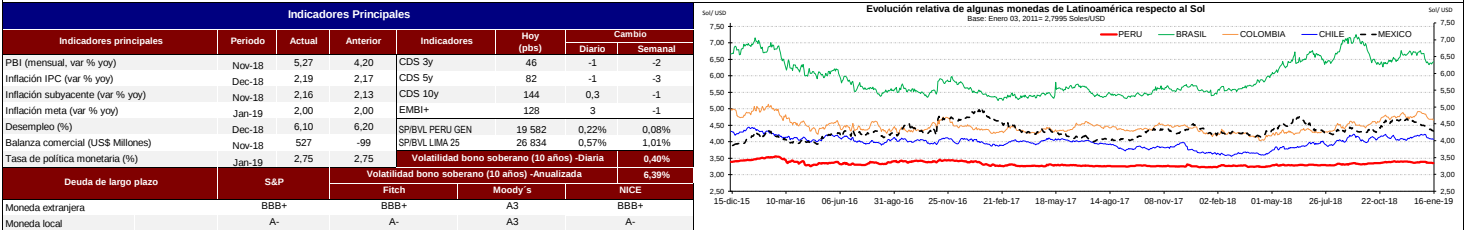


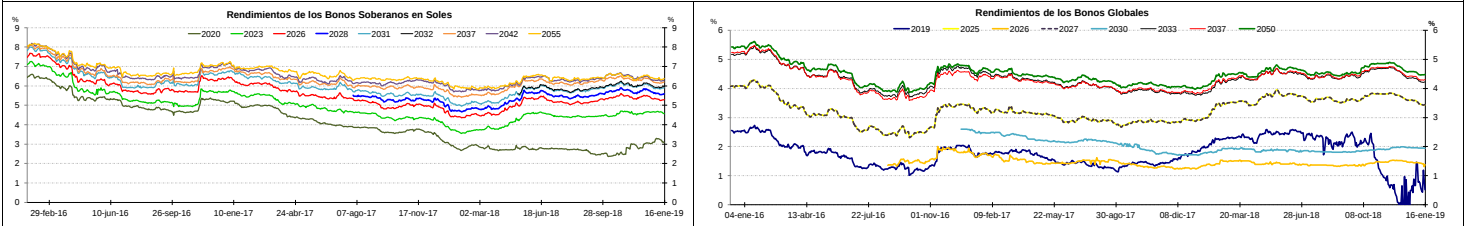
PERU: REPORTE DIARIO

16 de enero de 2019 5:47 PM



Bonos soberanos																										
Letras y bonos				Saldo vigente	Cupón %	Postura		Precio		Postura		Rendimiento		N° de Operaciones del día	Última Negociación*		Duración	Duración	Vida media	Rendimiento medio histórico						
Descripción	ISIN	Nóminas	Intereses corrientes SI	Millones soles		Compra	Venta	Última negociación del día	Promedio ponderado	Compra	Venta	Última negociación del día	Promedio ponderado		Día	Monto (Millones Soles)					Años	Modificada	Años			
23-ene-19	PEP010007657	LTP23ENE19	-	427	-	-	-	-	99,96	-	-	-	2,26	-	07-nov-18	28	0,02	0,02	0,02	2,90						
20-feb-19	PEP010007665	LTP20FEB19	-	364	-	-	-	-	99,78	-	-	-	2,26	-	05-dic-18	49	0,10	0,10	0,10	2,90						
20-mar-19	PEP010007673	LTP20MAR19	-	321	-	-	-	-	99,61	-	-	-	2,27	-	19-dic-18	21	0,18	0,17	0,18	2,91						
17-abr-19	PEP010007681	LTP17ABR19	-	246	-	-	-	-	99,43	-	-	-	2,27	1	16-ene-19	4	0,25	0,25	0,25	2,91						
22-may-19	PEP010007699	LTP22MAY19	-	299	-	-	-	-	99,22	-	-	-	2,27	-	28-nov-18	27	0,35	0,34	0,35	2,93						
19-jun-19	PEP010007707	LTP19JUN19	-	175	-	-	-	-	99,04	-	-	-	2,27	-	12-dic-18	31	0,43	0,42	0,43	2,94						
17-jul-19	PEP010007715	LTP17JUL19	-	184	-	-	-	-	98,87	-	-	-	2,27	-	09-ene-19	4	0,51	0,49	0,51	2,96						
21-ago-19	PEP010007723	LTP21AGO19	-	149	-	-	-	-	98,65	-	-	-	2,28	-	05-dic-18	22	0,60	0,59	0,60	2,98						
18-sep-19	PEP010007731	LTP18SEP19	-	73	-	-	-	-	98,48	-	-	-	2,28	-	19-dic-18	21	0,68	0,67	0,68	3,00						
16-oct-19	PEP010007749	LTP16OCT19	-	50	-	-	-	-	98,30	-	-	-	2,28	-	19-nov-18	1	0,76	0,74	0,76	3,02						
20-nov-19	PEP010007756	LTP20NOV19	-	25	-	-	-	-	98,09	-	-	-	2,28	-	28-nov-18	35	0,86	0,84	0,86	3,04						
04-dic-19	PEP010007764	LTP04DIC19	-	15	-	-	-	-	98,00	-	-	-	2,28	-	12-dic-18	15	0,89	0,87	0,89	3,05						
12-ago-20	PEP01000CY33	SB12AGO20	33,45	1.574	7,840	107,16	107,29	107,18	107,18	3,08	3,00	3,07	3,07	5	16-ene-19	26,0	1,49	1,44	1,57	4,11						
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	18,10	5.739	5,200	102,53	102,57	102,52	102,52	4,57	4,56	4,6	4,57	11	16-ene-19	36,0	4,19	4,01	4,66	5,09						
