



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

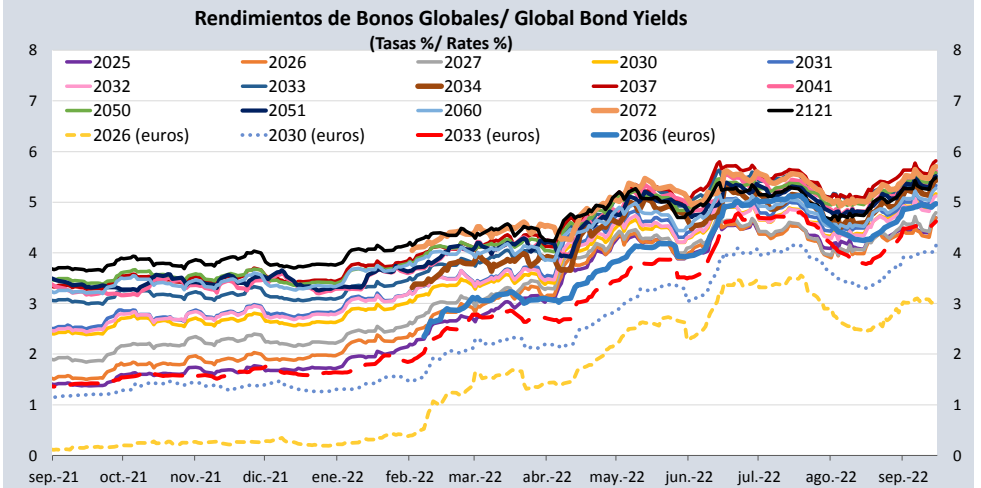
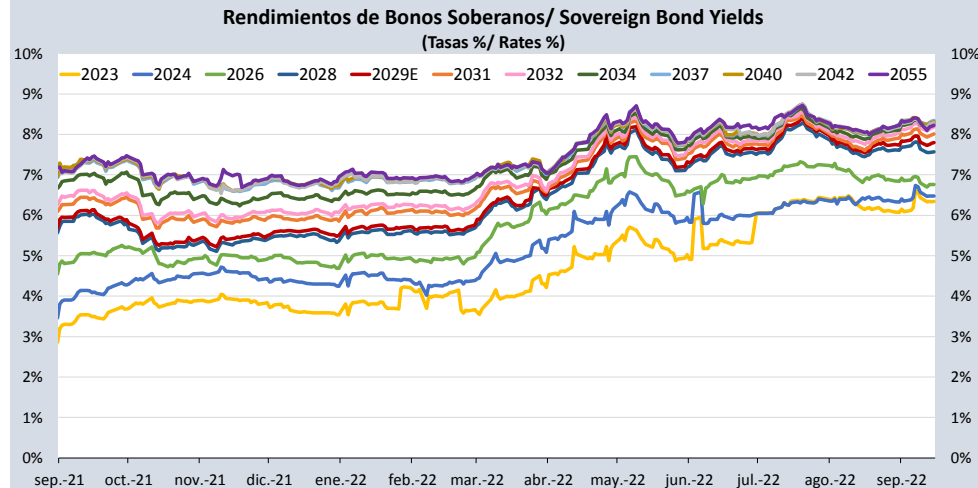
15/09/2022

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	0,43	1 309	5,200	-	-	-	98,9293	-	-	-	6,3398	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,99
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	5,27	6.741	5,700	-	-	-	98,6310	-	-	-	6,4750	-	09-sep-22	1	1,86	1,75	1,91
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	7,58	12 517	8,200	104,79	104,89	104,86	104,9042	6,79	6,76	6,77	6,7604	5	15-sep-22	14	3,46	3,24	3,91
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	5,87	15 726	6,350	94,35	94,39	94,35	94,3812	7,58	7,57	7,58	7,5707	28	15-sep-22	248	5,03	4,68	5,91
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	54,88	17 129	5,940	91,03	91,08	91,03	90,8869	7,77	7,76	7,77	7,7982	31	15-sep-22	87	5,41	5,02	6,41
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	6,42	15 866	6,950	93,62	93,62	93,50	93,5624	8,00	8,00	8,02	8,0090	26	15-sep-22	97	6,76	6,26	8,91
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	5,68	16 297	6,150	86,65	86,68	86,59	86,5871	8,18	8,18	8,19	8,1880	31	15-sep-22	195	7,42	6,86	9,91
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	4,99	11 689	5,400	78,74	78,80	78,68	78,6696	8,28	8,27	8,29	8,2888	9	15-sep-22	18	8,56	7,91	11,91
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	6,37	16 180	6,900	88,10	88,18	88,10	88,1577	8,35	8,34	8,35	8,3422	17	15-sep-22	140	9,23	8,52	14,91
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	4,94	8 566	5,350	72,85	72,92	72,92	72,9585	8,33	8,32	8,32	8,3134	15	15-sep-22	36	10,67	9,85	17,91
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	6,33	4 610	6,850	-	-	-	86,5834	-	-	-	8,2890	-	13-sep-22	1	10,52	9,73	19,41
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	6,20	2 272	6,714	-	-	-	83,3870	-	-	-	8,2231	-	12-sep-22	2	12,24	11,32	32,41
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	50,41	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,8826	-	-	-	2,8758	-	09-sep-22	2	1,95	1,90	2,08
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,51	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,5349	-	-	-	4,2120	-	05-ago-22	10	6,76	6,49	7,41
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	16,03	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,7825	-	-	-	4,6126	-	10-jun-22	10	8,87	8,47	12,38
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,82	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,1400	-	-	-	4,6329	-	15-jun-21	19	13,21	12,62	17,41
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	5,97	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,9233	-	-	-	4,5826	-	21-jul-22	2	15,49	14,81	23,91
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	3,98	492	3,26%+VAC	-	-	-	78,4895	-	-	-	4,5459	-	12-ago-21	10	18,45	17,65	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, BLOMBERG, DATATEC.

