



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

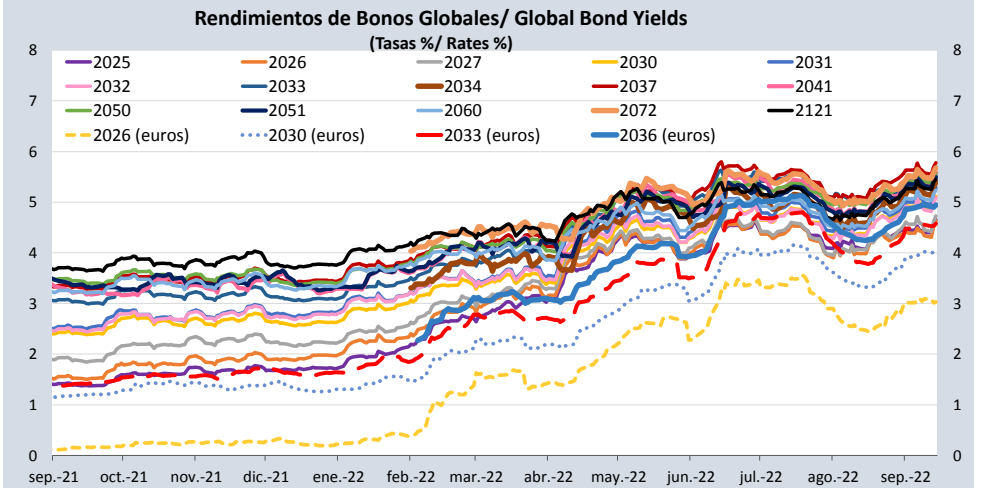
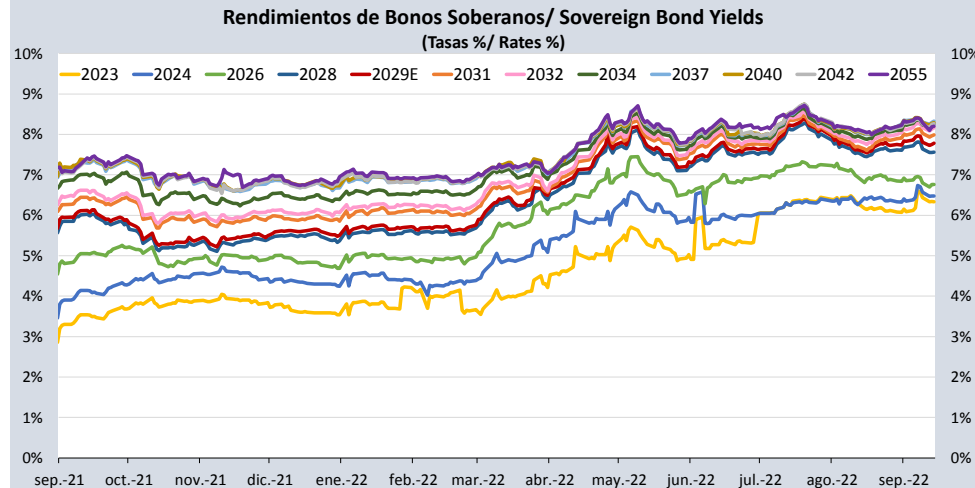
14/09/2022

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 /	Duración /	Vida media
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic				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	Años / Years
			Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask													
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	0,29	1 309	5,200	-	-	-	98,9287	-	-	-	6,3377	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,99
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	5,11	6.741	5,700	-	-	-	98,6329	-	-	-	6,4729	-	09-sep-22	1	1,86	1,75	1,91
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	7,35	12 517	8,200	104,86	104,89	104,86	104,9145	6,77	6,76	6,77	6,7583	27	14-sep-22	125	3,46	3,25	3,91
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	5,69	15 726	6,350	94,35	94,39	94,39	94,4214	7,58	7,57	7,57	7,5612	13	14-sep-22	151	5,03	4,68	5,91
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	53,27	17 129	5,940	91,03	91,07	90,98	90,9626	7,77	7,76	7,78	7,7811	38	14-sep-22	97	5,41	5,02	6,41
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	6,23	15 866	6,950	93,68	93,74	93,80	93,7028	7,99	7,98	7,97	7,9850	14	14-sep-22	32	6,76	6,26	8,91
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	5,52	16 297	6,150	86,70	86,76	86,70	86,7158	8,17	8,16	8,17	8,1661	60	14-sep-22	201	7,43	6,87	9,91
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	4,84	11 689	5,400	78,80	78,92	78,80	78,8335	8,27	8,25	8,27	8,2622	13	14-sep-22	46	8,57	7,92	11,91
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	6,19	16 180	6,900	88,18	88,25	88,25	88,2445	8,34	8,33	8,33	8,3306	42	14-sep-22	187	9,24	8,53	14,91
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	4,80	8 566	5,350	72,99	73,06	73,14	73,1205	8,31	8,30	8,29	8,2908	13	14-sep-22	76	10,68	9,86	17,91
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	6,14	4 610	6,850	-	-	-	86,7734	-	-	-	8,2664	-	13-sep-22	1	10,48	9,68	19,41
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	6,02	2 272	6,714	-	-	-	83,6012	-	-	-	8,2005	-	12-sep-22	2	12,25	11,33	32,41
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	50,07	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,8970	-	-	-	2,8737	-	09-sep-22	2	1,96	1,90	2,08
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,41	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,6467	-	-	-	4,1928	-	05-ago-22	10	6,77	6,50	7,41
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	15,68	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	126,0395	-	-	-	4,5891	-	10-jun-22	10	8,87	8,48	12,38
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,71	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,3476	-	-	-	4,6128	-	15-jun-21	19	13,22	12,63	17,41
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	5,79	695	3,83% + VAC	-	-	-	89,2115	-	-	-	4,5608	-	21-jul-22	2	15,51	14,83	23,91
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,86	492	3,26%+VAC	-	-	-	78,7926	-	-	-	4,5241	-	12-ago-21	10	18,48	17,68	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

