



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

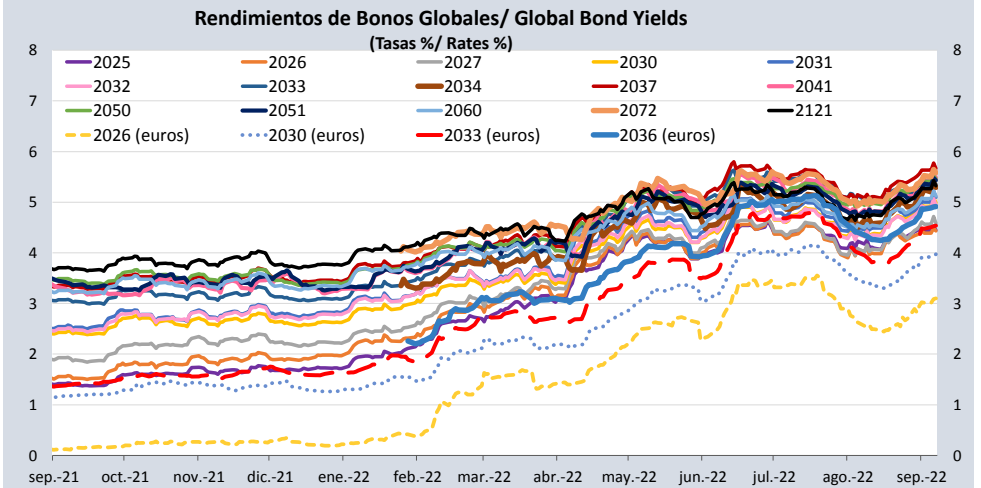
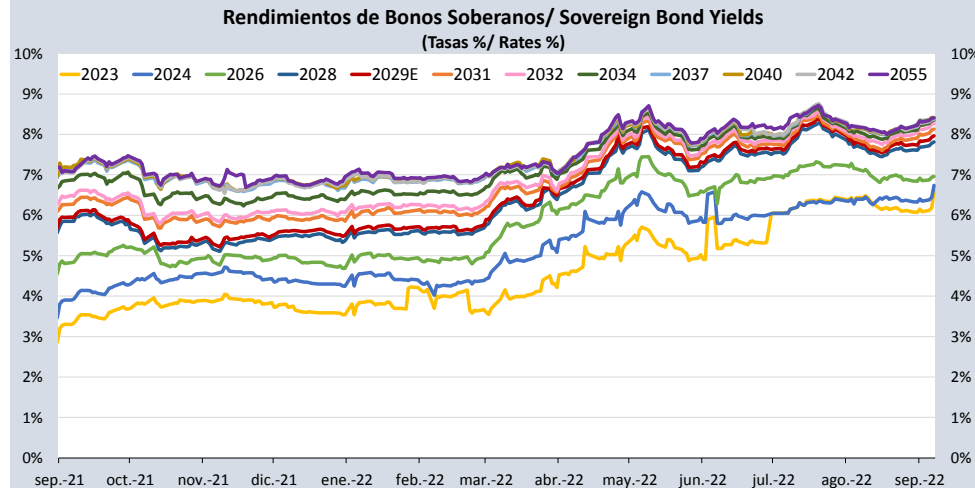
07/09/2022

