



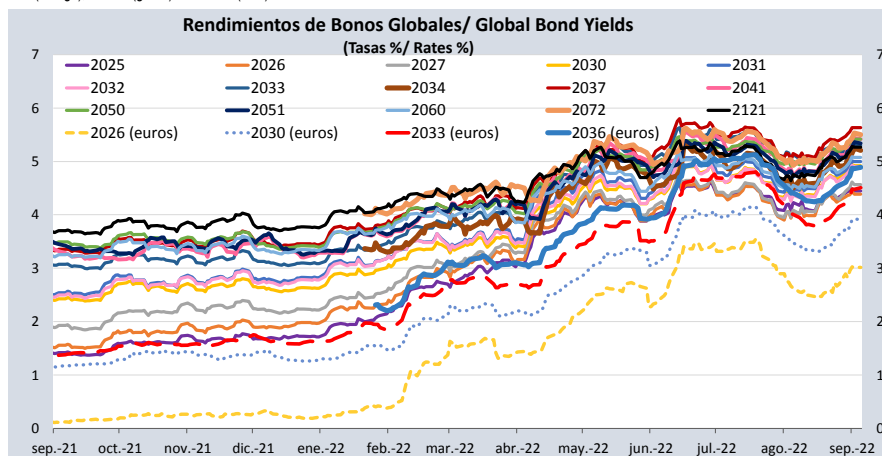
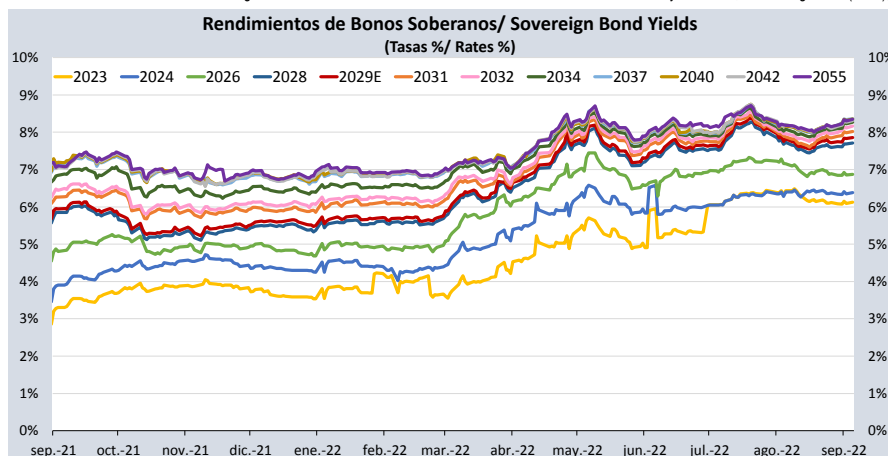
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

05/09/2022

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			Millones S./ / 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			
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	25,01	1 309	5,200	-	-	-	99,1062	-	-	-	6,1222	-	19-ago-22	0	1,04	0,98	1,02
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	3,72	6.741	5,700	98,84	98,89	98,78	98,7796	6,35	6,32	6,38	6,3800	1	05-sep-22	2	1,88	1,77	1,94
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	5,35	12 517	8,200	-	-	-	104,5412	-	-	-	6,8750	-	02-sep-22	17	3,49	3,26	3,94
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	4,14	15 726	6,350	93,66	93,71	93,71	93,7203	7,73	7,72	7,72	7,7152	7	05-sep-22	25	5,05	4,69	5,94
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	38,74	17 129	5,940	90,49	90,54	90,58	90,5645	7,88	7,87	7,86	7,8620	14	05-sep-22	54	5,43	5,04	6,44
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	4,53	15 866	6,950	93,43	93,49	93,49	93,4543	8,03	8,02	8,02	8,0252	15	05-sep-22	45	6,78	6,28	8,94
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	4,01	16 297	6,150	86,68	86,74	86,74	86,6801	8,17	8,16	8,16	8,1686	13	05-sep-22	170	7,45	6,89	9,94
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	3,52	11 689	5,400	78,64	78,71	78,77	78,7342	8,29	8,28	8,27	8,2740	10	05-sep-22	22	8,59	7,94	11,94
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	4,50	16 180	6,900	87,87	87,94	88,02	88,0010	8,38	8,37	8,36	8,3616	45	05-sep-22	247	9,26	8,54	14,94
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	3,49	8 566	5,350	72,47	72,54	72,61	72,6144	8,38	8,37	8,36	8,3587	8	05-sep-22	23	10,68	9,85	17,94
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	4,47	4 610	6,850	-	-	-	86,3724	-	-	-	8,3133	-	31-ago-22	3	10,49	9,68	19,44
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	4,38	2 272	6,714	-	-	-	82,2236	-	-	-	8,3473	-	18-ago-22	3	12,23	11,30	32,44
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	47,05	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	108,2710	-	-	-	2,7407	-	26-ago-22	10	1,98	1,93	2,11
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,47	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,6165	-	-	-	4,1939	-	05-ago-22	10	6,79	6,52	7,44
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	12,52	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	126,5884	-	-	-	4,5419	-	10-jun-22	10	8,91	8,52	12,41
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,69	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,3512	-	-	-	4,6109	-	15-jun-21	19	13,24	12,66	17,44
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	4,20	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,9772	-	-	-	4,5780	-	21-jul-22	2	15,52	14,84	23,94
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	2,80	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,7764	-	-	-	4,5969	-	12-ago-21	10	18,41	17,60	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).