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	24,32	11.217	5,700	103,84	103,89	103,89	104,01	4,89	4,88	4,88	4,86	63	16-ene-19	161,9	4,83	4,60	5,57	5,29						
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	34,98	12.515	8,200	117,79	117,82	117,89	117,87	5,31	5,30	5,29	5,29	22	16-ene-19	41,2	5,86	5,57	7,57	5,67						
12-ago-28	PEP01000CSD1	SB12AGO28	27,09	14.246	6,350	105,42	105,46	105,53	105,52	5,61	5,60	5,59	5,59	16	16-ene-19	54,3	7,31	6,92	9,57	5,96						
12-feb-29	PEP01000CSF6	SB12FEB29E	3,55	10.350	5,940	102,08	102,54	102,54	102,45	5,72	5,66	5,60	5,61	16	16-ene-19	38,0	7,67	7,26	10,07	6,01						
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	29,65	14.123	6,950	108,94	109,04	109,22	109,16	5,93	5,92	5,90	5,91	9	16-ene-19	32,0	8,66	8,18	12,57	6,19						
12-ago-32	PEP01000CSE9	SB12AGO32	26,24	12.283	6,150	101,47	101,56	101,66	101,63	5,99	5,98	5,97	5,97	19	16-ene-19	50,3	9,33	8,80	13,57	6,27						
12-ago-37	PEP01000CZ21	SB12AGO37	29,44	11.175	6,900	107,58	107,69	107,58	107,65	6,21	6,20	6,21	6,20	3	16-ene-19	6,0	10,90	10,26	18,57	6,46						
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	29,22	4.443	6,850	-	-	-	106,75	-	-	-	6,30	-	15-ene-19	8,5	12,12	11,41	23,07	6,54						
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	28,64	2.272	6.714	-	-	-	104,84	-	-	-	6,38	-	28-dic-18	0,2	14,27	13,41	36,07	6,64						
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	26,18	1.314	6,84% + VAC	-	-	-	125,90	-	-	-	2,01	-	05-mar-18	5,0	4,96	4,86	5,74	3,09						
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	13,65	86	2,89%+VAC	-	-	-	104,59	-	-	-	2,39	-	05-mar-18	5,0	9,63	9,40	11,07	3,46						
31-ene-35	PEP01000CV85	SB13ENE35	49,63	1.350	7,39% + VAC	-	-	-	157,62	-	-	-	2,86	-	14-ene-19	51,0	10,95	10,65	16,04	3,57						
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	14,86	256	3,14%+VAC	-	-	-	106,67	-	-	-	2,70	-	14-ene-19	80,0	15,81	15,39	21,07	3,67						
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	23,22	611	3,83% + VAC	-	-	-	121,73	-	-	-	2,69	-	24-may-18	15,0	18,33	17,85	27,57	3,77						
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	15,48	431	3,20%+VAC	-	-	-	113,18	-	-	-	2,66	-	03-feb-17	1,0	22,07	21,50	35,07	3,87						

