



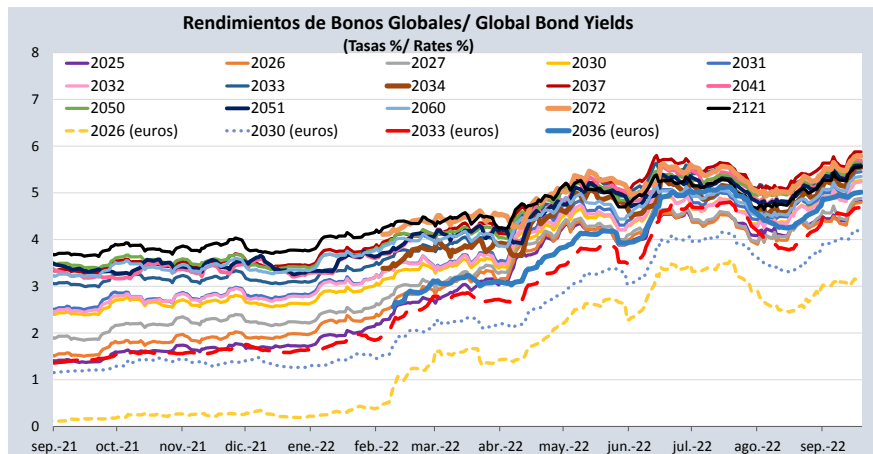
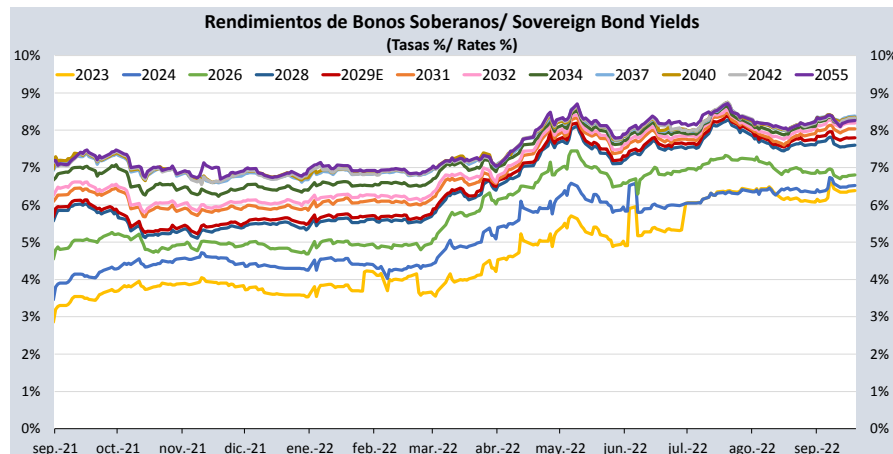
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

19/09/2022

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	1,01	1 309	5,200	-	-	-	98,8997	-	-	-	6,3833	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,98
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	5,89	6.741	5,700	-	-	-	98,5636	-	-	-	6,5185	-	19-sep-22	1	1,84	1,73	1,90
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	8,47	12 517	8,200	104,71	104,78	104,75	104,7434	6,81	6,79	6,80	6,8039	10	19-sep-22	33	3,45	3,23	3,90
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	6,56	15 726	6,350	94,27	94,31	94,27	94,2625	7,60	7,59	7,60	7,5993	11	19-sep-22	28	5,02	4,66	5,90
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	61,34	17 129	5,940	90,85	90,95	90,90	90,8863	7,81	7,79	7,80	7,8009	11	19-sep-22	22	5,40	5,01	6,40
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	7,18	15 866	6,950	93,33	93,39	93,39	93,3864	8,05	8,04	8,04	8,0398	10	19-sep-22	44	6,74	6,24	8,90
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	6,35	16 297	6,150	86,53	86,59	86,59	86,5511	8,20	8,19	8,19	8,1956	11	19-sep-22	69	7,41	6,85	9,90
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	5,58	11 689	5,400	78,59	78,62	78,56	78,5922	8,31	8,30	8,31	8,3030	37	19-sep-22	191	8,55	7,89	11,90
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	7,13	16 180	6,900	87,80	87,96	87,88	87,8531	8,39	8,37	8,38	8,3831	15	19-sep-22	34	9,21	8,50	14,90
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	5,52	8 566	5,350	72,71	72,78	72,71	72,7016	8,35	8,34	8,35	8,3500	2	19-sep-22	4	10,64	9,82	17,90
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	7,07	4 610	6,850	-	-	-	86,2788	-	-	-	8,3256	-	13-sep-22	1	10,47	9,68	19,40
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	6,93	2 272	6,714	-	-	-	83,0425	-	-	-	8,2597	-	12-sep-22	2	12,23	11,31	32,40
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	51,76	1.498	6,84% + VAC	108,0129	108,18	108,08	108,1276	2,78	2,70	2,75	2,7400	2	19-sep-22	28	1,94	1,89	2,07
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	3,93	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,7309	-	-	-	4,1809	-	05-ago-22	10	6,75	6,48	7,40
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	17,44	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	126,0569	-	-	-	4,5855	-	10-jun-22	10	8,86	8,47	12,37
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	4,27	292	3,14%+VAC	-	-	-	82,2389	-	-	-	4,6241	-	15-jun-21	19	13,20	12,61	17,40
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	6,68	695	3,83% + VAC	-	-	-	89,0505	-	-	-	4,5732	-	21-jul-22	2	15,48	14,81	23,90
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	4,45	492	3,26%+VAC	-	-	-	78,6237	-	-	-	4,5365	-	12-ago-21	10	18,45	17,65	31,40

