



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

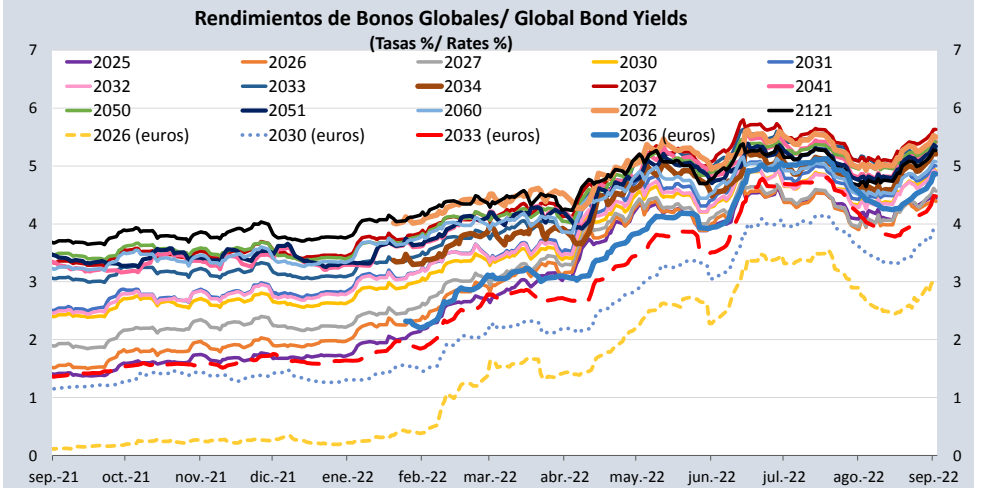
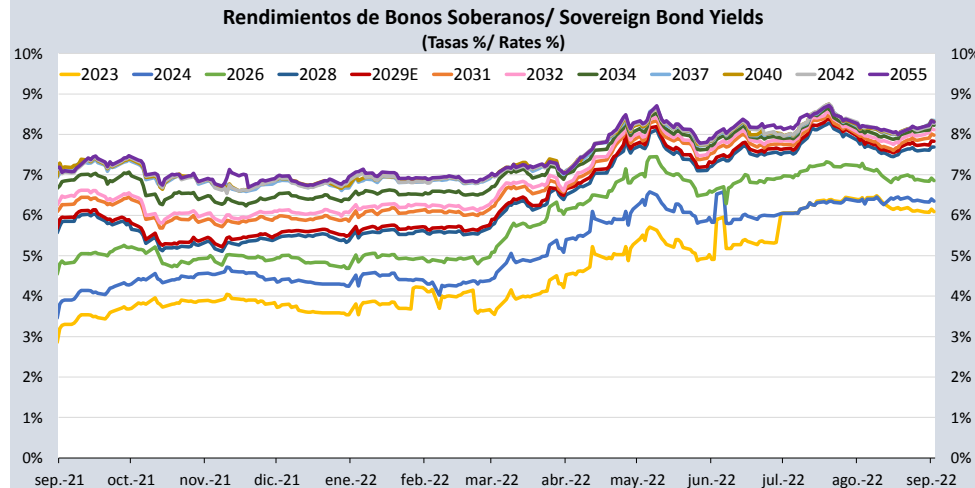
02/09/2022

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 /	Duración /	Vida media
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos SI. / Accrued Interest PEN			Millones SI. / Millions 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)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	24.59	1 309	5,200	-	-	-	99,1271	-	-	-	6,0922	-	19-ago-22	0	1,04	0,98	1,03
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	3,25	6.741	5,700	98,84	98,89	98,84	98,8278	6,35	6,32	6,35	6,3500	2	02-sep-22	7	1,89	1,78	1,94
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	4,68	12 517	8,200	104,62	104,66	104,59	104,6107	6,85	6,84	6,86	6,8573	7	02-sep-22	17	3,50	3,27	3,94
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,62	15 726	6,350	93,81	93,84	93,79	93,8475	7,70	7,69	7,70	7,6850	39	02-sep-22	179	5,06	4,70	5,94
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	33,90	17 129	5,940	90,67	90,72	90,67	90,7114	7,84	7,83	7,84	7,8281	35	02-sep-22	601	5,44	5,05	6,44
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,97	15 866	6,950	93,72	93,75	93,64	93,7018	7,98	7,98	8,00	7,9827	7	02-sep-22	13	6,80	6,29	8,94
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	3,51	16 297	6,150	86,92	86,98	86,92	86,9976	8,13	8,12	8,13	8,1147	14	02-sep-22	34	7,46	6,90	9,94
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	3,08	11 689	5,400	78,89	78,95	78,89	79,0438	8,25	8,24	8,25	8,2235	17	02-sep-22	66	8,61	7,96	11,94
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,94	16 180	6,900	88,09	88,17	88,17	88,1517	8,35	8,34	8,34	8,3413	37	02-sep-22	468	9,27	8,56	14,94
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	3,05	8 566	5,350	72,68	72,79	72,68	72,9215	8,35	8,34	8,35	8,3154	5	02-sep-22	13	10,70	9,88	17,94
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,91	4 610	6,850	-	-	-	86,7353	-	-	-	8,2700	-	31-ago-22	3	10,49	9,69	19,44
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,83	2 272	6,714	-	-	-	82,6248	-	-	-	8,3040	-	18-ago-22	3	12,25	11,32	32,44
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	46,01	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	108,2206	-	-	-	2,7786	-	26-ago-22	10	1,99	1,94	2,11
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,16	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,4243	-	-	-	4,2247	-	05-ago-22	10	6,80	6,52	7,44
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	11,46	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	126,3544	-	-	-	4,5647	-	10-jun-22	10	8,91	8,52	12,41
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,35	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,0434	-	-	-	4,6399	-	15-jun-21	19	13,24	12,65	17,44
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	3,67	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,6422	-	-	-	4,6032	-	21-jul-22	2	15,51	14,83	23,94
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	2,45	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,4276	-	-	-	4,6222	-	12-ago-21	10	18,39	17,57	31,44

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).



