



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

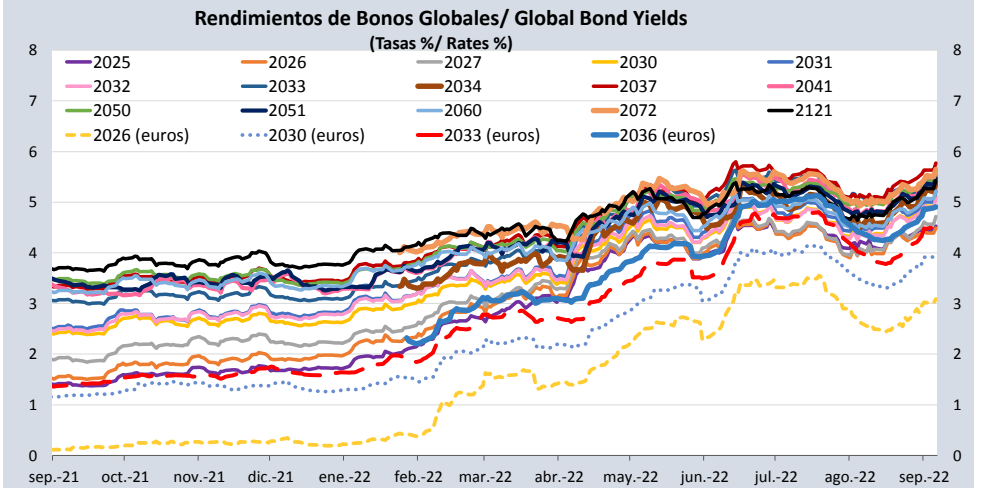
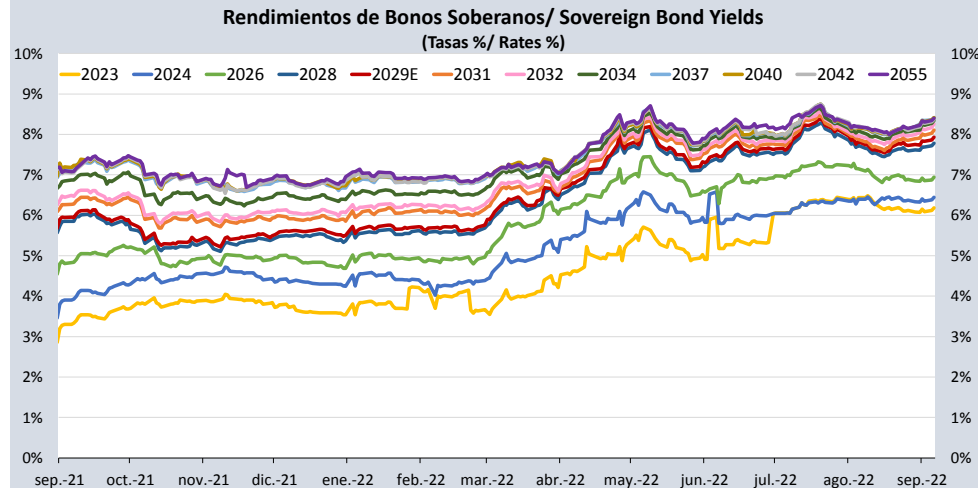
06/09/2022

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	25,15	1 309	5,200	-	-	-	99,0471	-	-	-	6,1872	-	19-ago-22	0	1,04	0,98	1,02
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	3,87	6.741	5,700	-	-	-	98,6674	-	-	-	6,4450	-	05-sep-22	2	1,88	1,77	1,93
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	5,57	12 517	8,200	104,14	104,31	104,31	104,3159	6,99	6,94	6,94	6,9400	1	06-sep-22	1	3,48	3,26	3,93
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	4,31	15 726	6,350	93,27	93,31	93,31	93,4260	7,82	7,81	7,81	7,7825	36	06-sep-22	258	5,05	4,68	5,93
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	40,35	17 129	5,940	90,08	90,17	90,13	90,2418	7,97	7,95	7,96	7,9332	26	06-sep-22	87	5,43	5,03	6,43
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	4,72	15 866	6,950	92,79	92,90	92,96	92,9901	8,14	8,12	8,11	8,1044	23	06-sep-22	65	6,77	6,27	8,93
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	4,18	16 297	6,150	86,02	86,14	86,02	86,1318	8,28	8,26	8,28	8,2608	43	06-sep-22	280	7,44	6,87	9,93
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	3,67	11 689	5,400	78,21	78,27	78,27	78,3074	8,36	8,35	8,35	8,3427	26	06-sep-22	85	8,58	7,92	11,93
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	4,69	16 180	6,900	87,49	87,57	87,49	87,6059	8,43	8,42	8,43	8,4142	66	06-sep-22	237	9,24	8,52	14,93
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	3,63	8 566	5,350	72,11	72,33	72,18	72,2238	8,43	8,40	8,42	8,4135	19	06-sep-22	52	10,65	9,82	17,93
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	4,65	4 610	6,850	-	-	-	85,9148	-	-	-	8,3681	-	31-ago-22	3	10,46	9,65	19,43
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	4,56	2 272	6,714	-	-	-	81,7202	-	-	-	8,4021	-	18-ago-22	3	12,18	11,25	32,43
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	47,39	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	108,0331	-	-	-	2,8473	-	26-ago-22	10	1,98	1,92	2,10
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,58	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,9258	-	-	-	4,3103	-	05-ago-22	10	6,79	6,51	7,43
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	12,87	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,4137	-	-	-	4,6505	-	10-jun-22	10	8,88	8,49	12,40
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,80	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,3443	-	-	-	4,7082	-	15-jun-21	19	13,21	12,61	17,43
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	4,38	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,6983	-	-	-	4,6756	-	21-jul-22	2	15,45	14,76	23,93
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	2,92	492	3,26%+VAC	-	-	-	76,4541	-	-	-	4,6945	-	12-ago-21	10	18,28	17,46	31,43

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.

