



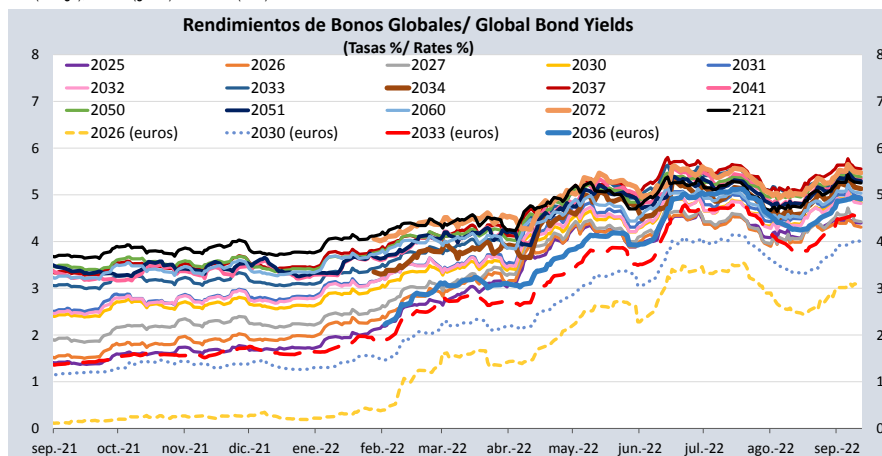
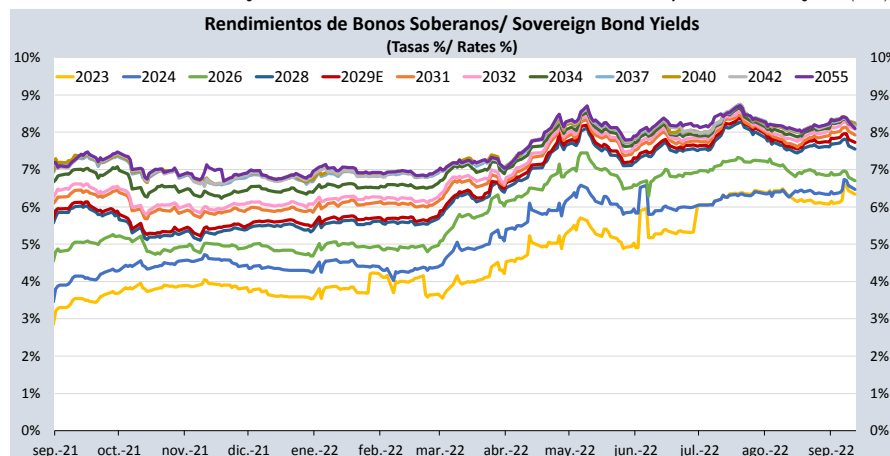
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

12/09/2022

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 / Duración	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	Monto (Mills. S) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask			Años / Years	Años / Years		Años / Years					
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	0,00	1 309	5,200	-	-	-	98,9248	-	-	-	6,3365	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	1,00
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	4,80	6.741	5,700	-	-	-	98,6314	-	-	-	6,4717	-	09-sep-22	1	1,86	1,75	1,92
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	6,91	12 517	8,200	105,11	105,39	105,15	105,1242	6,70	6,62	6,69	6,6991	3	12-sep-22	22	3,47	3,25	3,92
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	5,35	15 726	6,350	94,47	94,52	94,65	94,4562	7,55	7,54	7,51	7,5525	24	12-sep-22	197	5,04	4,69	5,92
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	50,04	17 129	5,940	91,20	91,25	91,29	91,1905	7,73	7,72	7,71	7,7304	19	12-sep-22	296	5,42	5,03	6,42
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	5,85	15 866	6,950	94,09	94,09	94,09	94,0308	7,92	7,92	7,92	7,9292	39	12-sep-22	185	6,77	6,28	8,92
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	5,18	16 297	6,150	87,24	87,27	87,24	87,2105	8,08	8,08	8,08	8,0831	48	12-sep-22	579	7,44	6,88	9,92
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	4,55	11 689	5,400	79,35	79,42	79,35	79,2812	8,18	8,17	8,18	8,1903	23	12-sep-22	439	8,59	7,94	11,92
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	5,81	16 180	6,900	88,78	88,86	88,78	88,8329	8,26	8,25	8,26	8,2531	29	12-sep-22	183	9,27	8,56	14,92
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	4,51	8 566	5,350	73,57	73,64	73,51	73,6130	8,23	8,22	8,24	8,2228	13	12-sep-22	262	10,71	9,90	17,92
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	5,77	4 610	6,850	-	-	-	87,6281	-	-	-	8,1659	-	31-ago-22	3	10,55	9,76	19,42
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	5,66	2 272	6,714	83,61	84,57	84,57	84,5664	8,20	8,10	8,10	8,1000	2	12-sep-22	2	12,32	11,40	32,42
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	49,40	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	108,0576	-	-	-	2,8072	-	09-sep-22	2	1,96	1,91	2,09
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,20	98	2,89%+VAC	-	-	-	92,3147	-	-	-	4,0806	-	05-ago-22	10	6,78	6,51	7,42
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	14,98	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	127,4786	-	-	-	4,4573	-	10-jun-22	10	8,90	8,52	12,39
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,48	292	3,14%+VAC	-	-	-	83,7028	-	-	-	4,4840	-	15-jun-21	19	13,26	12,69	17,42
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	5,44	695	3,83% + VAC	-	-	-	91,3515	-	-	-	4,4022	-	21-jul-22	2	15,63	14,97	23,92
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,63	492	3,26%+VAC	-	-	-	81,0540	-	-	-	4,3655	-	12-ago-21	10	18,69	17,90	31,42

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).