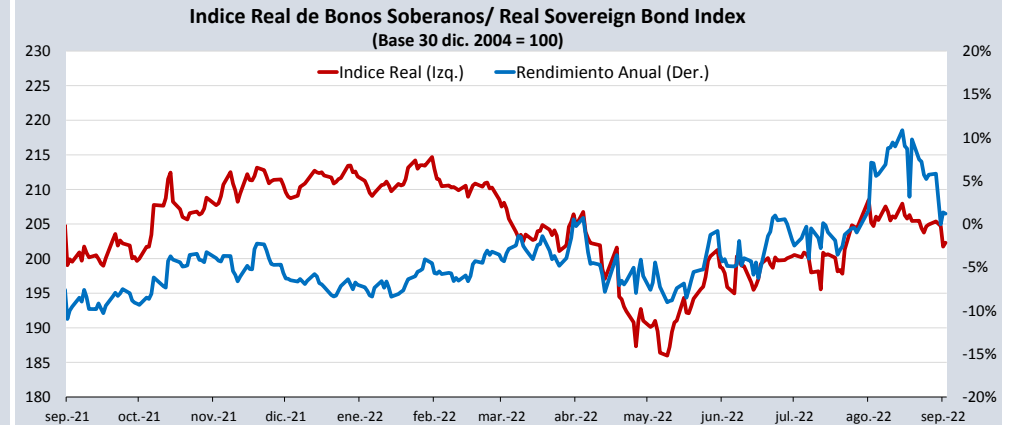
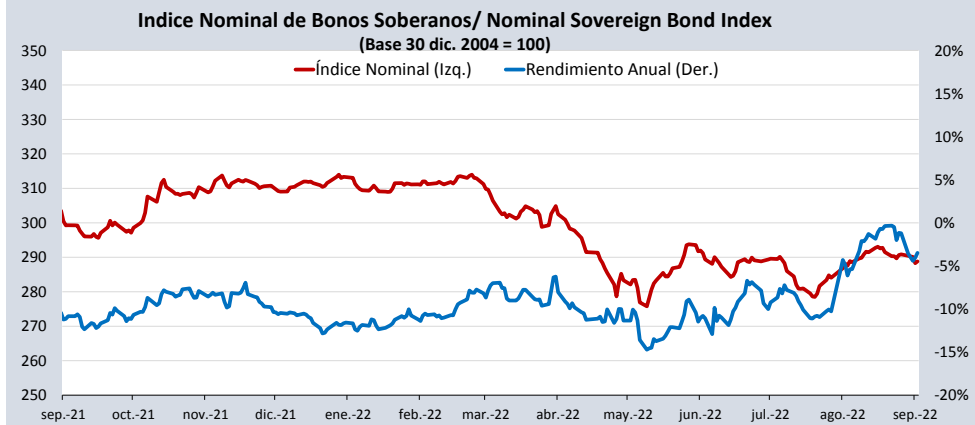
Bonos globales**** / Global bonds

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	107,7440	0,11	-0,37	-0,47	4,4450	-4	11	17	2,64	2,59	2,93
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,7970	0,16	-0,33	-0,43	4,3870	-5	12	14	3,26	3,19	3,44
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,1470	0,03	-1,01	-0,62	3,0150	-1	32	20	3,27	3,22	3,46
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	98,0570	0,20	-1,22	-0,41	4,5660	-5	28	9	4,54	4,44	5,05
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,7150	0,17	-1,34	-0,58	4,9180	-3	23	10	6,94	6,77	7,91
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,9260	-0,02	-1,84	-0,72	3,9160	0	29	11	6,51	6,39	7,52
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	84,9750	0,08	-1,50	-0,37	5,0000	-1	25	6	7,43	7,24	8,51
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,7660	0,16	-1,78	-0,55	4,9010	-2	26	8	9,15	8,93	10,40
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,9140	0,28	-1,60	-0,56	5,2940	-3	16	6	7,72	7,52	11,38
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,4030	0,03	-2,26	-0,81	4,4770	0	33	12	9,68	9,46	10,68
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	81,2760	0,35	-2,15	0,61	5,2040	-5	28	8	9,45	9,21	11,54
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,6140	0,07	-2,61	-0,82	4,8630	-1	32	10	11,95	11,67	14,42
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	109,0000	-0,01	-2,58	-0,84	5,6340	0	24	8	9,55	9,29	14,74
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	75,4720	0,25	-2,86	-0,79	5,4150	-3	29	8	12,92	12,58	18,79
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	103,0120	0,01	-3,39	-0,85	5,4150	0	23	6	14,43	14,05	28,62
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	73,9310	0,28	-3,19	-0,92	5,3410	-2	26	8	15,95	15,54	28,93
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,4400	0,13	-3,31	-0,59	5,0740	-1	27	5	19,29	18,81	38,81
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	67,8250	0,36	-3,07	-0,89	5,5000	-3	24	7	18,39	17,90	50,09
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	61,5640	0,16	-3,20	-0,75	5,2660	-1	26	6	19,57	19,07	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	289	1	-2	-3,49	56	-227	0,00	5,72	11,25	12,82	13,48	13,16	12,57	7,93	12,68	5,36	3,43	1,61

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	13-oct-24	12-feb-30	31-ene-35	12-feb-40	12-feb-46	12-feb-54
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	202	1	-3	1,20	-15	-451	31,94	2,29	37,70	6,11	12,27	9,69



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