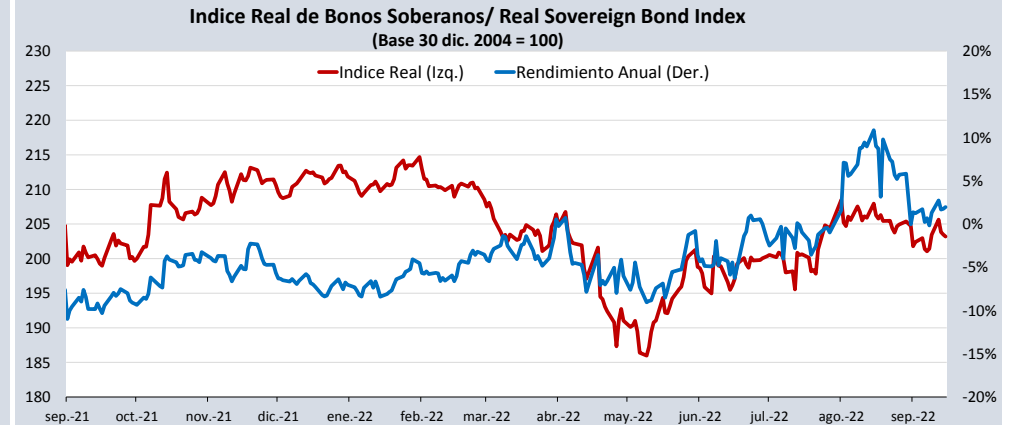
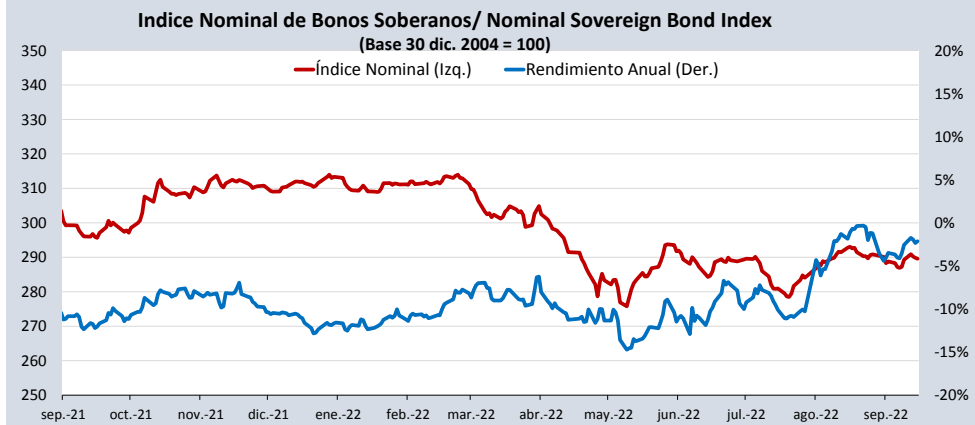
Bonos globales**** / Global bonds

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	106,9880	-0,12	-0,75	-0,51	4,6890	4	26	19	2,61	2,55	2,89
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,9610	-0,14	-0,78	-0,58	4,6900	6	28	20	3,23	3,15	3,41
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,9010	-0,20	-0,17	-0,58	3,0960	7	5	19	3,23	3,19	3,43
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,0840	-0,28	-0,95	-0,45	4,7950	7	22	11	4,51	4,40	5,01
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	85,3160	-0,27	-1,31	-0,37	5,1660	5	23	6	6,89	6,72	7,88
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	97,5000	-0,70	-1,01	-0,83	4,1440	11	16	13	6,47	6,34	7,48
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	83,0030	-0,26	-1,64	-0,47	5,3330	5	28	8	7,37	7,18	8,48
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	74,3460	-0,20	-1,41	-0,56	5,1220	3	22	9	9,10	8,88	10,36
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	126,2050	-0,38	-2,43	-0,95	5,5670	4	25	10	7,64	7,44	11,35
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	72,4980	-0,29	-0,32	-0,91	4,6200	4	5	14	9,72	9,50	10,64
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	79,6190	-0,26	-1,44	0,71	5,4330	4	20	10	9,39	9,14	11,50
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	69,8000	-0,20	-0,17	-0,86	4,9700	3	2	11	11,90	11,61	14,38
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	107,1150	-0,40	-1,95	-0,72	5,8160	4	19	7	9,75	9,48	14,71
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	73,5760	-0,33	-1,72	-0,81	5,6160	3	18	9	13,09	12,73	18,76
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	100,5430	-0,30	-2,13	-0,90	5,5860	2	15	6	14,23	13,84	28,59
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	71,9230	-0,27	-1,68	-0,86	5,5160	2	15	8	16,12	15,68	28,90
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,1980	-0,40	-2,14	-0,82	5,2720	4	19	7	18,89	18,40	38,77
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	65,4070	-0,29	-1,98	-0,96	5,7040	2	17	8	17,89	17,39	50,05
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	59,1120	-0,37	-2,06	-0,75	5,4820	3	18	7	18,79	18,29	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	2	-2,14	20	140	0,00	5,70	11,28	12,86	13,48	13,15	12,52	7,91	12,67	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	1,97	21	213	31,88	2,29	37,56	6,12	12,32	9,83



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