



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

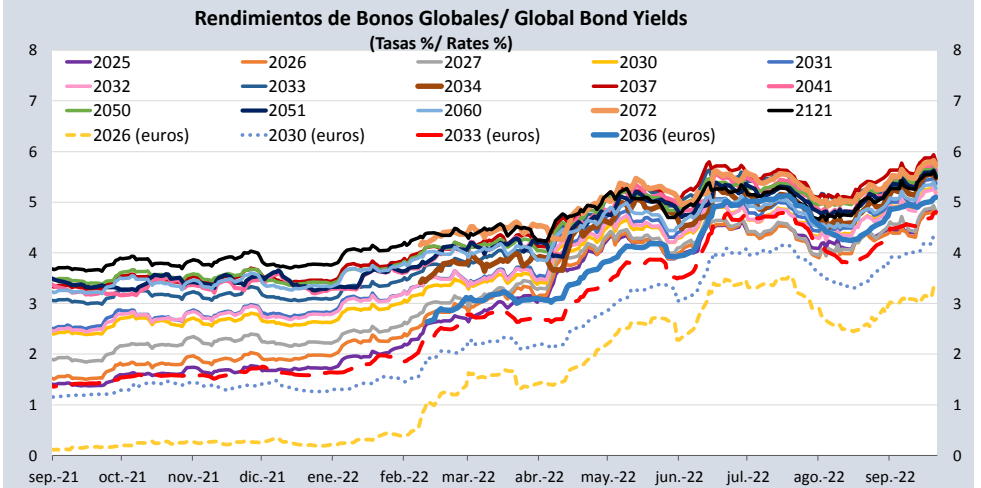
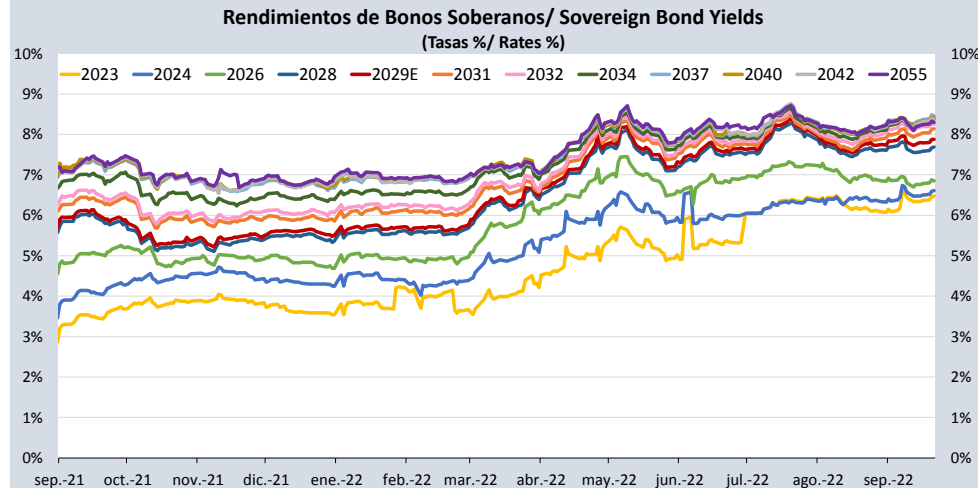
21/09/2022

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	1,29	1 309	5,200	-	-	-	-	-	-	6,4738	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,98	
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	6,20	6.741	5,700	-	-	-	-	-	-	6,6090	-	19-sep-22	1	1,84	1,73	1,89	
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	8,91	12 517	8,200	-	-	-	-	-	-	6,8500	-	19-sep-22	33	3,44	3,22	3,89	
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	6,90	15 726	6,350	93,79	93,83	93,83	93,8674	7,71	7,70	7,70	7,6898	3	21-sep-22	13	5,01	4,65	5,89
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	64,56	17 129	5,940	90,46	90,55	90,52	90,5393	7,90	7,88	7,89	7,8781	29	21-sep-22	211	5,39	4,99	6,39
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	7,55	15 866	6,950	92,81	92,87	92,81	92,8148	8,14	8,13	8,14	8,1380	24	21-sep-22	180	6,73	6,22	8,89
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	6,68	16 297	6,150	86,18	86,18	86,30	86,2118	8,26	8,26	8,24	8,2534	41	21-sep-22	171	7,40	6,83	9,89
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	5,87	11 689	5,400	78,07	78,13	78,26	78,1362	8,39	8,38	8,36	8,3772	18	21-sep-22	143	8,53	7,87	11,89
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	7,50	16 180	6,900	87,14	87,21	87,51	87,3248	8,48	8,47	8,43	8,4539	10	21-sep-22	59	9,19	8,47	14,89
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	5,82	8 566	5,350	-	-	-	72,2398	-	-	-	8,4150	-	20-sep-22	55	10,61	9,79	17,89
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	7,45	4 610	6,850	-	-	-	85,9811	-	-	-	8,3614	-	13-sep-22	1	10,44	9,64	19,39
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	7,30	2 272	6,714	-	-	-	82,7077	-	-	-	8,2955	-	12-sep-22	2	12,18	11,25	32,39
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	52,43	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,5610	-	-	-	3,0015	-	19-sep-22	28	1,94	1,88	2,06
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,13	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,9814	-	-	-	4,3081	-	05-ago-22	10	6,74	6,47	7,39
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	18,15	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	124,8096	-	-	-	4,7014	-	10-jun-22	10	8,83	8,44	12,36
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	4,50	292	3,14%+VAC	-	-	-	81,1226	-	-	-	4,7326	-	15-jun-21	19	13,16	12,56	17,39
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	7,03	695	3,83% + VAC	-	-	-	88,0101	-	-	-	4,6525	-	21-jul-22	2	15,42	14,74	23,89
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	4,69	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,5316	-	-	-	4,6158	-	12-ago-21	10	18,34	17,53	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