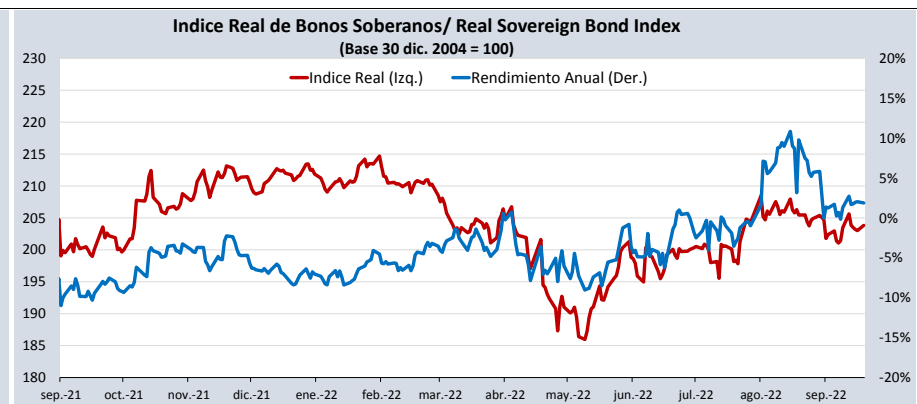
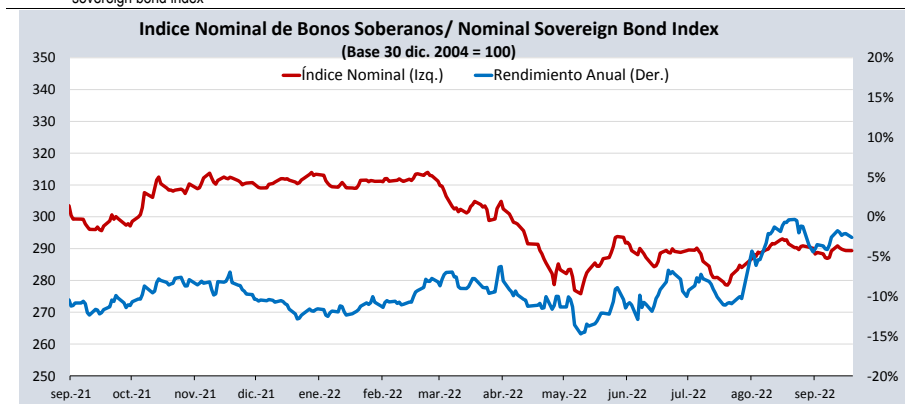
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).  
 Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in 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	106,6070	-0,11	-1,23	-0,44	4,8230	4	43	16	2,60	2,53	2,88
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,6660	-0,06	-1,41	-0,52	4,7940	2	49	18	3,22	3,14	3,39
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,8440	0,13	-0,11	-0,65	3,1150	-4	4	21	3,22	3,17	3,41
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	96,7130	-0,12	-1,98	-0,52	4,8830	3	46	12	4,49	4,39	5,00
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	84,7610	-0,13	-2,46	-0,48	5,2640	2	43	8	6,88	6,70	7,86
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	97,3370	0,20	-1,04	-0,75	4,1710	-3	17	12	6,46	6,32	7,47
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	82,2940	-0,12	-3,00	-0,55	5,4530	2	50	9	7,36	7,16	8,47
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	73,6190	-0,14	-2,76	-0,60	5,2340	2	42	9	9,08	8,85	10,35
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	125,4180	-0,14	-3,77	-0,93	5,6480	1	39	10	7,62	7,41	11,34
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	72,0620	-0,13	-1,06	-0,89	4,6870	2	16	13	9,70	9,48	10,63
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	78,7840	-0,19	-3,06	0,67	5,5490	3	42	9	9,36	9,11	11,49
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	69,4670	-0,17	-0,80	-0,90	5,0130	2	10	11	11,88	11,59	14,37
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	106,5400	0,02	-3,33	-0,86	5,8730	0	32	9	9,73	9,45	14,69
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	72,8660	-0,03	-3,28	-0,84	5,6930	0	35	9	13,04	12,68	18,74
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	99,7980	0,02	-3,73	-0,83	5,6390	0	26	6	14,17	13,78	28,58
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	71,1280	-0,07	-3,41	-0,92	5,5870	1	30	8	16,03	15,60	28,89
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,4090	-0,19	-3,50	-0,82	5,3450	2	31	8	18,74	18,26	38,76
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	64,4870	-0,12	-3,73	-0,98	5,7850	1	32	9	17,69	17,19	50,04
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	58,3700	-0,14	-3,35	-0,87	5,5510	1	30	8	18,55	18,05	100,29

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	-2	-2,60	-49	-85	0,00	5,71	11,29	12,87	13,50	13,13	12,52	7,90	12,66	5,36	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	204	1	-2	1,88	-16	-85	31,89	2,29	37,57	6,11	12,31	9,82						



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)