

ACTIVOS OTORGADOS EN GARANTÍA DE FINANCIAMIENTOS RECIBIDOS

Al 31 de Marzo de 2020

| Concepto | Monto de los Activos (miles de soles) | Contraparte del financiamiento | Plazo del contrato | Deuda que respalda (miles de soles) | Legislación | Jurisdicción | Otros |
|--|--|--------------------------------|--------------------|--|-------------|--------------|-------|
| 1. Financiamientos recibidos con garantía de cartera de créditos | | | | | | | |
| COFIDE S.A. | 455,404 | COFIDE S.A. | INDEFINIDO | 455,404 | PERUANA | PERU | |
| Total | 455,404 | | | 455,404 | | | |

REPORTE N° 2-D
REQUERIMIENTOS DE PATRIMONIO EFECTIVO POR RIESGOS DE CRÉDITO, MERCADO Y OPERACIONAL Y CÁLCULO DEL
(Vigente a partir del 01 de julio de 2010)
(Artículos 186° al 194°, artículo 199° y Vigésima Cuarta Disposición Transitoria de la Ley General N° 26702)
(En miles de soles)
Al 31 de Marzo de 2020

| | | |
|--|-------------------|-------------------|
| (I) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito | APR | Total |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Crédito | 72,533,663 | 7,253,366 |
| (II) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado | APR | Total |
| Método Estándar | 1,484,072 | 148,407 |
| Riesgo de Tasa de Interés | 1,098,134 | 109,813 |
| Riesgo de Precio | - | - |
| Riesgo Cambiario | 385,938 | 38,594 |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo de Mercado | 1,484,072 | 148,407 |
| (III) Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional | APR | Total |
| Método Estándar Alternativo | 5,079,537 | 507,954 |
| Total Requerimiento de Patrimonio Efectivo por Riesgo Operacional | 5,079,537 | 507,954 |
| (IV) Requerimiento de Patrimonio Efectivo Total | 79,097,272 | 7,909,727 |
| (V) Patrimonio Efectivo | | 11,082,464 |
| Total Patrimonio Efectivo de Nivel 1 | | 8,565,257 |
| Asignado a cubrir riesgo de crédito | | 7,908,896 |
| Asignado a cubrir riesgo de mercado | | 148,407 |
| Asignado a cubrir riesgo operacional | | 507,954 |
| Total Patrimonio Efectivo de Nivel 2 | | 2,517,207 |
| Asignado a cubrir riesgo de crédito | | 2,517,207 |
| (VI) Ratio de Capital Global (%): | | 14.01% |