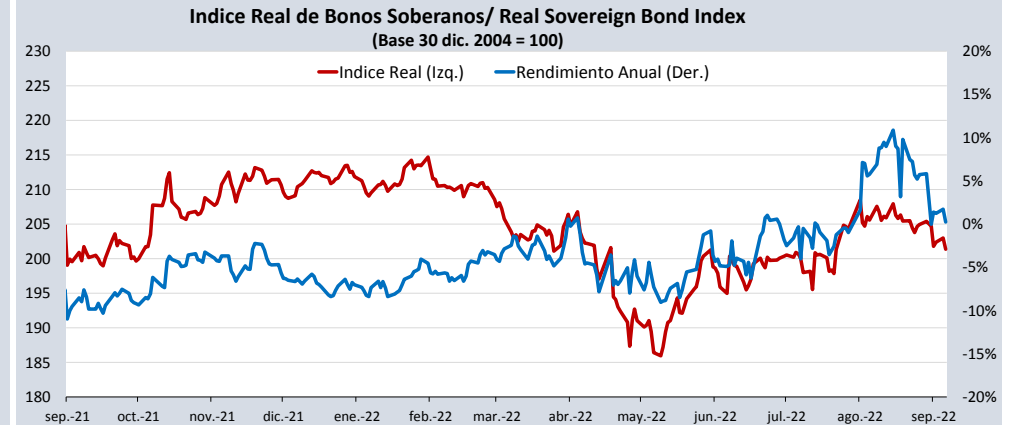
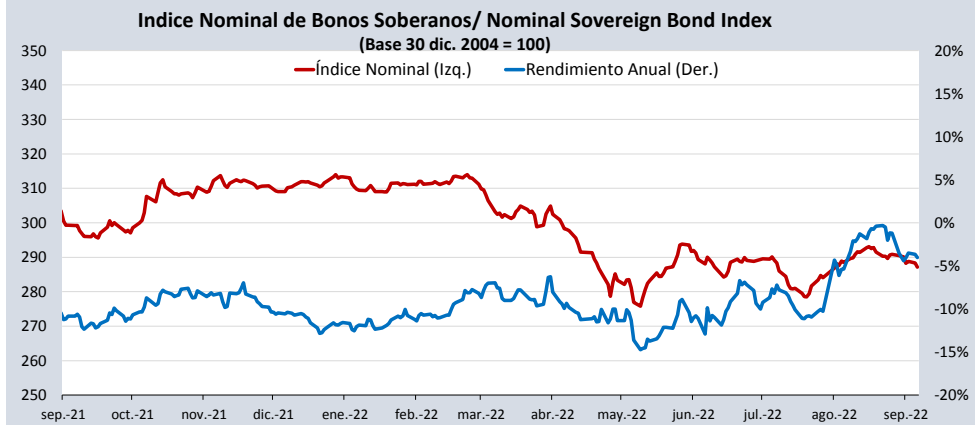
Bonos globales**** / Global bonds

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	107,5130	-0,23	-0,30	-0,47	4,5260	8	9	17	2,63	2,57	2,91
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,4940	-0,30	-0,36	-0,39	4,4900	10	13	13	3,25	3,18	3,43
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,9170	-0,23	-0,85	-0,58	3,0880	7	27	18	3,26	3,21	3,45
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,4050	-0,65	-1,05	-0,52	4,7170	15	24	12	4,53	4,43	5,04
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	85,6570	-1,06	-1,67	-0,57	5,0990	18	29	10	6,92	6,75	7,90
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,7340	-0,19	-1,58	-0,75	3,9460	3	25	12	6,50	6,37	7,51
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	83,6100	-1,36	-2,19	-0,49	5,2240	22	36	8	7,40	7,22	8,50
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	74,6390	-1,13	-1,93	-0,56	5,0690	17	29	8	9,13	8,91	10,39
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,0960	-0,82	-1,38	-0,22	5,3770	8	14	2	7,70	7,49	11,37
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,0830	-0,11	-1,76	-0,83	4,5250	2	26	12	9,66	9,45	10,66
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	79,9860	-1,29	-2,42	0,59	5,3780	17	33	8	9,42	9,17	11,53
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,2920	-0,13	-1,81	-0,88	4,9040	2	22	11	11,94	11,65	14,41
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	107,5820	-1,42	-2,67	-0,66	5,7710	14	26	7	9,50	9,24	14,73
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	74,1580	-1,31	-2,98	-0,80	5,5520	14	31	8	12,85	12,50	18,78
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	101,5040	-1,51	-3,15	-0,51	5,5190	10	22	3	14,32	13,93	28,61
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	72,3550	-1,58	-3,40	-0,93	5,4770	14	29	8	15,80	15,37	28,92
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,7410	-1,70	-3,29	-0,43	5,2230	15	28	4	19,00	18,52	38,79
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	66,0500	-1,78	-3,56	-0,89	5,6480	15	29	8	18,04	17,54	50,08
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	59,7160	-1,85	-3,34	-0,53	5,4270	16	28	5	19,00	18,50	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	287	-1	-3	-4,04	-37	-48	0,00	5,73	11,27	12,81	13,47	13,16	12,56	7,92	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	201	-2	-4	0,23	-149	-559	32,10	2,29	37,66	6,09	12,22	9,63



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