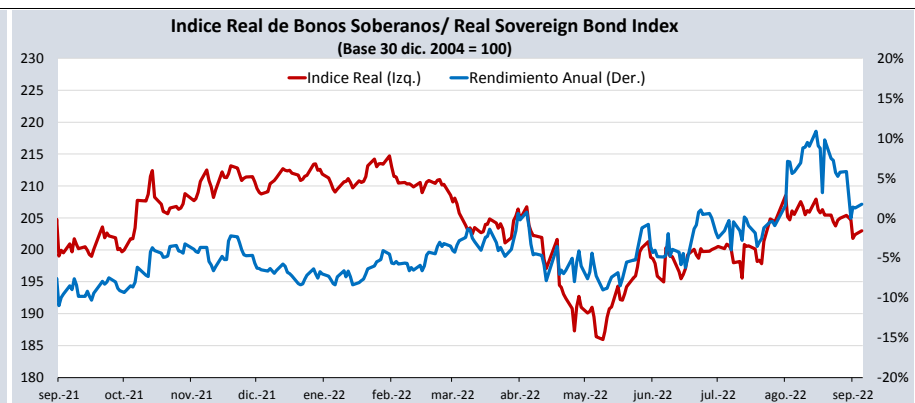
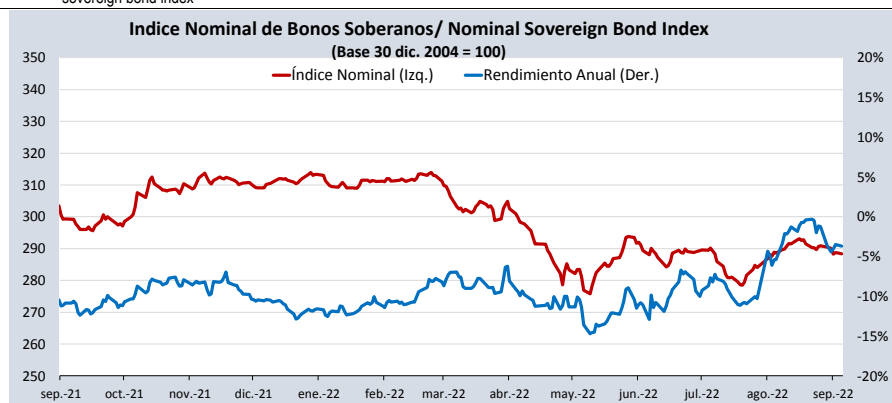
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	107,7440	0,00	-0,15	-0,47	4,4450	0	3	17	2,64	2,58	2,92
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,7970	0,00	-0,12	-0,43	4,3870	0	5	14	3,26	3,19	3,43
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,1470	0,00	-0,39	-0,62	3,0150	0	12	20	3,26	3,21	3,45
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	98,0570	0,00	-0,55	-0,41	4,5660	0	13	9	4,54	4,43	5,04
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,7150	0,00	-0,81	-0,58	4,9180	0	14	10	6,93	6,76	7,90
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,9260	0,00	-1,19	-0,72	3,9160	0	19	11	6,50	6,38	7,51
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	84,9750	0,00	-1,02	-0,37	5,0000	0	17	6	7,42	7,24	8,51
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,7660	0,00	-1,10	-0,55	4,9010	0	17	8	9,14	8,93	10,39
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,9140	0,00	-0,93	-0,56	5,2940	0	9	6	7,71	7,51	11,38
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,1960	-0,21	-2,04	-0,86	4,5080	3	30	13	9,67	9,45	10,67
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	81,2760	0,35	-2,15	0,61	5,2040	-5	28	8	9,44	9,20	11,53
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,4170	-0,20	-2,30	-0,89	4,8880	2	28	11	11,94	11,66	14,41
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	109,0000	0,00	-1,70	-0,84	5,6340	0	16	8	9,54	9,28	14,73
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	75,4720	0,25	-2,86	-0,79	5,4150	-3	29	8	12,91	12,57	18,78
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	103,0120	0,00	-2,15	-0,85	5,4150	0	14	6	14,42	14,04	28,61
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	73,9310	0,28	-3,19	-0,92	5,3410	-2	26	8	15,94	15,53	28,93
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,4400	0,00	-2,16	-0,59	5,0740	0	18	5	19,28	18,81	38,80
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	67,8250	0,36	-3,07	-0,89	5,5000	-3	24	7	18,38	17,89	50,08
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	61,5640	0,00	-2,07	-0,75	5,2660	0	17	6	19,56	19,06	100,33

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	0	-2	-3,67	-18	-11	0,00	5,72	11,26	12,80	13,46	13,16	12,58	7,94	12,67	5,37	3,44	1,61
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	203	1	-2		1,72	47	-411	31,89	2,29	37,69	6,12	12,30	9,71					



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