



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

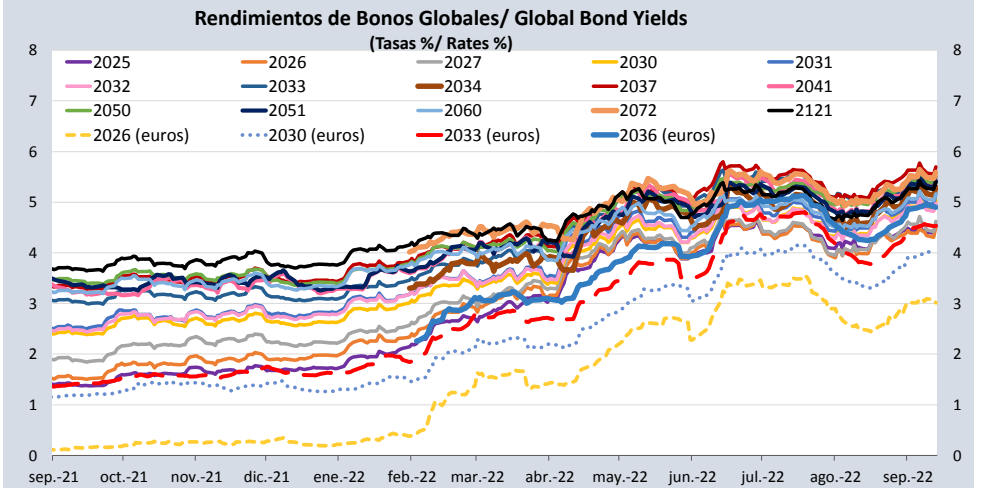
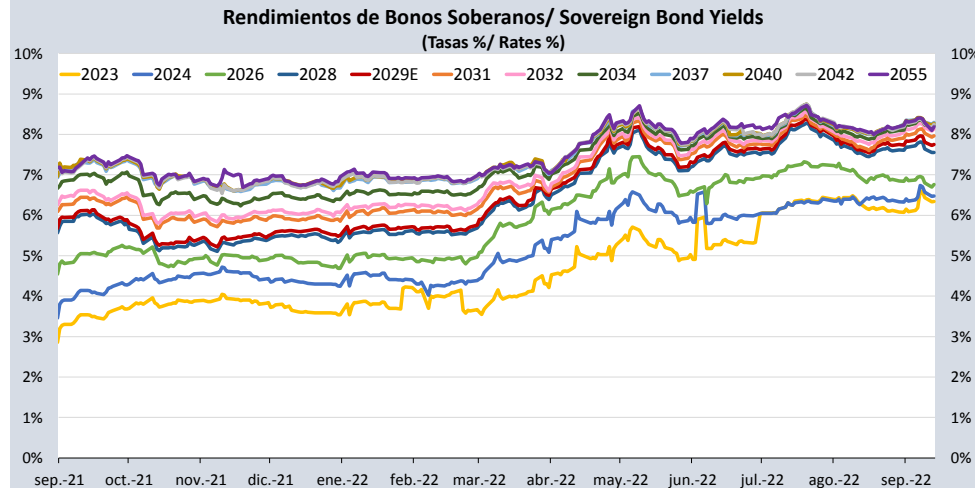
13/09/2022

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	0,14	1 309	5,200	-	-	-	98,9246	-	-	-	6,3394	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	1,00
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	4,96	6.741	5,700	-	-	-	98,6282	-	-	-	6,4746	-	09-sep-22	1	1,86	1,75	1,91
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	7,13	12 517	8,200	-	-	-	104,9118	-	-	-	6,7600	-	12-sep-22	22	3,47	3,25	3,91
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	5,52	15 726	6,350	94,43	94,48	94,41	94,4452	7,56	7,55	7,57	7,5554	32	13-sep-22	95	5,04	4,68	5,91
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	51,65	17 129	5,940	91,07	91,11	91,07	91,0900	7,76	7,75	7,76	7,7528	50	13-sep-22	112	5,41	5,02	6,41
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	6,04	15 866	6,950	93,85	93,97	93,85	93,8447	7,96	7,94	7,96	7,9608	16	13-sep-22	89	6,77	6,27	8,91
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	5,35	16 297	6,150	87,06	87,06	87,00	86,9302	8,11	8,11	8,12	8,1300	14	13-sep-22	97	7,43	6,87	9,91
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	4,70	11 689	5,400	79,01	79,04	79,04	79,1216	8,24	8,23	8,23	8,2160	31	13-sep-22	113	8,58	7,93	11,91
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	6,00	16 180	6,900	88,48	88,52	88,44	88,5231	8,30	8,30	8,31	8,2938	30	13-sep-22	198	9,25	8,54	14,91
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	4,65	8 566	5,350	73,28	73,35	73,35	73,2379	8,27	8,26	8,26	8,2744	4	13-sep-22	47	10,69	9,87	17,91
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	5,96	4 610	6,850	87,17	89,07	86,91	86,9116	8,22	8,00	8,25	8,2500	1	13-sep-22	1	10,48	9,68	19,41
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	5,84	2 272	6,714	-	-	-	83,7573	-	-	-	8,1841	-	12-sep-22	2	12,26	11,34	32,41
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	49,74	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,9034	-	-	-	2,8754	-	09-sep-22	2	1,96	1,90	2,08
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,30	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,7977	-	-	-	4,1671	-	05-ago-22	10	6,77	6,50	7,41
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	15,33	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	126,5102	-	-	-	4,5459	-	10-jun-22	10	8,88	8,50	12,38
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,59	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,5455	-	-	-	4,5937	-	15-jun-21	19	13,22	12,64	17,41
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	5,61	695	3,83% + VAC	-	-	-	89,4210	-	-	-	4,5450	-	21-jul-22	2	15,52	14,85	23,91
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,74	492	3,26%+VAC	-	-	-	79,0145	-	-	-	4,5082	-	12-ago-21	10	18,50	17,70	31,41

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.

