



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

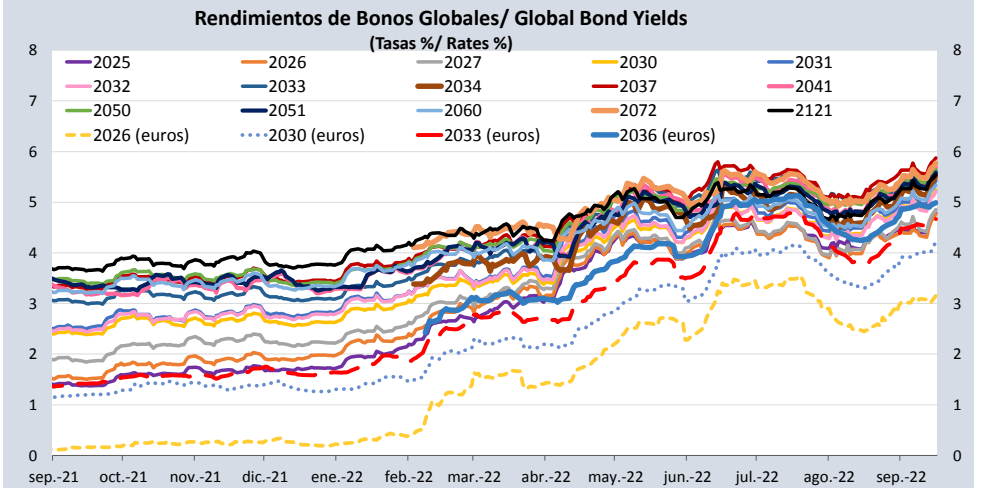
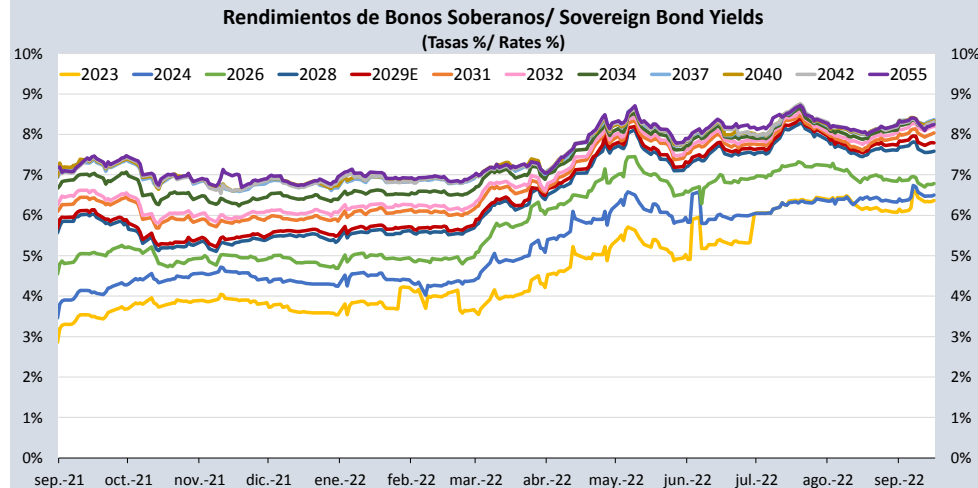
16/09/2022

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	0,57	1 309	5,200	-	-	-	98,9074	-	-	-	6,3663	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,99
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	5,42	6.741	5,700	-	-	-	98,5872	-	-	-	6,5015	-	09-sep-22	1	1,86	1,75	1,91
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	7,80	12 517	8,200	104,72	104,75	104,75	104,8105	6,81	6,80	6,80	6,7869	5	16-sep-22	4	3,46	3,24	3,91
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	6,04	15 726	6,350	94,26	94,31	94,26	94,3210	7,60	7,59	7,60	7,5847	28	16-sep-22	83	5,03	4,67	5,91
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	56,50	17 129	5,940	90,90	90,94	90,94	90,9344	7,80	7,79	7,79	7,7885	31	16-sep-22	53	5,40	5,01	6,41
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	6,61	15 866	6,950	93,39	93,45	93,45	93,4024	8,04	8,03	8,03	8,0364	26	16-sep-22	11	6,75	6,25	8,91
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	5,85	16 297	6,150	86,53	86,59	86,59	86,5613	8,20	8,19	8,19	8,1927	31	16-sep-22	268	7,42	6,86	9,91
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	5,14	11 689	5,400	78,62	78,68	78,68	78,6562	8,30	8,29	8,29	8,2914	9	16-sep-22	121	8,56	7,90	11,91
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	6,56	16 180	6,900	87,95	88,03	87,95	87,9849	8,37	8,36	8,37	8,3652	17	16-sep-22	240	9,22	8,51	14,91
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	5,09	8 566	5,350	72,81	72,85	72,85	72,8151	8,34	8,33	8,33	8,3335	15	16-sep-22	80	10,65	9,83	17,91
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	6,52	4 610	6,850	-	-	-	86,4150	-	-	-	8,3091	-	13-sep-22	1	10,52	9,73	19,41
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	6,39	2 272	6,714	-	-	-	83,1972	-	-	-	8,2432	-	12-sep-22	2	12,24	11,32	32,41
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	50,74	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,8189	-	-	-	2,9014	-	09-sep-22	2	1,95	1,90	2,08
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,61	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,5078	-	-	-	4,2170	-	05-ago-22	10	6,76	6,49	7,41
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	16,39	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	125,7182	-	-	-	4,6182	-	10-jun-22	10	8,86	8,47	12,38
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	3,93	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,9352	-	-	-	4,6528	-	15-jun-21	19	13,20	12,61	17,41
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	6,14	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,6667	-	-	-	4,6021	-	21-jul-22	2	15,47	14,79	23,91
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	4,10	492	3,26%+VAC	-	-	-	78,2213	-	-	-	4,5653	-	12-ago-21	10	18,42	17,62	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.

