



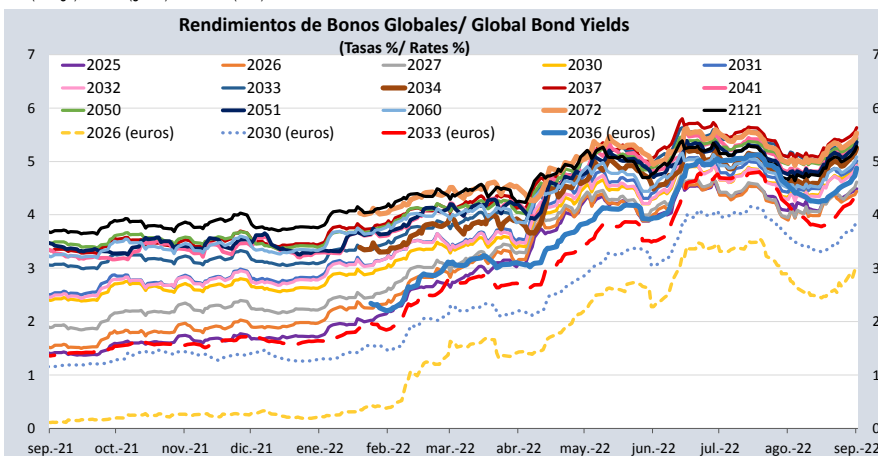
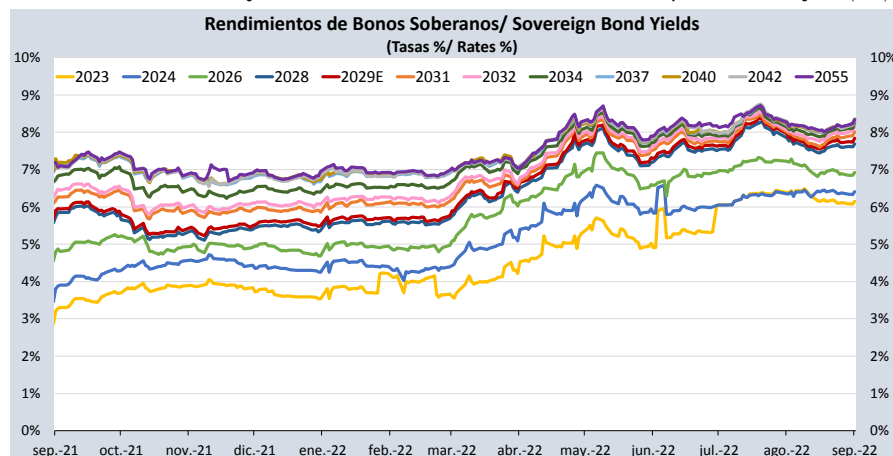
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

01/09/2022

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón % / Coupon %	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos S./ / Accrued Interest PEN			Postura / Position		Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average	Postura / Position		Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado / Weighted average		Día / Date	Monto (Mills. S) / Amount (Millions PEN)			
				Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask												
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	24,45	1 309	5,200	-	-	-	99,0687	-	-	-	6,1502	-	19-ago-22	0	1,04	0,98	1,03
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	3,10	6.741	5,700	-	-	-	98,7241	-	-	-	6,4080	-	25-ago-22	1	1,89	1,78	1,95
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	4,46	12 517	8,200	-	-	-	104,3937	-	-	-	6,9213	-	31-ago-22	20	3,50	3,27	3,95
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,45	15 726	6,350	93,75	93,79	93,83	93,8263	7,71	7,70	7,69	7,6893	30	01-sep-22	407	5,07	4,70	5,95
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	32,29	17 129	5,940	90,53	90,58	90,74	90,6574	7,87	7,86	7,82	7,8392	43	01-sep-22	400	5,44	5,05	6,45
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,78	15 866	6,950	93,43	93,49	93,60	93,5355	8,03	8,02	8,00	8,0106	22	01-sep-22	82	6,80	6,29	8,95
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	3,34	16 297	6,150	86,73	86,85	86,76	86,8183	8,16	8,14	8,16	8,1441	24	01-sep-22	172	7,46	6,90	9,95
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,94	11 689	5,400	78,76	78,83	78,83	78,7979	8,27	8,26	8,26	8,2621	15	01-sep-22	86	8,61	7,95	11,95
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,75	16 180	6,900	87,94	88,01	88,09	88,0531	8,37	8,36	8,35	8,3542	34	01-sep-22	470	9,27	8,55	14,95
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,91	8 566	5,350	72,61	72,68	72,68	72,6946	8,36	8,35	8,35	8,3466	33	01-sep-22	143	10,69	9,87	17,95
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,72	4 610	6,850	-	-	-	86,4716	-	-	-	8,3012	-	31-ago-22	3	10,52	9,72	19,45
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,65	2 272	6,714	-	-	-	82,3349	-	-	-	8,3352	-	18-ago-22	3	12,25	11,32	32,45
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	45,69	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	108,1095	-	-	-	2,8351	-	26-ago-22	10	1,99	1,94	2,12
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,06	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,3189	-	-	-	4,2419	-	05-ago-22	10	6,80	6,53	7,45
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	11,11	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,9979	-	-	-	4,5981	-	10-jun-22	10	8,91	8,52	12,42
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,24	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,7592	-	-	-	4,6671	-	15-jun-21	19	13,23	12,64	17,45
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	3,50	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,2448	-	-	-	4,6334	-	21-jul-22	2	15,49	14,81	23,95
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	2,33	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,0178	-	-	-	4,6523	-	12-ago-21	10	18,35	17,53	31,45

Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).
 Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



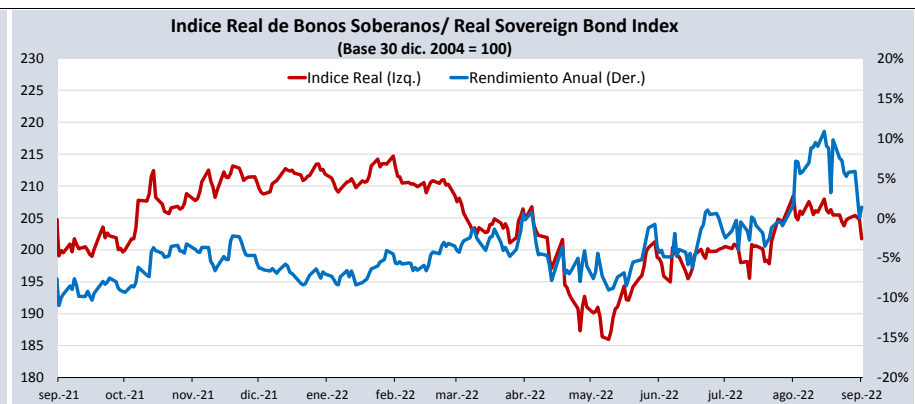
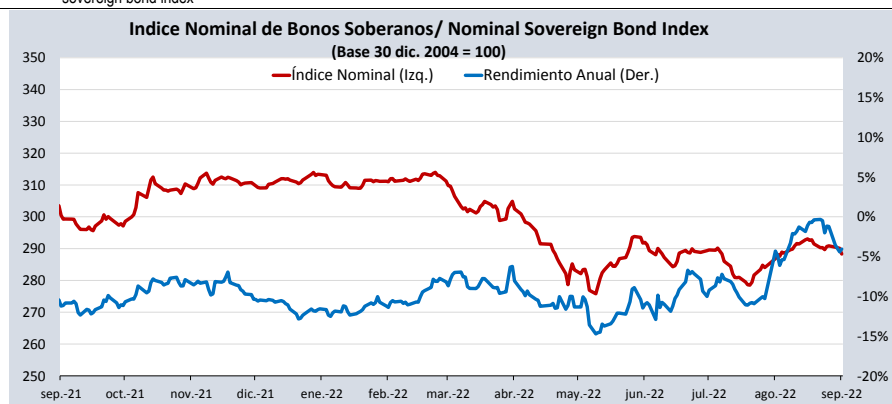
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

Bonos globales**** / Global bonds

Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid- ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis de sensibilidad / Sensitivity Analysis		
					Diario / Daily	Semanal / Weekly			Diario / Daily	Semanal / Weekly		Duración / Duration	Duración modificada / Modified duration	Vida media / Average life
Perú Global 25	US715638AS19	1 542	7,350	107,6370	-0,13	-0,55	-0,50	4,4860	4	18	18	2,65	2,59	2,93
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,6400	-0,17	-0,57	-0,42	4,4380	6	20	14	3,27	3,20	3,44
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,1160	-0,23	-1,15	-0,62	3,0240	7	36	20	3,27	3,23	3,46
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,8580	-0,43	-1,27	-0,51	4,6120	10	29	12	4,55	4,44	5,05
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,5500	-0,46	-1,60	-0,55	4,9450	8	27	9	6,94	6,77	7,91
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,9500	-0,80	-2,16	-0,73	3,9120	13	34	11	6,51	6,39	7,52
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	84,8940	-0,63	-1,66	-0,42	5,0120	11	27	7	7,43	7,25	8,52
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,6080	-0,60	-2,09	-0,59	4,9240	9	31	9	9,15	8,93	10,40
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,6340	-0,52	-2,03	-0,58	5,3230	5	20	6	7,72	7,52	11,39
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,3710	-1,03	-2,63	-0,78	4,4810	15	38	11	9,68	9,47	10,68
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	80,9260	-0,73	-2,61	0,57	5,2500	10	34	8	9,44	9,20	11,54
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,5470	-1,20	-2,89	-0,81	4,8710	15	35	10	11,96	11,67	14,42
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	109,0070	-0,82	-2,73	-0,95	5,6330	8	26	9	9,55	9,29	14,74
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	75,2260	-0,92	-3,20	-0,80	5,4400	10	33	8	12,91	12,57	18,79
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	103,0000	-1,12	-3,61	-0,82	5,4160	8	24	6	14,43	14,05	28,63
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	73,6480	-1,14	-3,55	-0,99	5,3650	10	29	9	15,93	15,51	28,94
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,3100	-1,00	-3,61	-0,48	5,0850	9	30	4	19,27	18,80	38,81
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	67,4690	-1,13	-3,58	-0,94	5,5290	9	28	8	18,33	17,83	50,09
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	61,4070	-0,99	-3,59	-0,58	5,2790	8	29	5	19,53	19,03	100,34

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index

Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual % / Annual yield %	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly		Diario / Daily	Semanal / Weekly	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-37	12-ago-40	12-feb-42	12-feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	288	-2	-2	-4,05	36	-289	0,00	5,69	11,21	12,78	13,46	13,16	12,57	7,97	12,70	5,38	3,45	1,62
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual % / Annual yield %	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	202	-3	-3		1,35	138	-385	31,99	2,30	37,69	6,10	12,25	9,67					



Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

* Para mayor información respecto a la valorización de los bonos y letras puede consultar en: http://www.mef.gob.pe/contenidos/tesoro_pub/gestion_act_pas/Manual_valorizacion_instrumentos_del_Tesoro.pdf