Bonos		ISIN	Saldo vigente	Cupón %	Precio	Cambio		Precio diferencial compra / venta	Rendimiento %	Cambio (bps)		Diferencial sobre Tesoro	Cambio (Pbs.)		Análisis de sensibilidad		Vida media años
			Millones de dólares			Diario	Semanal			Diario	Semanal	(Pb)	Diario	Semanal	Duración años	Duración modificada	Convexidad
Perú Global 19	US715638AW21		396	7,125	101,32	0,06	-0,12	0,14	0,52	-37	-5	-203	-38	-4	0,21	0,21	0,00
Perú Global 25	US715638AS19		1.793	7,350	122,62	-0,02	-0,04	0,37	3,44	0	0	72	16	12	5,28	5,19	0,33
Perú Global 26	XS1315181708		€1 100	2,750	109,13	-0,51	0,33	0,71	1,38	7	-5	156	5	0	6,37	6,28	0,48
Perú Global 27	US715638BU55		1.250	4,125	104,59	-0,06	-0,04	0,38	3,50	1	0	62	1	-2	6,53	6,42	0,60
Perú Global 30	XS1373156618		€1 000	3,750	117,99	0,10	0,11	0,81	1,94	-1	-1	174	-3	3	9,19	9,10	1,01
Perú Global 33	US715638AP79		2.188	8,750	149,49	-0,13	-0,09	0,66	4,23	1	0	135	1	-3	9,68	9,48	1,20
Perú Global 37	US715638AU64		1.165	6,550	128,06	-0,09	-0,28	0,57	4,31	1	2	143	1	-2	11,57	11,33	1,60
Perú Global 50	US715638BM30		2.545	5,625	119,35	-0,12	-0,30	0,49	4,48	1	1	141	1	-5	16,37	16,01	3,81



Índice		Valor	Cambio		Rend anual %	Cambio (bps.)		Composición del índice									
			Diario	Semanal		Diario	Semanal	12-ago-20	12-sep-23	12-ago-24	12-ago-26	12-ago-28	12-feb-26	12-ago-31	12-ago-32	12-ago-37	12-feb-42
Índice de bonos soberanos nominal		305	-0,33	-0,46	0,81	-0,7	-0,4	1,62	5,58	10,93	14,17	14,40	0,00	9,95	14,86	11,12	10,51

Índice		Valor	Cambio		Rend anual %	Cambio (bps.)		Composición del índice
--------	--	-------	--------	--	--------------	---------------	--	------------------------

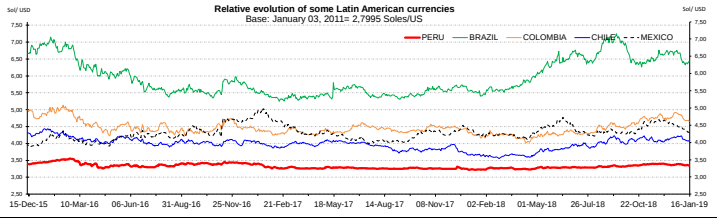


PERU : DAILY REPORT

16 de enero de 2019 5:47 PM

Key Indicators

Indicators	Period	Latest	Previous	Indicators	Today (bps)	Change
GDP (monthly, yoy % ch.)	Nov-18	5,27	4,20	CDS 3y	46	-1 -2
CPI Inflation (yoy % ch.)	Dec-18	2,19	2,17	CDS 5y	82	-1 -3
Core Inflation (yoy % ch.)	Nov-18	2,16	2,13	CDS 10y	144	0,3 -1
Target Inflation (yoy % ch.)	Jan-19	2,00	2,00	EMBI+	128	3 -1
Unemployment (%)	Dec-18	6,10	6,20	SPBVL PERU GEN	19 582	0,22% 0,08%
Trade Balance (US\$ Millions)	Nov-18	527	-99	SPBVL LIMA 25	26 834	0,57% 1,01%
Monetary Policy rate (%)	Jan-19	2,75	2,75	Volatility of sovereign bond (10 years) - Daily		0,40%
				Volatility of sovereign bond (10 years) - Annualized		6,39%
Long term debt	S&P			Fitch		
Foreign currency	BBB+			Moody's		
Local currency	A-			NICE		

