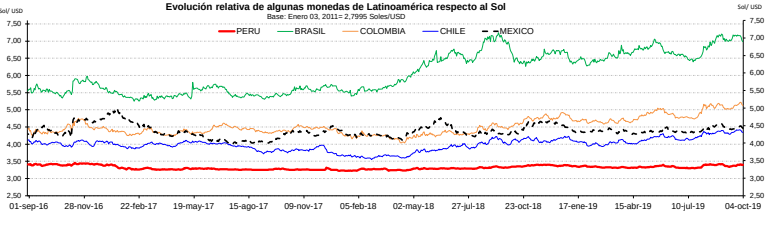




PERU: REPORTE DIARIO

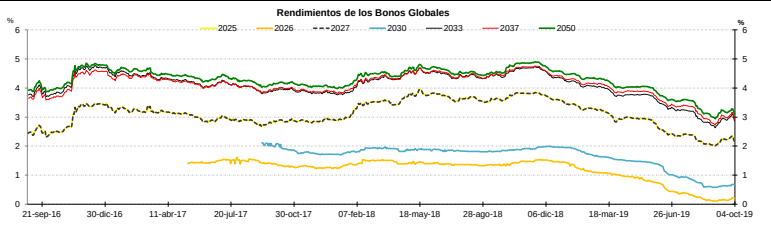
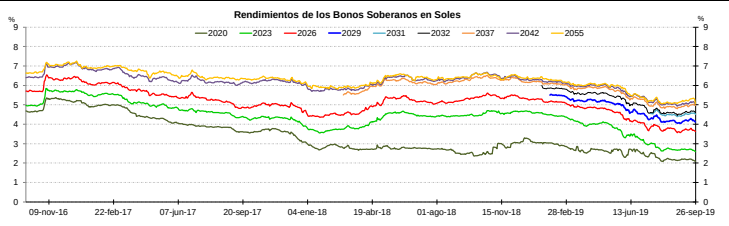
4 de octubre de 2019 5:15 PM

Indicadores Principales						
Indicadores principales		Periodo	Actual	Anterior	Indicadores	
					Hoy (pbs)	Cambio
					Diario	Semanal
PBI (mensual, var % yoy)		Jul-19	3,28	2,62	CDS 3y	31 1 6
Inflación IPC (var % yoy)		Sep-19	1,85	2,04	CDS 5y	61 1 7
Inflación subyacente (var % yoy)		Sep-19	2,16	2,20	CDS 10y	115 2 9
Inflación meta (var % yoy)		Oct-19	2,00	2,00	EMBI+	104 -16 2
Desempleo (%)		Aug-19	5,80	6,00	SPBVL PERU GEN	19 270 1,47% -2,43%
Balanza comercial (US\$ Millones)		Jul-19	446	745	SPBVL LIMA 25	24 389 1,53% -0,92%
Tasa de política monetaria (%)		Oct-19	2,50	2,50	Volatilidad bono soberano (10 años)-Diaria	
						0,40%
					Volatilidad bono soberano (10 años)-Anualizada	6,39%
Deuda de largo plazo		S&P			Fitch	Moody's
		BBB+			BBB+	A3
Moneda extranjera		A-			A-	BBB+
Moneda local						A-

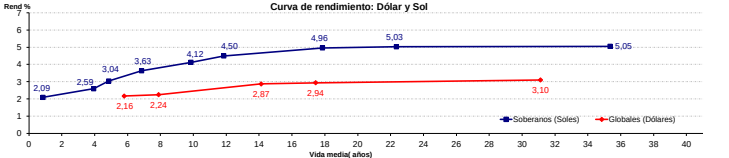
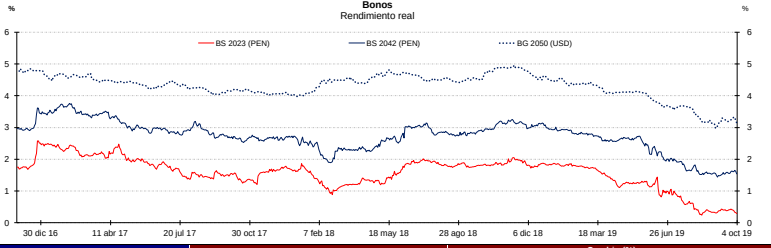
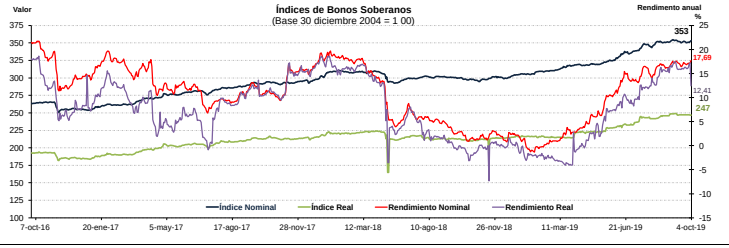