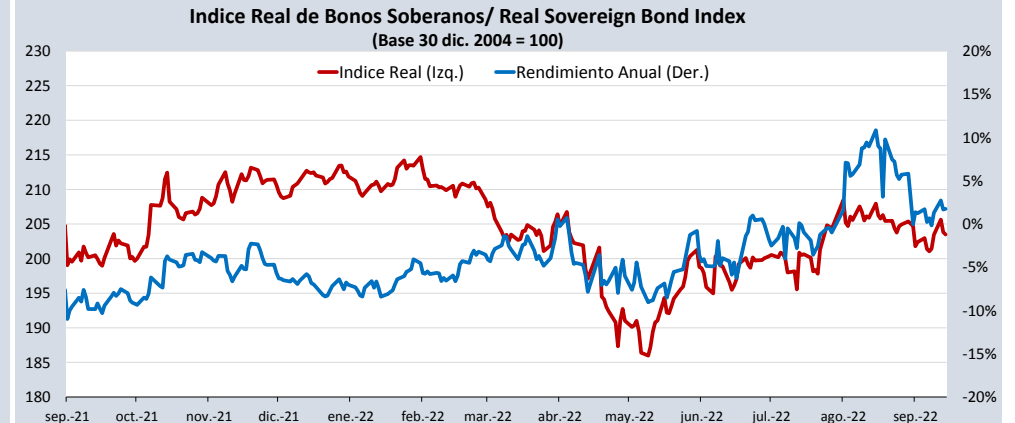
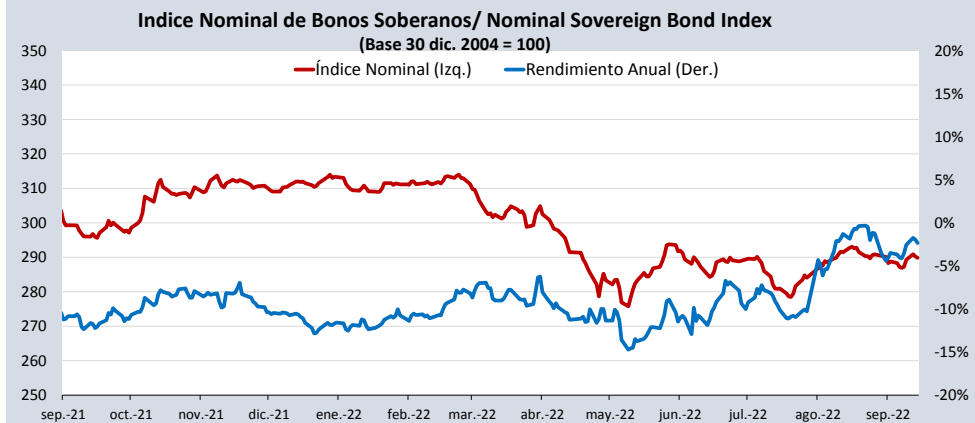
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	107,1040	-0,29	-0,63	-0,43	4,6540	10	21	16	2,61	2,55	2,89
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	93,1060	-0,35	-0,56	-0,53	4,6350	12	20	18	3,23	3,16	3,41
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	99,1040	-0,06	0,23	-0,62	3,0300	2	-7	20	3,24	3,19	3,43
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,3620	-0,45	-0,62	-0,54	4,7290	10	14	13	4,51	4,40	5,02
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	85,5890	-0,46	-0,73	-0,43	5,1160	8	13	7	6,90	6,72	7,88
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	98,2000	-0,16	-0,38	-0,79	4,0310	3	6	13	6,47	6,35	7,49
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	83,2660	-0,69	-1,15	-0,56	5,2870	12	19	9	7,38	7,19	8,48
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	74,5450	-0,77	-0,95	-0,63	5,0900	12	15	9	9,11	8,88	10,36
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	126,5840	-1,20	-1,70	-0,95	5,5290	12	17	10	7,65	7,44	11,35
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	72,7900	-0,29	-0,22	-0,98	4,5750	4	4	14	9,72	9,50	10,64
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	79,8750	-0,71	-0,76	0,63	5,3970	10	11	9	9,39	9,15	11,50
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	69,9960	-0,34	-0,23	-0,90	4,9440	4	3	11	11,91	11,62	14,38
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	107,5180	-0,86	-1,15	-0,91	5,7770	8	11	9	9,77	9,49	14,71
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	73,9030	-0,94	-0,92	-0,81	5,5810	10	10	9	13,10	12,75	18,76
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	100,8450	-0,81	-1,44	-0,74	5,5650	6	10	5	14,25	13,87	28,59
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	72,1880	-0,88	-0,69	-0,92	5,4930	8	6	8	16,14	15,71	28,90
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,5970	-0,79	-1,30	-0,91	5,2360	7	11	8	18,96	18,48	38,77
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	65,6980	-1,03	-1,10	-0,99	5,6790	9	9	9	17,95	17,45	50,06
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	59,4790	-0,63	-1,38	-0,83	5,4480	6	12	8	18,90	18,40	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	0	3	-2,34	-39	177	0,00	5,69	11,26	12,84	13,48	13,14	12,53	7,92	12,69	5,38	3,44	1,63

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	203	0	2	1,76	9	108	31,83	2,29	37,57	6,12	12,34	9,85



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)