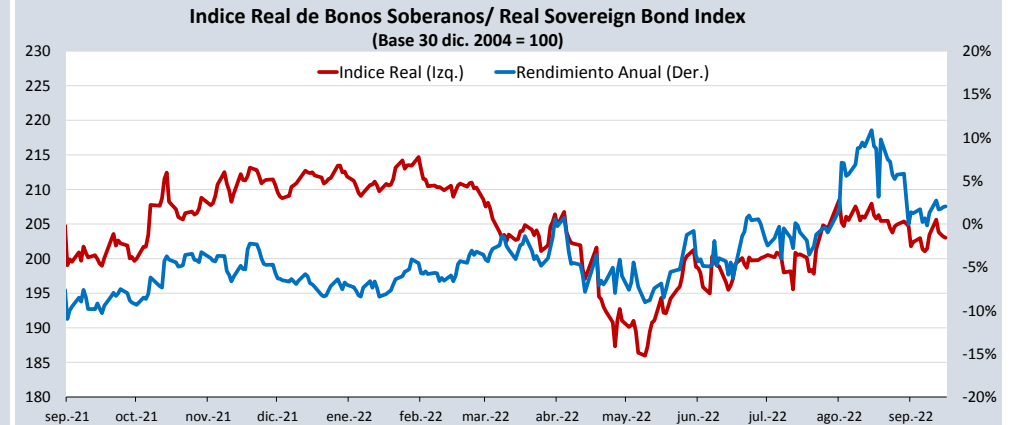
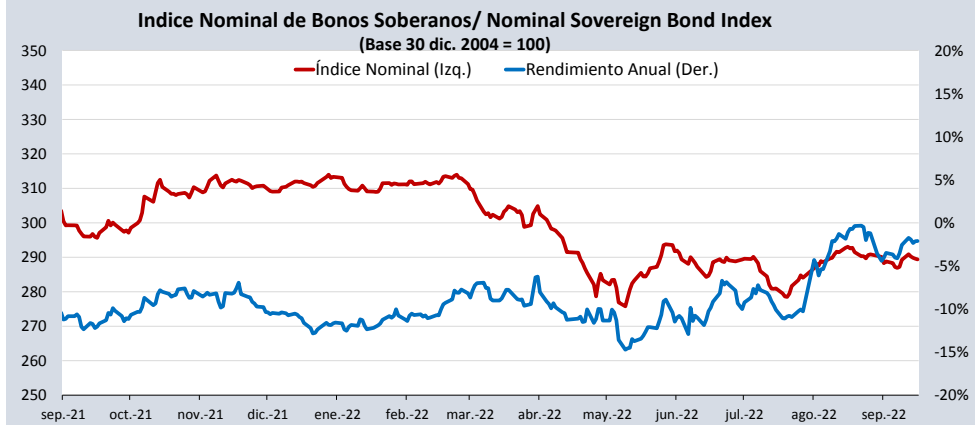
Bonos globales**** / Global bonds

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	106,7150	-0,27	-1,11	-0,42	4,7860	10	38	15	2,60	2,54	2,89
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,7270	-0,23	-1,24	-0,58	4,7710	8	43	20	3,23	3,15	3,40
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,7130	-0,19	-0,20	-0,63	3,1560	6	6	20	3,23	3,18	3,42
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	96,8360	-0,25	-1,72	-0,52	4,8540	6	40	12	4,50	4,40	5,01
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	84,8900	-0,43	-2,13	-0,35	5,2410	7	37	6	6,89	6,71	7,87
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	97,1410	-0,36	-1,11	-0,84	4,2020	6	18	14	6,46	6,33	7,48
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	82,4140	-0,59	-2,69	-0,57	5,4320	10	45	10	7,37	7,17	8,48
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	73,7610	-0,59	-2,44	-0,57	5,2110	9	37	9	9,09	8,86	10,36
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	125,5580	-0,65	-3,41	-0,83	5,6340	7	35	9	7,63	7,42	11,34
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	72,1930	-0,31	-0,72	-0,93	4,6660	5	11	14	9,71	9,49	10,64
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	78,9700	-0,65	-2,61	0,65	5,5230	9	36	9	9,37	9,12	11,50
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	69,6370	-0,16	-0,33	-0,91	4,9910	2	4	11	11,89	11,60	14,38
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	106,5200	-0,59	-3,09	-0,79	5,8750	6	30	8	9,74	9,46	14,70
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	72,8940	-0,68	-2,87	-0,83	5,6900	7	30	9	13,05	12,69	18,75
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	99,7790	-0,76	-3,33	-0,78	5,6400	5	23	6	14,17	13,79	28,58
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	71,2010	-0,72	-2,97	-0,88	5,5810	7	26	8	16,05	15,61	28,89
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,5960	-0,60	-3,00	-0,87	5,3270	5	27	8	18,79	18,30	38,77
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	64,6020	-0,80	-3,35	-0,96	5,7750	7	29	9	17,72	17,23	50,05
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	58,5100	-0,60	-2,93	-0,76	5,5380	6	26	7	18,60	18,10	100,30

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	289	0	0	-2,11	3	45	0,00	5,70	11,29	12,87	13,48	13,14	12,51	7,90	12,67	5,37	3,43	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	0	2,04	7	74	31,90	2,30	37,59	6,11	12,30	9,81



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