Bonos soberanos																				
Letras y bonos				Saldo vigente Millones soles	Cupón %	Precio				Rendimiento				Nº de Operaciones del día	Última Negociación*		Duración Años	Duración Modificada	Vida media Años	Rendimiento medio histórico
Descripción	ISIN	Nominado	Intereses corridos SI			Postura		Última negociación del día	Promedio ponderado	Postura		Última negociación del día	Promedio ponderado		Día	Monto (Millones Soles)				
						Compra	Venta			Compra	Venta									
16-oct-19	PEP010007748	LTP16OCT19	-	151	-	-	99,9298	-	-	-	2,1298	-	17-jul-19	29	0,03	0,03	0,03	2,90		
20-nov-19	PEP010007756	LTP20NOV19	-	159	-	-	99,7247	-	-	-	2,1344	-	21-ago-19	36	0,13	0,13	0,13	2,91		
04-dic-19	PEP010007764	LTP04DIC19	-	119	-	-	99,6425	-	-	-	2,1363	-	18-sep-19	35	0,17	0,17	0,17	2,91		
22-ene-20	PEP010007772	LTP22ENE20	-	183	-	-	99,3543	-	-	-	2,1427	-	24-jul-19	44	0,31	0,30	0,31	2,93		
19-feb-20	PEP010007780	LTP19FEB20	-	46	-	-	99,1892	-	-	-	2,1464	-	22-may-19	13	0,38	0,38	0,38	2,94		
18-mar-20	PEP010007798	LTP18MAR20	-	174	-	-	99,0238	-	-	-	2,1503	-	25-sep-19	31	0,46	0,45	0,46	2,95		
15-abr-20	PEP010007806	LTP15ABR20	-	84	-	-	98,8582	-	-	-	2,1539	-	17-jul-19	27	0,54	0,53	0,54	2,97		
20-may-20	PEP010007814	LTP20MAY20	-	159	-	-	98,6507	-	-	-	2,1586	-	04-sep-19	39	0,64	0,62	0,64	2,99		
17-jun-20	PEP010007822	LTP17JUN20	-	60	-	-	98,4845	-	-	-	2,1622	-	18-sep-19	32	0,71	0,70	0,71	3,01		
20-jul-20	PEP010007830	LTP20JUL20	-	30	-	-	98,2381	-	-	-	2,1666	-	24-jul-19	44	0,81	0,79	0,81	3,04		
19-ago-20	PEP010007848	LTP19AGO20	-	30	-	-	98,1094	-	-	-	2,1705	-	28-ago-19	32	0,89	0,87	0,89	3,06		
16-sep-20	PEP010007855	LTP16SEP20	-	30	-	-	97,9423	-	-	-	2,1742	-	26-sep-19	1	0,97	0,95	0,97	3,06		
12-ago-20	PEP01000C33	SB12AGO20	11,29	231	7,840	-	104,8318	-	-	-	2,0871	-	19-jul-19	4,0	0,97	0,95	0,86	3,82		
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	3,14	1 777	5,200	109,5521	109,5913	109,5913	109,6187	2,6000	2,5900	2,5900	2,5929	12	04-oct-19	25,0	3,67	3,58	3,94	
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	8,21	11 543	5,700	111,7348	111,7764	111,8241	111,8370	3,0500	3,0400	3,0300	3,0350	40	04-oct-19	221,8	4,38	4,25	4,86	
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	11,81	12 515	8,200	127,3072	127,3765	127,3072	127,3318	3,6300	3,6200	3,6300	3,6347	32	04-oct-19	69,0	5,60	5,41	6,86	
12-ago-28	PEP01000C501	SB12AGO28	9,15	14 471	6,350	116,8628	116,9434	116,9434	116,8224	4,0400	4,0300	4,0300	4,0482	33	04-oct-19	204,5	7,13	6,85	8,86	
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	8,55	14 041	5,940	113,7325	113,8152	114,3589	113,8050	4,1300	4,1200	4,1100	4,1236	28	04-oct-19	97,5	7,51	7,21	9,36	
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	10,01	14 448	6,950	122,0190	122,1214	122,2239	122,1720	4,5100	4,5000	4,4900	4,4973	12	04-oct-19	37,0	8,70	8,33	11,86	
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	8,86	13 627	6,150	114,6262	114,7279	114,9361	114,6624	4,6100	4,6000	4,5800	4,6063	42	04-oct-19	100,8	9,42	9,00	12,86	
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	15,56	7 613	5,400	106,9067	107,0162	107,0162	106,9518	4,7300	4,7200	4,7200	4,7263	13	04-oct-19	40,0	10,57	10,10	14,86	
12-ago-37	PEP01000C221	SB12AGO37	9,94	13 968	6,900	122,6768	122,7437	122,8775	122,6174	4,9500	4,9500	4,9400	4,9604	44	04-oct-19	114,0	11,35	10,81	17,86	
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	9,87	4 443	6,850	-	-	-	124,0958	-	-	-	5,0277	-	24-sep-19	2,0	12,90	12,28	22,36	
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	9,67	2 272	6,714	125,1126	127,0501	127,0501	127,0544	5,1500	5,0500	5,0500	5,0500	1	04-oct-19	1,0	16,10	15,32	35,36	
13-oct-24	PEP01000C789	SB13OCT24	49,05	1 332	6,84% + VAC	-	-	-	128,0042	-	-	-	1,0830	-	05-mar-18	5,0	4,38	4,34	5,03	
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,74	87	2,89%+VAC	-	-	-	111,3881	-	-	-	1,6680	-	31-may-16	27,0	9,21	9,06	10,36	
31-ene-35	PEP01000C6V5	SB13ENE35	19,64	1 369	7,39% + VAC	-	-	-	184,4046	-	-	-	1,2830	-	14-ene-19	51,0	11,15	11,01	15,33	
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	5,16	260	3,14%+VAC	-	-	-	128,7907	-	-	-	1,4790	-	14-ene-19	80,0	16,08	15,85	20,36	
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	8,06	619	3,83% + VAC	-	-	-	135,4273	-	-	-	2,0780	-	24-may-18	15,0	18,71	18,33	26,86	
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	5,38	437	3,26%+VAC	-	-	-	125,3089	-	-	-	2,1910	-	03-feb-17	1,0	22,68	22,19	34,36	