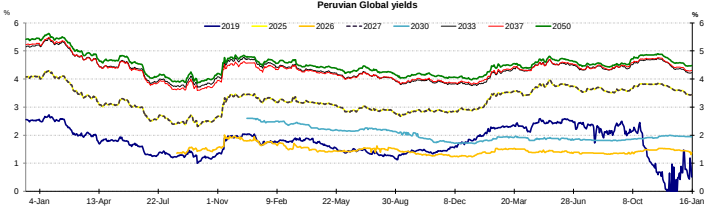
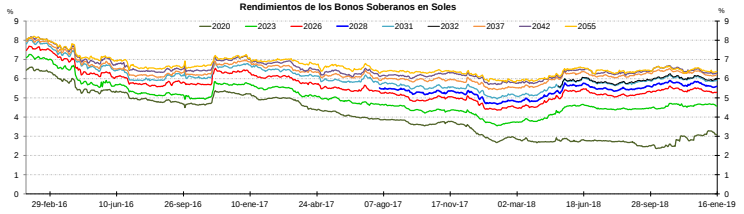


Sovereign Bonds

T-bills and bonds				Outstanding		Coupon %	Price		Yield	Position		No. Day Operations	Last Trade*		Duration	Modified	Average Life	Historical average yield
Description	ISIN	Mnemonic	Accrued Interest	Millions PEN			Position	Last trading day	weighted average	Bid	Ask		Date	Amount (Millions PEN)		Years	Years	Years
23-ene-19	PEP010007657	LTP23ENE19		427	-	-			99,96	-	-	-	07-nov-18	28	0,02	0,02	0,02	2,90
20-feb-19	PEP010007665	LTP20FEB19		364	-	-			99,78	-	-	-	05-dic-18	49	0,10	0,10	0,10	2,90
20-mar-19	PEP010007673	LTP20MAR19		321	-	-			99,61	-	-	-	19-dic-18	21	0,18	0,17	0,18	2,91
17-abr-19	PEP010007681	LTP17ABR19		246	-	-			99,43	-	-	1	16-ene-19	4	0,25	0,25	0,25	2,91
22-may-19	PEP010007689	LTP22MAY19		299	-	-			99,22	-	-	-	28-nov-18	27	0,35	0,34	0,35	2,93
19-jun-19	PEP010007707	LTP19JUN19		175	-	-			99,04	-	-	-	12-dic-18	31	0,43	0,42	0,43	2,94
17-jul-19	PEP010007715	LTP17JUL19		184	-	-			98,87	-	-	-	09-ene-19	4	0,51	0,49	0,51	2,96
21-ago-19	PEP010007723	LTP21AGO19		149	-	-			98,65	-	-	-	05-dic-18	22	0,60	0,59	0,60	2,98
18-sep-19	PEP010007731	LTP18SEP19		73	-	-			98,48	-	-	-	19-dic-18	21	0,68	0,67	0,68	3,00
16-oct-19	PEP010007749	LTP16OCT19		50	-	-			98,30	-	-	-	19-nov-18	1	0,76	0,74	0,76	3,02
20-nov-19	PEP010007756	LTP20NOV19		25	-	-			98,09	-	-	-	28-nov-18	35	0,86	0,84	0,86	3,04
04-dic-19	PEP010007764	LTP04DIC19		15	-	-			98,00	-	-	-	12-dic-18	15	0,89	0,87	0,89	3,05
12-ago-20	PEP01000C933	SB12AGOC20	33,45	1 574	7,840		107,16	107,29	107,18	3,08	3,00	3,07	16-ene-19	26,0	1,49	1,44	1,57	4,11
12-sep-23	PEP01000C493	SB12SEP23	18,10	5 739	5,200		102,53	102,57	102,52	4,57	4,56	4,6	16-ene-19	36,0	4,19	4,01	4,66	5,09
12-ago-24	PEP01000C494	SB12AGOC24	24,32	11 217	5,700		103,84	103,89	104,01	4,89	4,88	4,88	16-ene-19	161,9	4,83	4,69	5,57	5,29
12-ago-26	PEP01000C039	SB12AGOC26	34,98	12 515	8,200		117,79	117,82	117,89	5,31	5,30	5,29	16-ene-19	41,2	5,86	5,57	7,57	5,67
12-ago-28	PEP01000C501	SB12AGOC28	27,09	14 246	6,350		105,42	105,46	105,53	5,61	5,60	5,59	16-ene-19	54,3	7,31	6,92	9,57	5,96
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	3,55	10 350	5,940		102,08	102,54	102,54	5,72	5,66	5,60	16-ene-19	38,0	7,67	7,26	10,07	6,01
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGOC31	26,65	14 123	6,950		108,94	109,04	109,22	5,93	5,92	5,90	16-ene-19	32,0	8,66	8,18	12,57	6,19
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGOC32	26,24	12 283	6,150		101,47	101,56	101,66	5,97	5,98	5,97	16-ene-19	50,3	9,33	8,80	13,57	6,27
12-ago-37	PEP01000C221	SB12AGOC37	29,44	11 175	6,900		107,58	107,69	107,58	6,21	6,20	6,21	16-ene-19	6,0	10,90	10,26	18,57	6,46
12-feb-42	PEP01000C457	SB12FEB42	29,22	4 443	6,850	-	-	-	-	106,75	-	-	15-ene-19	8,5	12,12	11,41	23,07	6,54
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	28,64	2 272	6,714	-	-	-	-	104,84	-	-	28-dic-18	0,2	14,27	13,41	36,07	6,64
13-oct-24	PEP01000C789	SB13OCT24	26,18	1 314	6,84% + VAC	-	-	-	-	125,90	-	-	05-mar-18	5,0	4,96	4,86	5,74	3,09
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	13,65	86	2,89%+VAC	-	-	-	-	104,59	-	-	05-mar-18	5,0	9,63	9,40	11,07	3,46
31-ene-35	PEP01000Cv85	SB31ENE35	49,63	1 350	7,39% + VAC	-	-	-	-	157,62	-	-	14-ene-19	51,0	10,95	10,65	16,04	3,57
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	14,86	256	3,14%+VAC	-	-	-	-	106,67	-	-	14-ene-19	80,0	18,61	15,39	21,07	3,67
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGOC46	23,22	611	3,83% + VAC	-	-	-	-	121,73	-	-	24-may-18	15,0	18,33	17,85	27,57	3,77
12-feb-54	PEP01000C470	SB12FEB54	15,48	431	3,29%+VAC	-	-	-	-	113,18	-	-	03-feb-17	1,0	22,07	21,50	35,07	3,87