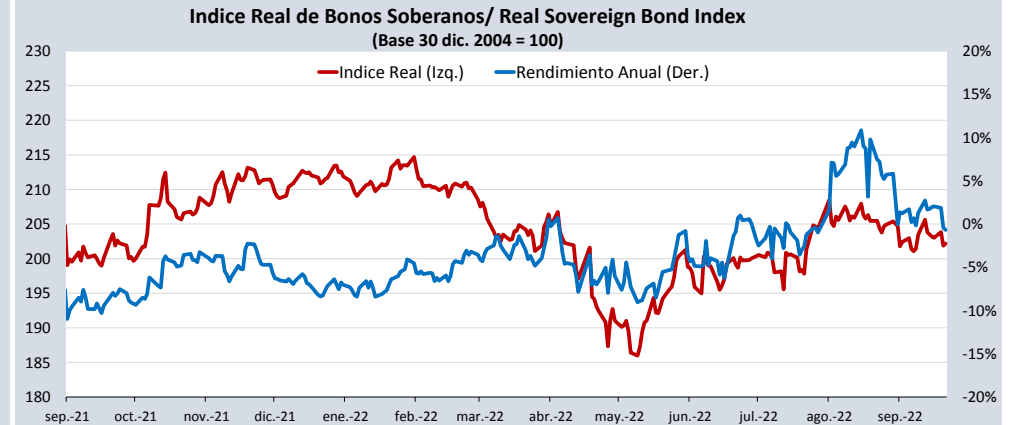
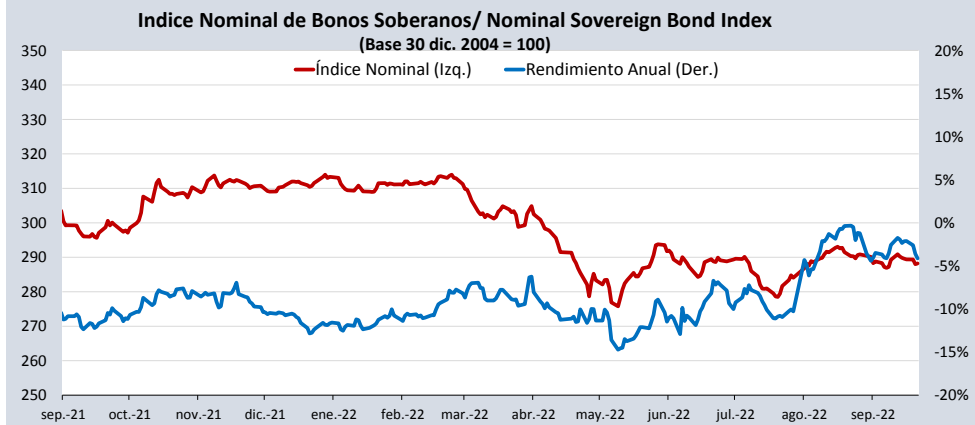
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid- ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	106,6070	0,12	-0,50	-0,40	4,8190	-5	17	15	2,59	2,53	2,87
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,7370	0,25	-0,37	-0,41	4,7740	-8	14	14	3,21	3,14	3,39
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,1420	-0,03	-0,96	-0,58	3,3420	1	31	19	3,22	3,16	3,41
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	97,0170	0,51	-0,34	-0,53	4,8120	-12	8	13	4,49	4,38	5,00
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	85,2160	0,80	-0,37	-0,52	5,1860	-14	7	9	6,87	6,70	7,86
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	96,1250	-0,04	-2,08	-0,83	4,3680	1	34	14	6,44	6,31	7,47
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	82,8090	0,76	-0,46	-0,39	5,3680	-13	8	7	7,36	7,16	8,46
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	74,1800	1,00	-0,36	-0,56	5,1500	-15	6	9	9,08	8,86	10,34
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	126,0020	1,10	-0,58	-0,85	5,5860	-12	6	9	7,62	7,42	11,33
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	71,2760	-0,12	-1,51	-0,88	4,8060	2	23	13	9,69	9,46	10,62
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	79,3290	0,85	-0,55	0,72	5,4750	-12	8	10	9,36	9,11	11,48
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,8060	-0,16	-1,19	-0,84	5,0970	2	15	11	11,86	11,57	14,36
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	107,2310	1,33	-0,29	-0,83	5,8050	-13	3	8	9,74	9,47	14,69
Perú Global 41	US715638DS81	3 300	3,300	73,4140	0,98	-0,49	-0,86	5,6350	-11	5	9	13,06	12,70	18,74
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	100,6490	1,35	-0,20	-0,74	5,5780	-10	1	5	14,22	13,83	28,57
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	71,8680	1,14	-0,32	-0,95	5,5220	-10	3	8	16,09	15,66	28,88
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,1890	1,38	-0,41	-0,84	5,2740	-13	4	8	18,87	18,38	38,75
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1110	1,07	-0,59	-1,02	5,7300	-9	5	9	17,81	17,31	50,04
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	59,1320	1,33	-0,35	-0,86	5,4800	-13	3	8	18,78	18,28	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	0	-2	-4,12	-53	-178	0,00	5,73	11,32	12,89	13,52	13,13	12,52	7,89	12,60	5,35	3,42	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	0	-1	-0,68	-24	-244	32,02	2,30	37,55	6,08	12,28	9,78



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)