Bonos globales																	
Bonos	ISIN	Saldo vigente Millones dólares	Cupón %	Precio	Cambio		Precio diferencial compra / venta	Rendimiento%	Cambio (bps.)		Diferencial sobre Tesoro (Pb)	Cambio (Pbs.)		Análisis de sensibilidad			Vida media años
					Diario	Semanal			Diario	Semanal		Diario	Semanal	Duración años	Duración modificada	Convexidad	
Perú Global 25	US715638AS19	1 646	7,350	128,0640	0,39	0,71	0,26	2,1630	-7	-13	63	24	28	4,90	4,85	0,28	5,88
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	116,0060	0,08	-0,30	0,60	0,1960	-1	4	99	-1	6	5,83	5,82	0,41	6,42
Perú Global 27	US715638BU55	1 062	4,125	113,5130	0,56	1,19	0,31	2,2440	-7	-16	43	-6	-13	6,10	6,03	0,54	6,99
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	104,7440	0,66	2,00	0,32	2,3400	-7	-21	52	-5	-12	9,28	9,17	0,97	10,87
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	130,8750	0,20	-0,29	0,78	0,6660	-2	2	129	-2	3	8,86	8,83	0,95	10,48
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	167,9280	1,82	2,29	0,16	2,8660	-11	-15	105	-10	-2	9,56	9,43	1,17	14,34
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	149,0200	2,01	2,29	0,19	2,9370	-12	-13	112	-10	-1	11,92	11,75	1,63	17,70
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	150,2020	2,38	3,04	0,30	3,0990	-9	-12	108	-7	0	17,66	17,39	4,27	31,58



Índice de bonos soberanos																	
Índice	Valor	Cambio		Rend anual %	Cambio (pbs.)		Composición del índice										
		Diario	Semanal		Diario	Semanal	12-sep-23	12-ago-24	12-ago-26	12-ago-28	12-feb-29	12-ago-31	12-ago-32	12-ago-34	12-ago-27	12-feb-42	12-feb-55
Índice de bonos soberanos nominal	353	1,45	3,24	17,69	0,5	0,8	1,49	9,93	12,29	13,00	12,30	13,64	11,99	5,60	13,33	4,25	2,18
Índice	Valor	Cambio		Rend anual %	Cambio (pbs.)		Composición del índice										
		Diario	Semanal		Diario	Semanal	13-oct-24	12-feb-30	31-ene-35	12-feb-40	12-feb-46	12-feb-54					
Índice de bonos soberanos real	247	0,0	0,0	16,31	-4,8	-3,62	27,14	2,00	39,35	6,85	13,42	11,23					



