



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

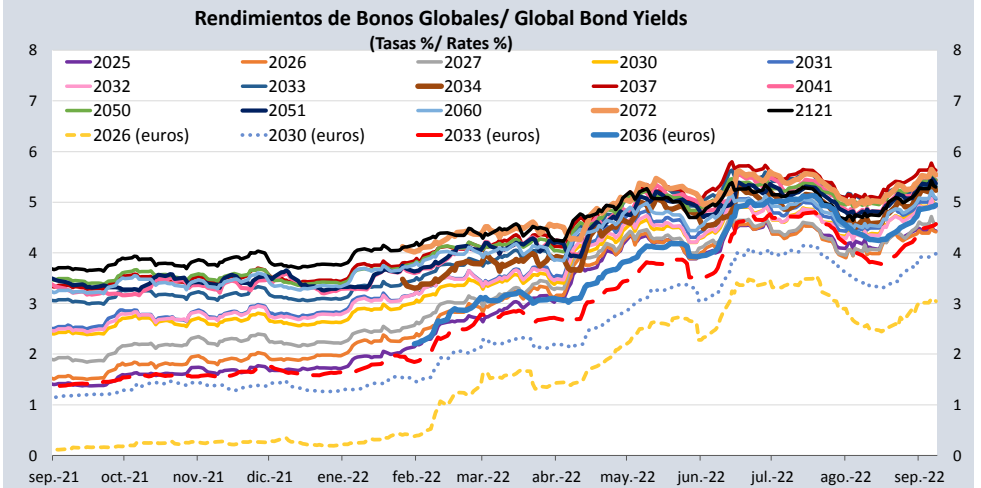
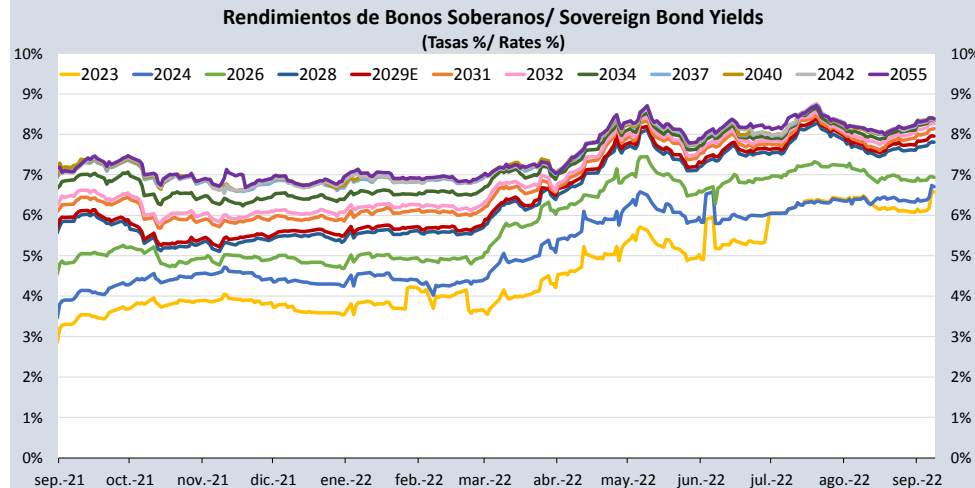
08/09/2022

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	25,44	1 309	5,200	-	-	-	98,6891	-	-	-	6,5739	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	1,01
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	4,18	6.741	5,700	-	-	-	98,2122	-	-	-	6,7091	-	05-sep-22	2	1,88	1,77	1,93
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	6,02	12 517	8,200	104,23	104,26	104,26	104,3223	6,96	6,95	6,95	6,9365	15	08-sep-22	40	3,48	3,25	3,93
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	4,66	15 726	6,350	93,28	93,32	93,37	93,3190	7,82	7,81	7,80	7,8079	17	08-sep-22	53	5,04	4,68	5,93
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	43,58	17 129	5,940	90,14	90,19	90,23	90,1235	7,96	7,95	7,94	7,9605	26	08-sep-22	152	5,42	5,02	6,43
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	5,10	15 866	6,950	92,79	92,82	92,82	92,8150	8,14	8,14	8,14	8,1348	24	08-sep-22	63	6,77	6,26	8,93
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	4,51	16 297	6,150	86,06	86,09	86,18	86,1188	8,28	8,27	8,26	8,2638	31	08-sep-22	127	7,43	6,86	9,93
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	3,96	11 689	5,400	78,31	78,34	78,47	78,3231	8,35	8,34	8,32	8,3411	57	08-sep-22	187	8,57	7,91	11,93
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	5,06	16 180	6,900	87,83	87,87	87,95	87,8396	8,39	8,38	8,37	8,3834	66	08-sep-22	411	9,24	8,53	14,93
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	3,92	8 566	5,350	72,48	72,51	72,55	72,3716	8,38	8,38	8,37	8,3933	45	08-sep-22	200	10,65	9,83	17,93
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	5,03	4 610	6,850	-	-	-	86,0846	-	-	-	8,3479	-	31-ago-22	3	10,48	9,68	19,43
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	4,93	2 272	6,714	-	-	-	81,9055	-	-	-	8,3819	-	18-ago-22	3	12,19	11,26	32,43
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	48,06	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,5188	-	-	-	3,0806	-	26-ago-22	10	1,97	1,91	2,10
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	2,78	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,7676	-	-	-	4,3380	-	05-ago-22	10	6,78	6,50	7,43
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	13,57	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,4686	-	-	-	4,6446	-	10-jun-22	10	8,88	8,49	12,40
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,03	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,5665	-	-	-	4,6870	-	15-jun-21	19	13,21	12,62	17,43
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	4,73	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,9521	-	-	-	4,6562	-	21-jul-22	2	15,46	14,77	23,93
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,16	492	3,26%+VAC	-	-	-	76,7163	-	-	-	4,6751	-	12-ago-21	10	18,30	17,48	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.