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds			Intereses corridos SI. / Accrued Interest PEN	Saldo vigente Millones SI. / Millions PEN	Cupón % / Coupon %	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration Años / Years	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average Años / Years
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic				Postura / Position		Postura / Position		Última neg. / Last trading day		Última neg. / Last trading day			Día / Date				
			Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average	Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average	Día / Date	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years				
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	25,29	1 309	5,200	98,49	98,78	98,68	98,6608	6,70	6,40	6,60	6,6000	1	07-sep-22	13	0,99	0,93	1,01
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	4,03	6.741	5.700	-	-	-	98,1647	-	-	-	6,7352	-	05-sep-22	2	1,88	1,77	1,93
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	5,79	12 517	8,200	104,23	104,27	104,30	104,2360	6,96	6,95	6,94	6,9626	7	07-sep-22	13	3,48	3,26	3,93
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	4,49	15 726	6,350	93,28	93,32	93,23	93,2913	7,82	7,81	7,83	7,8137	21	07-sep-22	207	5,05	4,68	5,93
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	41,97	17 129	5,940	90,09	90,14	90,14	90,1167	7,97	7,96	7,96	7,9613	16	07-sep-22	187	5,42	5,02	6,43
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	4,91	15 866	6,950	92,82	92,85	92,79	92,8148	8,14	8,13	8,14	8,1346	23	07-sep-22	110	6,77	6,26	8,93
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	4,35	16 297	6,150	86,15	86,15	86,09	86,0938	8,26	8,26	8,27	8,2676	41	07-sep-22	140	7,43	6,87	9,93
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	3,82	11 689	5,400	78,34	78,40	78,28	78,2704	8,34	8,33	8,35	8,3491	7	07-sep-22	86	8,58	7,92	11,93
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	4,87	16 180	6,900	87,64	87,72	87,71	87,6370	8,41	8,40	8,40	8,4102	32	07-sep-22	164	9,24	8,52	14,93
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	3,78	8 566	5,350	72,33	72,40	72,26	72,1949	8,40	8,39	8,41	8,4178	9	07-sep-22	29	10,65	9,82	17,93
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	4,84	4 610	6,850	-	-	-	85,8797	-	-	-	8,3724	-	31-ago-22	3	10,46	9,66	19,43
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	4,74	2 272	6,714	-	-	-	81,6811	-	-	-	8,4064	-	18-ago-22	3	12,17	11,24	32,43
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	47,72	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,4751	-	-	-	3,1057	-	26-ago-22	10	1,98	1,92	2,10
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,68	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,7629	-	-	-	4,3383	-	05-ago-22	10	6,78	6,50	7,43
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	13,22	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,3603	-	-	-	4,6551	-	10-jun-22	10	8,88	8,49	12,40
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,92	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,3174	-	-	-	4,7110	-	15-jun-21	19	13,20	12,61	17,43
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	4,56	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,6459	-	-	-	4,6797	-	21-jul-22	2	15,44	14,75	23,93
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,04	492	3,26%+VAC	-	-	-	76,3988	-	-	-	4,6987	-	12-ago-21	10	18,27	17,45	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