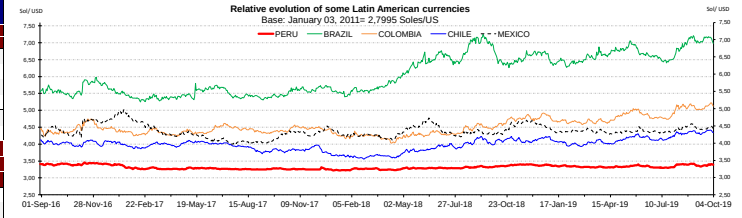
Moneda	Spot	Cambio (%)				
		1 S	1 M	3 M	6 M	12 M
Sol (Soles / Dólar)	3.38	-0.08	0.01	2.69	2.53	1.56
Forwards Soles	Plazos					
	1 M	2 M	3 M	6 M	9 M	12 M
Sol (Soles / Dólar)	3.38	3.39	3.39	3.40	3.42	3.43
Tasas de interés (%)	Plazos					
	1 S	1 M	3 M	6 M	12 M	
Tasa interbancaria soles %	2.50	3.58	4.82	4.93	5.06	5.35
Tasa interbancaria dólares %	2.00	0.22	1.15	1.64	1.76	2.02



PERU : DAILY REPORT

4 de octubre de 2019 5:15 PM

Key Indicators						
Indicators	Period	Latest	Previous	Indicators	Today (bps)	Change
GDP (monthly, yoy % ch.)	Jul-19	3.28	2.62	CDS 3y	31	1
CPI Inflation (yoy % ch.)	Sep-19	1.85	2.04	CDS 5y	61	1
Core Inflation (yoy % ch.)	Sep-19	2.16	2.20	CDS 10y	115	2
Target Inflation (yoy % ch.)	Oct-19	2.00	2.00	EMBI+	104	-16
Unemployment (%)	Aug-19	5.80	6.00	SPBVL PERU GEN	19 270	1.47%
Trade Balance (US\$ Millions)	Jul-19	446	745	SPBVL LIMA 25	24 389	1.53%
Monetary Policy Rate (%)	Oct-19	2.50	2.50	Volatility of sovereign bond (10 years) - Daily		0.40%
Long term debt		S&P		Volatility of sovereign bond (10 years) - Annualized		6.39%
Foreign currency		BBB+				
Local currency		A-				



