Corriente	1 991	0.21%	3 457	0.07%	69 295	0.24%	91 889	2.13%
II. INVERSIONES EN EL EXTERIOR	-	0.00%	2 221 013	42.11%	1 058 090	3.62%	840	0.02%
Instrumentos de Inversión de Largo Plazo con Equivalencia de Clasificación	-	0.00%	554 921	10.52%	1 058 090	3.62%	840	0.02%
AA-	-	0.00%	-	0.00%	6 523	0.02%	-	0.00%
A+	-	0.00%	1 528	0.03%	266	0.00%	-	0.00%
BBB+	-	0.00%	167 651	3.18%	632 257	2.16%	747	0.02%
BBB	-	0.00%	215 252	4.08%	262 624	0.90%	-	0.00%
BB	-	0.00%	170 491	3.23%	156 421	0.54%	93	0.00%
Instrumentos sin Categoría de Riesgo Equivalente	-	0.00%	1 478 895	28.04%	12 144 782	41.58%	2 397 288	55.62%
Fondos Mutuos (4)	-	0.00%	1 478 895	28.04%	12 144 782	41.58%	2 397 288	55.62%
Acciones y Valores representativos sobre Acciones	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
Cuenta Corriente	-	0.00%	187 197	3.55%	582 130	1.99%	5 809	0.13%
III. OPERACIONES EN TRÁNSITO	(1 076)	-0.11%	(115 796)	-2.20%	49 151	0.17%	71 305	1.65%
TOTAL	941 057	100.00%	5 274 030	100.00%	1 058 090	100.00%	4 310 345	100.00%