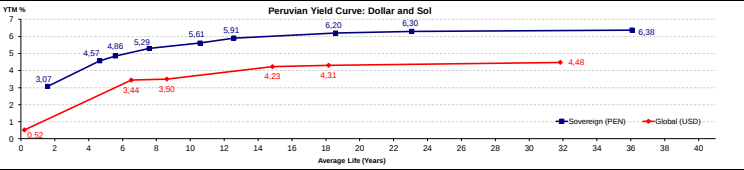
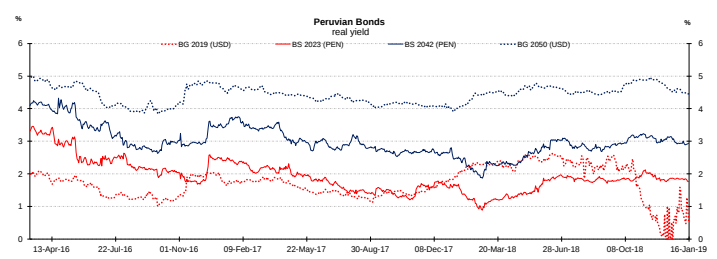
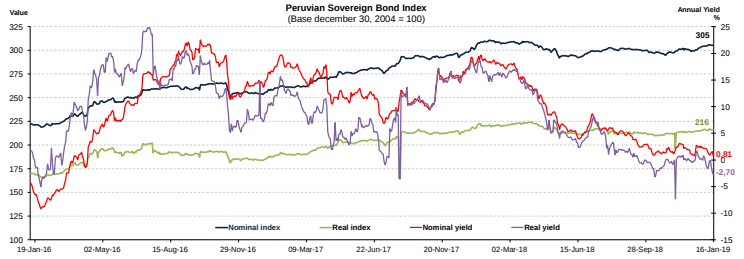
Global Bonds