Sovereign Bonds																						
T-bills and bonds				Outstanding		Coupon %	Price				Yield				No. Day Operations	Last Trade*		Duration	Modified	Average Life		Historic average yield
Description	ISIN	Mnemonic	Account Interest	Millions PEN	Position		Last trading day	weighted average	Position		Last trading day	weighted average	Date	Amount (Millions PEN)		Years	Duration			Years		
					Bid	Ask			Bid	Ask												
15-oct-19	PEPO1000T749	LTP140CT19		151	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1298	-	17-Jul-19	29	0.03	0.03	0.03	2.90		
20-nov-19	PEPO1000T756	LTP20NOV19		159	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1344	-	21-sep-19	36	0.13	0.13	0.13	2.91		
04-dec-19	PEPO1000T764	LTP04DEC19		119	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1363	-	18-sep-19	35	0.17	0.17	0.17	2.91		
22-nov-20	PEPO1000T772	LTP22NOV20		183	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1427	-	24-Jul-19	44	0.31	0.30	0.31	2.93		
19-feb-20	PEPO1000T780	LTP19FEB20		46	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1464	-	22-may-19	13	0.38	0.38	0.38	2.94		
18-mar-20	PEPO1000T798	LTP18MAR20		174	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1503	-	25-sep-19	31	0.46	0.45	0.46	2.95		
15-abr-20	PEPO1000T806	LTP15ABR20		84	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1539	-	17-Jul-19	27	0.54	0.53	0.54	2.97		
20-may-20	PEPO1000T814	LTP20MAY20		159	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1586	-	04-sep-19	39	0.64	0.62	0.64	2.99		
17-jun-20	PEPO1000T822	LTP17JUN20		60	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1622	-	18-sep-19	32	0.71	0.70	0.71	3.01		
20-jul-20	PEPO1000T830	LTP20JUL20		30	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1666	-	24-Jul-19	48	0.81	0.79	0.81	3.04		
30-aug-20	PEPO1000T848	LTP30AUG20		30	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1705	-	28-sep-19	32	0.99	0.87	0.99	3.06		
18-sep-20	PEPO1000T856	LTP18JUL22		30	-	-	-	-	-	-	-	-	2,1742	-	26-sep-19	1	0.97	0.95	0.97	3.06		
12-sep-20	PEPO1000C493	SB12AG020	11.29	231	7.840	-	-	-	-	-	-	-	2,0871	-	19-Jul-19	4.0	0.97	0.95	0.86	3.82		
12-sep-20	PEPO1000C493	SB12SEP23	3.14	1 777	5.200	109.5521	109.5913	109.5913	2,6000	2.5900	2.5900	2,5929	12	04-oct-19	25.0	3.67	3.58	3.94	4.86			
12-sep-24	PEPO1000C494	SB12AG024	8.21	11 543	5.700	111.7348	111.7764	111.8241	3,0500	3.0400	3.0300	3,0390	40	04-oct-19	221.8	4.38	4.25	4.86	5.11			
12-sep-26	PEPO1000C499	SB12AG026	11.81	12 515	8.200	127.3072	127.3765	127.3072	3,6300	3.6200	3.6300	3,6347	32	04-oct-19	69.0	5.60	5.41	6.86	5.53			
12-sep-28	PEPO1000C501	SB12AG028	9.15	14 471	6.350	116.8628	116.9434	116.9434	4,0400	4.0300	4,0300	4,0482	33	04-oct-19	204.5	7.13	6.85	8.86	5.85			
12-feb-29	PEPO1000C596	SB12FEB296	8.56	14 041	5.940	113.7325	113.8152	114.3589	4,1300	4.1200	4,1200	4,1236	28	04-oct-19	97.5	7.51	7.21	9.36	5.92			
12-sep-31	PEPO1000C467	SB12AG031	10.01	14 448	6.950	122.0190	122.1214	122.2239	4,5100	4.5000	4,4900	4,4973	12	04-oct-19	37.0	8.70	8.33	11.86	6.13			
12-sep-32	PEPO1000C569	SB12AG032	8.86	13 627	6.150	114.6262	114.7279	114.9361	4,6100	4.6000	4,5800	4,6063	42	04-oct-19	100.8	9.42	9.00	12.86	6.21			
12-sep-34	PEPO1000C564	SB12AG034	15.56	7 613	5.400	106.9067	107.0162	107.0162	4,7500	4.7200	4,7200	4,7263	13	04-oct-19	40.0	10.57	10.10	14.86	7.03			
12-sep-37	PEPO1000C221	SB12AG037	9.94	13 968	6.900	122.6768	122.7437	122.8775	4,9300	4.9200	4,9400	4,9604	44	04-oct-19	114.0	11.35	10.81	17.86	6.32			
12-feb-42	PEPO1000C447	SB12FEB42	9.87	4 443	6.850	-	-	-	12,04958	-	-	-	5,0277	-	24-sep-19	2.0	12.90	12.28	22.36	6.29		
12-feb-55	PEPO1000C582	SB12FEB55	9.67	2 272	6.714	125.1126	127.0501	127.0501	5,1500	5,0500	5,0500	5,0500	1	04-oct-19	1.0	16.10	15.32	35.36	6.39			
13-oct-24	PEPO1000C189	SB13OCT24	49.05	1 332	6.84%+ VAC	-	-	-	128,0042	-	-	-	1,0830	-	05-mar-18	5.0	4.38	4.34	5.03	3.09		
12-feb-30	PEPO1000C448	SB12FEB30	4.74	87	2.89%+VAC	-	-	-	111,3881	-	-	-	1,6680	-	31-may-16	27.0	9.21	9.06	10.36	3.46		
31-ene-35	PEPO1000C495	SB31ENE35	19.64	1 369	7.39%+ VAC	-	-	-	184,4046	-	-	-	1,2830	-	14-ene-19	50.0	11.15	11.01	15.33	3.57		
12-feb-40	PEPO1000C446	SB12FEB40	5.16	260	3.14%+VAC	-	-	-	128,7907	-	-	-	1,4790	-	14-ene-19	80.0	16.08	15.85	20.36	3.67		
12-sep-46	PEPO1000C158	SB12AG046	8.06	619	3.83%+ VAC	-	-	-	135,4273	-	-	-	2,0780	-	24-may-18	15.0	18.71	18.33	26.86	3.77		
12-feb-54	PEPO1000C470	SB12FEB54	5.38	437	3.26%+VAC	-	-	-	125,3089	-	-	-	2,1910	-	03-feb-17	1.0	22.68	22.19	34.36	3.87		