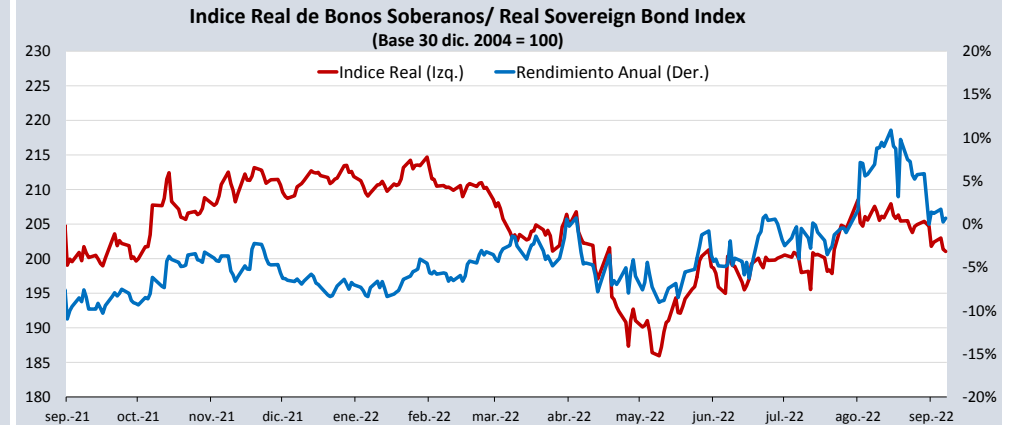
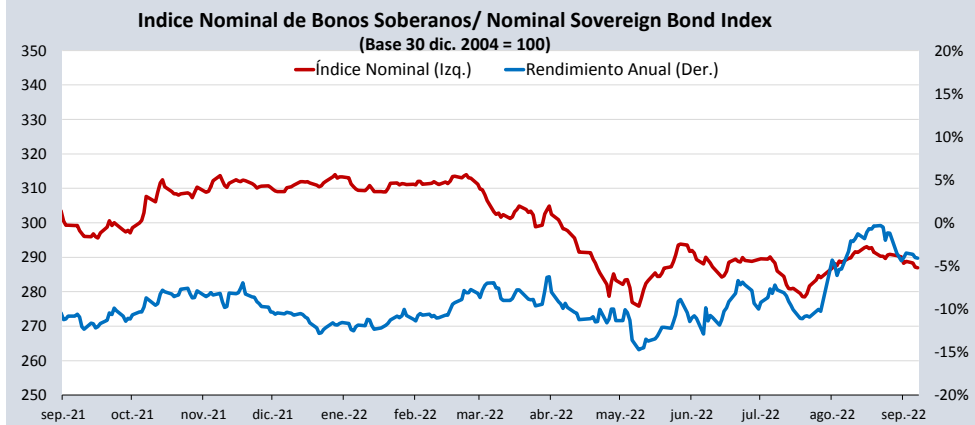
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	107,7320	0,22	-0,03	-0,45	4,4450	-8	0	16	2,63	2,57	2,91
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,6630	0,17	-0,14	-0,50	4,4350	-6	6	17	3,25	3,18	3,43
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,8750	-0,04	-0,47	-0,58	3,1010	1	15	19	3,26	3,21	3,45
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,9780	0,57	-0,31	-0,43	4,5850	-13	7	10	4,53	4,43	5,04
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,3180	0,66	-0,70	-0,55	4,9870	-11	12	9	6,92	6,75	7,90
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,5750	-0,16	-1,17	-0,75	3,9710	2	18	12	6,50	6,37	7,51
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	84,4120	0,80	-1,11	-0,55	5,0930	-13	19	9	7,41	7,22	8,50
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,5000	0,86	-0,71	-0,54	4,9420	-13	11	8	9,14	8,92	10,38
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,2880	0,19	-0,87	-0,79	5,3570	-2	8	8	7,70	7,50	11,37
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,0100	-0,07	-1,39	-0,85	4,5370	1	21	12	9,66	9,44	10,66
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	80,6370	0,65	-1,49	0,68	5,2900	-9	20	9	9,42	9,18	11,52
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,2260	-0,07	-1,52	-0,90	4,9120	1	19	11	11,93	11,65	14,40
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	108,6660	1,08	-1,16	-0,84	5,6660	-11	11	8	9,53	9,26	14,73
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	74,8280	0,67	-1,92	-0,78	5,4820	-7	20	8	12,88	12,53	18,78
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	102,2880	0,78	-1,83	-0,60	5,4640	-5	12	4	14,37	13,99	28,61
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	72,8810	0,53	-2,56	-0,83	5,4310	-5	22	7	15,84	15,42	28,92
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,8970	1,16	-1,41	-0,68	5,1210	-10	12	6	19,19	18,71	38,79
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	66,8000	0,75	-2,51	-0,96	5,5850	-6	21	8	18,18	17,69	50,08
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	60,8540	1,14	-1,54	-0,84	5,3260	-10	13	7	19,35	18,84	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	0	-3	-4,11	-7	31	0,00	5,75	11,30	12,82	13,48	13,15	12,53	7,91	12,67	5,35	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	0	-4	0,68	45	71	32,00	2,29	37,72	6,10	12,24	9,64



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](http://www.mef.gob.pe/contenidos/tesoro_pub/gestion_act_pas/Manual_valorizacion_instrumentos_del_Tesoro.pdf)