



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

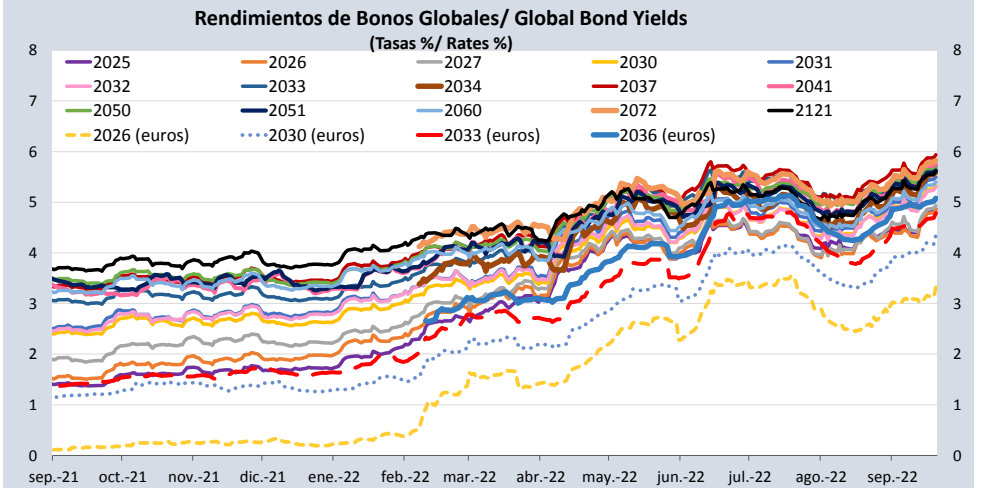
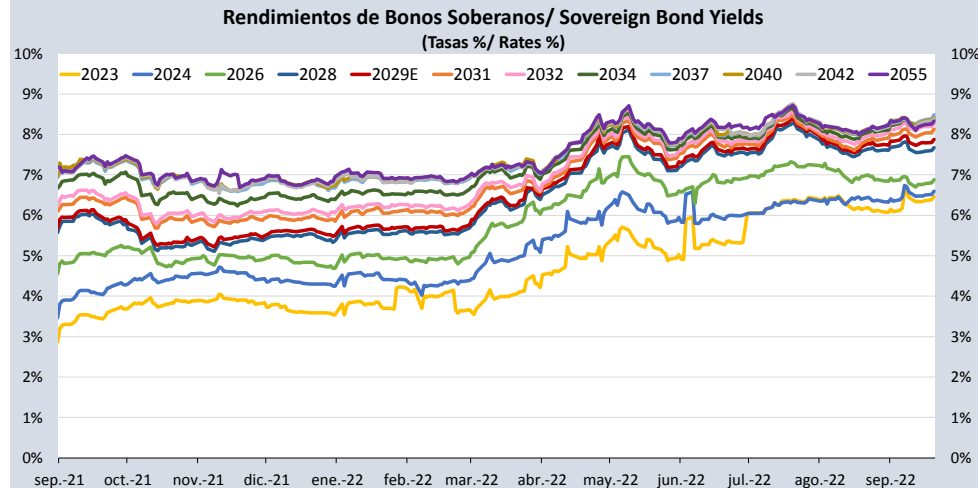
20/09/2022

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	1,15	1 309	5,200	-	-	-	98,8341	-	-	-	6,4583	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,98
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	6,04	6.741	5,700	-	-	-	98,4373	-	-	-	6,5935	-	19-sep-22	1	1,84	1,73	1,89
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	8,69	12 517	8,200	-	-	-	104,4852	-	-	-	6,8789	-	19-sep-22	33	3,45	3,22	3,89
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	6,73	15 726	6,350	93,83	93,87	93,83	93,9334	7,70	7,69	7,70	7,6743	13	20-sep-22	30	5,01	4,66	5,89
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	62,95	17 129	5,940	90,49	90,54	90,45	90,5476	7,89	7,88	7,90	7,8756	14	20-sep-22	63	5,39	5,00	6,39
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	7,37	15 866	6,950	92,81	92,86	92,81	92,8576	8,14	8,13	8,14	8,1304	16	20-sep-22	29	6,73	6,23	8,89
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	6,52	16 297	6,150	86,06	86,09	86,09	86,0907	8,28	8,28	8,28	8,2734	33	20-sep-22	162	7,40	6,83	9,89
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	5,72	11 689	5,400	78,06	78,09	78,06	78,0868	8,39	8,39	8,39	8,3847	29	20-sep-22	114	8,53	7,87	11,89
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	7,31	16 180	6,900	87,21	87,24	87,24	87,1054	8,47	8,47	8,47	8,4832	18	20-sep-22	111	9,18	8,46	14,89
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	5,67	8 566	5,350	72,21	72,35	72,28	72,2373	8,42	8,40	8,41	8,4151	16	20-sep-22	55	10,61	9,79	17,89
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	7,26	4 610	6,850	-	-	-	85,7368	-	-	-	8,3907	-	13-sep-22	1	10,44	9,64	19,39
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	7,11	2 272	6,714	-	-	-	82,4348	-	-	-	8,3248	-	12-sep-22	2	12,18	11,26	32,39
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	52,09	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,5941	-	-	-	2,9902	-	19-sep-22	28	1,94	1,88	2,06
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,03	98	2,89%+VAC	-	-	-	91,0040	-	-	-	4,3038	-	05-ago-22	10	6,75	6,47	7,39
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	17,80	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	124,7011	-	-	-	4,7120	-	10-jun-22	10	8,83	8,44	12,36
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	4,39	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,0706	-	-	-	4,7375	-	15-jun-21	19	13,16	12,56	17,39
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	6,85	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,6404	-	-	-	4,6809	-	21-jul-22	2	15,40	14,72	23,89
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	4,57	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,1443	-	-	-	4,6442	-	12-ago-21	10	18,31	17,50	31,39