Bonds	ISIN	Outstanding Millions USD	Coupon %	Price	Change		Price Spread Bid / Ask	Yield %	Change (bps)		Spread over Treasury (bp)	Change (bps)		Sensitivity Analysis			Average Life Years
					Daily	Weekly			Daily	Weekly		Daily	Weekly	Duration	Modified	Convexity	
Perú Global 19	US715638AW21	396	7,125	101,32	0,06	-0,12	0,14	0,52	-37	-5	-203	-38	-4	0,21	0,21	0,00	0,20
Perú Global 25	US715638AS19	1 793	7,350	102,62	-0,02	-0,04	0,37	3,44	0	0	72	16	12	5,28	5,19	0,33	6,61
Perú Global 26	XS1315181708	€1 100	2,750	109,13	-0,51	0,33	0,71	1,38	7	-5	156	5	0	6,37	6,28	0,48	7,14
Perú Global 27	US715638BU55	1 250	4,125	104,59	-0,06	-0,04	0,38	3,5	1	0	62	1	-2	6,53	6,42	0,60	7,72
Perú Global 30	XS13173156618	€1 000	3,750	117,99	0,10	0,11	0,81	1,94	-1	-1	174	-3	3	9,19	9,10	1,01	11,20
Perú Global 33	US715638AP79	2 188	8,750	149,49	-0,13	-0,09	0,66	4,23	1	0	135	1	-3	9,68	9,48	1,20	15,06
Perú Global 37	US715638AU64	1 165	6,550	128,06	-0,09	-0,28	0,57	4,31	1	2	143	1	-2	11,57	11,33	1,60	18,42
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	119,35	-0,12	-0,30	0,49	4,48	1	1	141	1	-5	16,37	16,01	3,81	32,30



Peruvian sovereign bond index

Index	Value	Change		Annual yield %	Change (bps)		Index composition (%)											
		Daily	Weekly		Daily	Weekly	12-Aug-28	10-Sep-23	12-Aug-24	12-Aug-26	12-Aug-28	12-Feb-29	12-Aug-31	12-Aug-32	12-Aug-37	12-Feb-42	12-Feb-55	
Sovereign nominal bond index	305	-0.33	-0.46	0.81	-0.7	-0.4	1.62	5.58	10.93	14.17	14.40	0.00	9.95	14.86	11.12	10.51	4.56	
Index	Value	Change		Annual yield %	Change (bps)		Index composition (%)											
		Daily	Weekly		Daily	Weekly	13-Jul-19	13-Oct-14	12-Feb-38		31-Jan-35	12-Feb-40	12-Aug-46	12-Feb-54				
Sovereign real bond index	216	0.0	-1.0	-2.70	-0.44	-1.3	0.39	29.30	2.12		38.30	6.15	12.95	10.79				



Currency	Spot	Change (%)				
		1W	1M	3M	6M	12M
Sol (Soles / Dollar)	3.33	-0.22	-0.50	-0.07	1.98	3.77
Forwards PEN	Tenors					
	1M	2M	3M	6M	9M	12M
Sol (Soles / Dollar)	3.34	3.34	3.34	3.35	3.36	3.38
Interest Rates (%)	Tenors					
	ON	1W	1M	3M	6M	12M
PEN Interbank Rates	2.75	3.58	4.82	4.93	5.06	5.35
USD Interbank Rates	1.75	0.22	1.15	1.64	1.76	2.02

Operations in the foreign exchange market with non-banking customers (millions of US\$)

Spot market	Dates						
	16-Jan-19	15-Jan-19	14-Jan-19	11-Jan-19	10-Jan-19	9-Jan-19	8-Jan-19
Purchases	202	202	342	341	282	452	281
Sales	214	214	258	378	383	328	257
Forward purchases	Dates						
	16-Jan-19	15-Jan-19	14-Jan-19	11-Jan-19	10-Jan-19	9-Jan-19	8-Jan-19
Pacted	131	131	159	270	191	194	356
Redemption	134	134	83	192	73	163	289
Forward sells	Dates						
	16-Jan-19	15-Jan-19	14-Jan-19	11-Jan-19	10-Jan-19	9-Jan-19	8-Jan-19
Pacted	221	221	279	528	352	210	219
Redemption	209	209	169	639	144	211	260