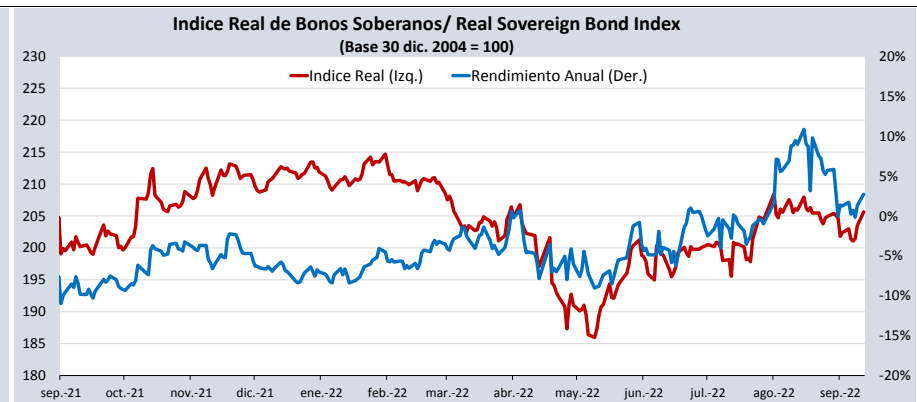
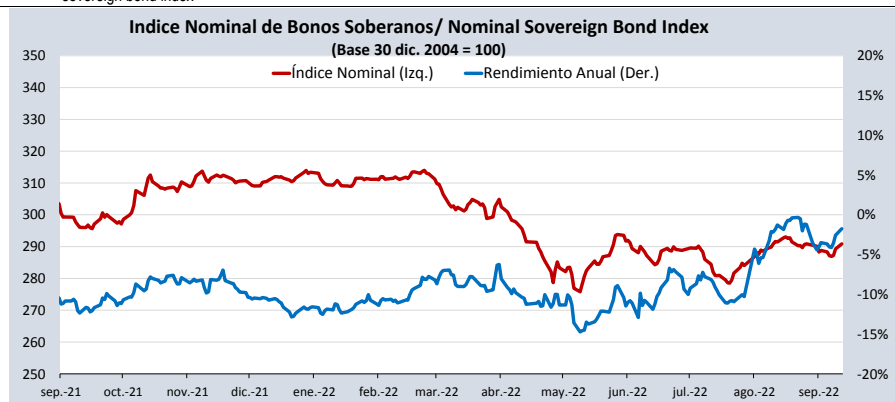
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	107,8400	0,02	0,10	-0,52	4,3930	-1	-5	19	2,62	2,56	2,90
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	94,0780	0,11	0,28	-0,57	4,3040	-4	-8	19	3,24	3,17	3,41
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,9500	0,04	-0,20	-0,58	3,0790	-1	6	19	3,24	3,19	3,43
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	98,6930	0,14	0,64	-0,50	4,4220	-3	-14	12	4,52	4,42	5,02
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	87,2210	0,20	0,51	-0,61	4,8370	-3	-8	10	6,91	6,75	7,88
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,3750	0,13	-0,55	-0,83	4,0030	-2	9	13	6,48	6,35	7,49
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	85,2910	0,19	0,32	-0,51	4,9530	-3	-5	8	7,40	7,22	8,49
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	76,3820	0,18	0,62	-0,66	4,8160	-3	-9	10	9,13	8,92	10,37
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	129,1850	0,21	0,27	-0,79	5,2630	-2	-3	8	7,70	7,50	11,36
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,1260	0,21	-0,07	-0,85	4,5240	-3	2	13	9,73	9,51	10,65
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	81,8430	0,26	0,57	0,67	5,1320	-3	-7	9	9,43	9,19	11,51
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,2670	0,30	-0,15	-0,92	4,9100	-4	2	11	11,92	11,63	14,39
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	109,8660	0,25	0,87	-0,82	5,5510	-2	-8	8	9,54	9,29	14,71
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	76,1470	0,38	0,68	-0,82	5,3470	-4	-7	8	13,20	12,86	18,76
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	103,5310	0,42	0,52	-0,59	5,3800	-3	-4	4	14,44	14,06	28,59
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	74,5330	0,36	0,60	-0,81	5,2910	-3	-5	7	16,36	15,94	28,91
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,9130	0,32	0,47	-0,75	5,0340	-3	-4	6	19,34	18,86	38,78
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	68,2210	0,27	0,40	-0,89	5,4680	-2	-3	7	18,44	17,95	50,06
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	61,7160	0,28	0,15	-0,76	5,2530	-2	-1	6	19,59	19,09	100,31

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	291	2	3	-1,75	82	192	0,00	5,70	11,27	12,83	13,48	13,12	12,53	7,93	12,71	5,38	3,44	1,62
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	206	2	3		2,73	143	101	31,50	2,28	37,56	6,15	12,49	10,01					



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