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

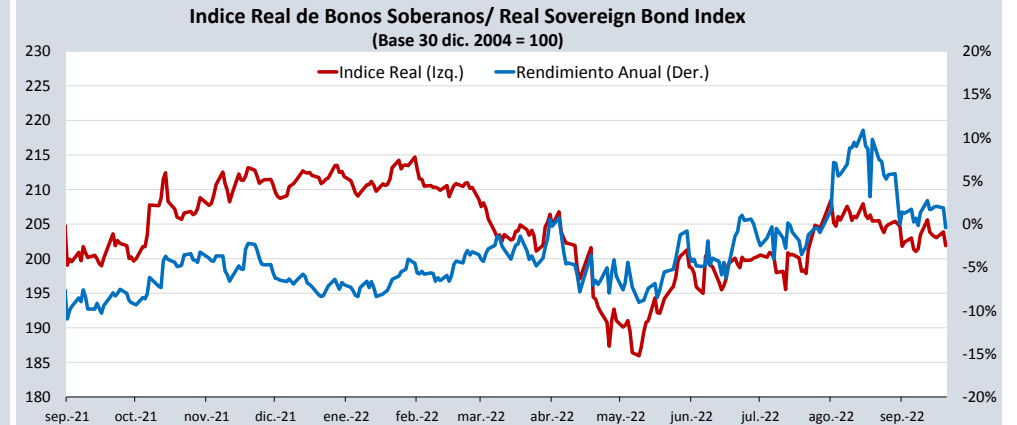
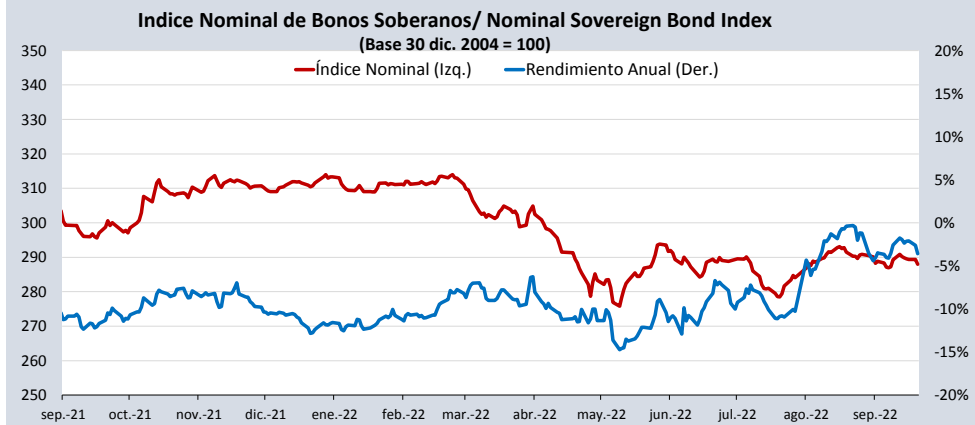
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid- ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	106,4890	-0,12	-0,90	-0,44	4,8650	4	31	16	2,59	2,53	2,88
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,4860	-0,18	-0,97	-0,53	4,8580	6	34	18	3,21	3,14	3,39
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,1670	-0,68	-0,99	-0,58	3,3330	22	32	19	3,22	3,17	3,41
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	96,5050	-0,21	-1,31	-0,51	4,9320	5	31	12	4,49	4,38	5,00
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	84,4150	-0,35	-1,63	-0,49	5,3250	6	29	9	6,87	6,69	7,86
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	96,1670	-1,17	-2,20	-0,83	4,3610	19	36	14	6,45	6,31	7,47
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	82,0520	-0,24	-1,91	-0,54	5,4950	4	32	9	7,35	7,16	8,46
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	73,1850	-0,43	-2,13	-0,53	5,3010	7	33	8	9,08	8,84	10,35
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	124,9060	-0,51	-2,88	-0,81	5,7020	5	30	9	7,61	7,40	11,33
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	71,4000	-0,66	-1,68	-1,06	4,7870	10	26	16	9,69	9,47	10,63
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	78,4740	-0,31	-2,11	0,65	5,5930	4	29	9	9,35	9,10	11,49
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,9660	-0,50	-1,38	-0,87	5,0760	6	18	11	11,87	11,57	14,37
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	105,8980	-0,64	-2,48	-0,74	5,9370	6	24	7	9,71	9,43	14,69
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	72,4290	-0,44	-2,41	-0,83	5,7410	5	26	9	13,02	12,66	18,74
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	99,3030	-0,50	-2,35	-0,75	5,6740	4	17	5	14,13	13,74	28,57
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	70,7250	-0,40	-2,34	-0,89	5,6240	4	21	8	15,99	15,55	28,88
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,8100	-0,60	-2,58	-0,74	5,4010	6	23	7	18,64	18,15	38,76
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	64,0420	-0,44	-2,68	-0,89	5,8250	4	23	8	17,60	17,10	50,04
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	57,8000	-0,57	-2,31	-0,82	5,6050	5	21	8	18,37	17,87	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	288	-1	-2	-3,60	-100	-165	0,00	5,71	11,29	12,87	13,50	13,14	12,53	7,90	12,65	5,36	3,43	1,62

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	202	-2	-2	-0,44	-232	-211	32,07	2,30	37,56	6,09	12,24	9,74



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)