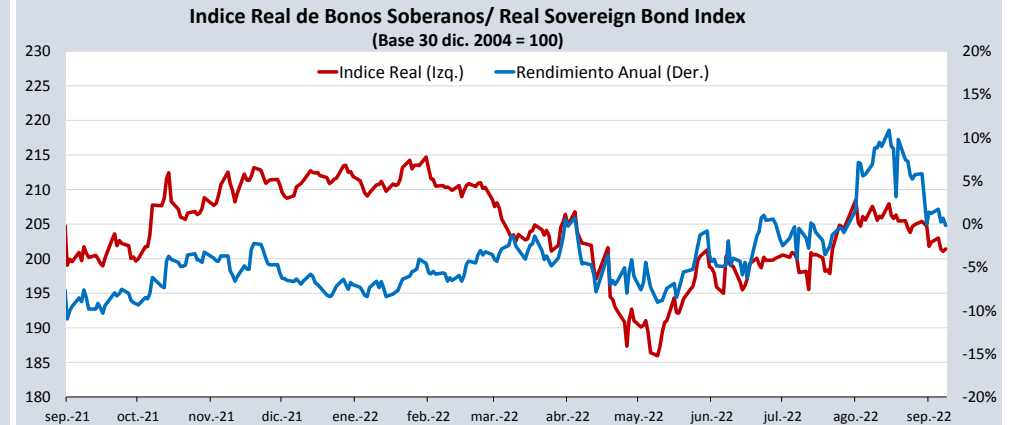
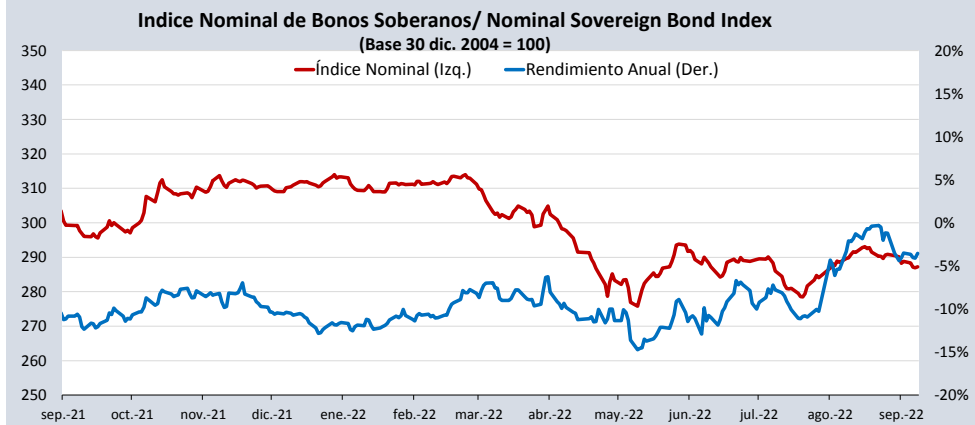
Bonos globales**** / Global bonds

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	107,7390	0,01	0,10	-0,54	4,4340	-1	-5	19	2,63	2,57	2,91
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,7410	0,08	0,10	-0,57	4,4140	-2	-2	19	3,25	3,18	3,43
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,0660	0,19	-0,05	-0,74	3,0420	-6	2	24	3,25	3,21	3,44
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	98,0360	0,06	0,18	-0,31	4,5720	-1	-4	7	4,53	4,43	5,03
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,6300	0,31	0,08	-0,48	4,9350	-5	-1	8	6,92	6,75	7,89
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,5130	-0,06	-0,44	-0,85	3,9810	1	7	14	6,49	6,37	7,50
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	84,6420	0,23	-0,25	-0,48	5,0570	-4	5	8	7,41	7,22	8,50
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,7590	0,26	0,15	-0,50	4,9060	-4	-2	7	9,14	8,92	10,38
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	128,6310	0,34	0,00	-0,92	5,3200	-4	0	9	7,70	7,50	11,37
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	72,8220	-0,19	-0,55	-0,84	4,5670	3	9	12	9,65	9,44	10,66
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	81,0630	0,43	-0,59	0,68	5,2350	-5	8	9	9,43	9,19	11,52
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	69,9690	-0,26	-0,58	-0,88	4,9460	3	7	11	11,92	11,64	14,40
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	109,0630	0,40	0,06	-0,70	5,6280	-4	0	7	9,53	9,27	14,73
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	75,2950	0,47	-0,85	-0,83	5,4340	-5	9	9	12,90	12,56	18,78
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	102,6770	0,39	-0,32	-0,59	5,4380	-3	2	4	14,39	14,01	28,61
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	73,6040	0,72	-1,18	-0,82	5,3690	-6	10	7	15,91	15,49	28,92
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,3420	0,45	0,03	-0,65	5,0830	-4	0	6	19,26	18,78	38,79
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	67,3870	0,59	-1,21	-1,00	5,5360	-5	10	8	18,29	17,80	50,07
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	61,1740	0,32	-0,23	-0,65	5,2990	-3	2	6	19,44	18,94	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	-1	-3,54	57	51	0,00	5,72	11,30	12,82	13,48	13,14	12,54	7,92	12,69	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	0	-0,16	-84	-153	31,97	2,29	37,70	6,11	12,26	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