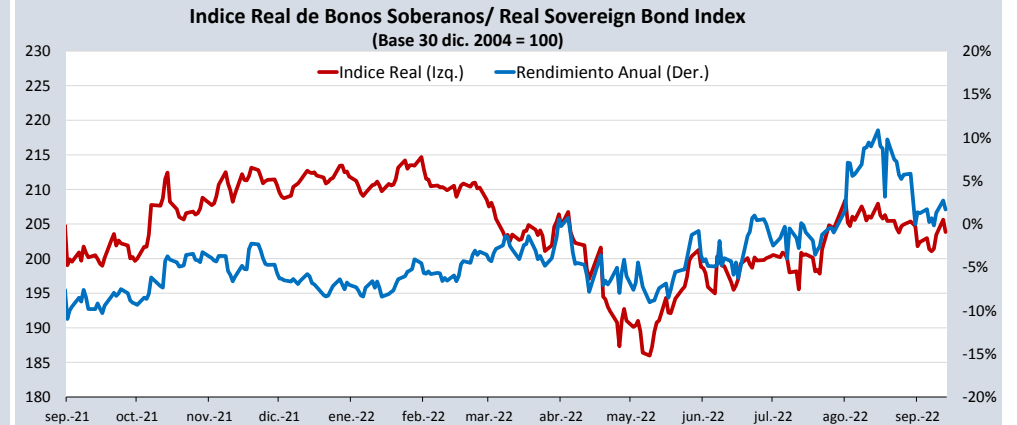
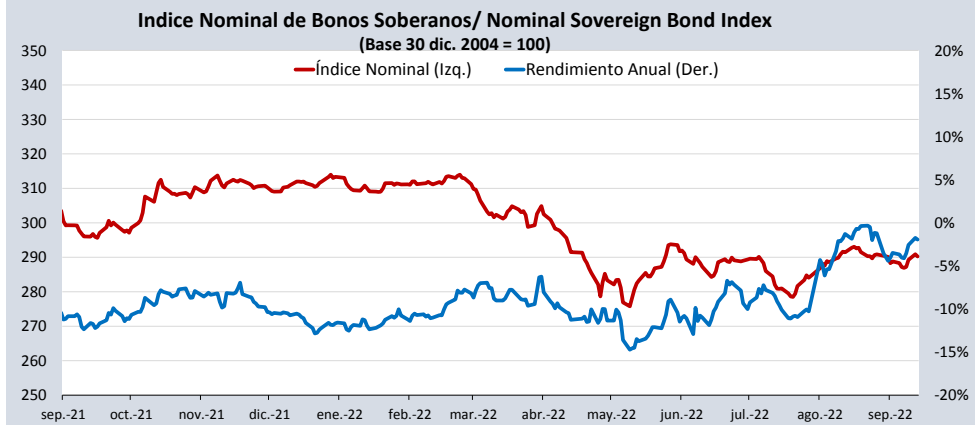
Bonos globales**** / Global bonds

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	107,3930	-0,45	-0,12	-0,52	4,5510	16	3	19	2,61	2,55	2,89
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,4570	-0,62	-0,04	-0,49	4,5140	21	2	17	3,23	3,16	3,41
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,1600	0,21	0,24	-0,62	3,0120	-7	-8	20	3,24	3,19	3,43
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,8120	-0,88	0,41	-0,56	4,6250	20	-9	13	4,51	4,41	5,02
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	86,0500	-1,17	0,39	-0,36	5,0360	20	-6	6	6,90	6,73	7,88
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,3630	-0,01	-0,37	-0,79	4,0050	0	6	13	6,48	6,35	7,49
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	83,9580	-1,33	0,35	-0,41	5,1710	22	-5	7	7,39	7,20	8,48
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	75,3130	-1,07	0,67	-0,56	4,9740	16	-9	8	9,12	8,90	10,37
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	127,7840	-1,40	-0,31	-0,75	5,4050	14	3	8	7,67	7,47	11,35
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	73,0760	-0,05	-0,01	-0,84	4,5320	1	1	12	9,73	9,51	10,64
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	80,5870	-1,26	0,60	0,66	5,3000	17	-8	9	9,41	9,16	11,51
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	70,3410	0,07	0,05	-0,92	4,9010	-1	0	11	11,92	11,63	14,39
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	108,3740	-1,49	0,79	-0,73	5,6940	14	-8	7	9,50	9,24	14,71
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	74,8400	-1,31	0,68	-0,86	5,4820	14	-7	9	13,15	12,79	18,76
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	101,6540	-1,88	0,15	-0,64	5,5080	13	-1	4	14,31	13,93	28,59
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	73,0630	-1,47	0,71	-0,92	5,4160	13	-6	8	16,23	15,80	28,90
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,3890	-1,52	0,65	-0,63	5,1660	13	-6	6	19,09	18,61	38,78
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	66,7260	-1,50	0,68	-0,87	5,5910	12	-6	7	18,15	17,66	50,06
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	60,1140	-1,60	0,40	-0,66	5,3910	14	-4	6	19,10	18,60	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	290	-1	3	-1,95	-20	209	0,00	5,68	11,25	12,81	13,46	13,14	12,54	7,92	12,70	5,39	3,46	1,64

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	204	-2	2	1,67	-106	144	31,76	2,29	37,63	6,12	12,34	9,86



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