



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

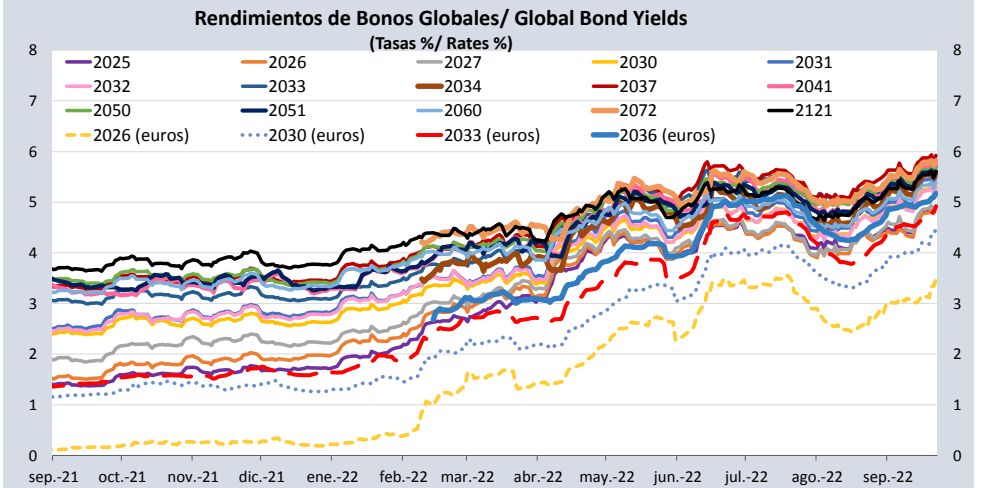
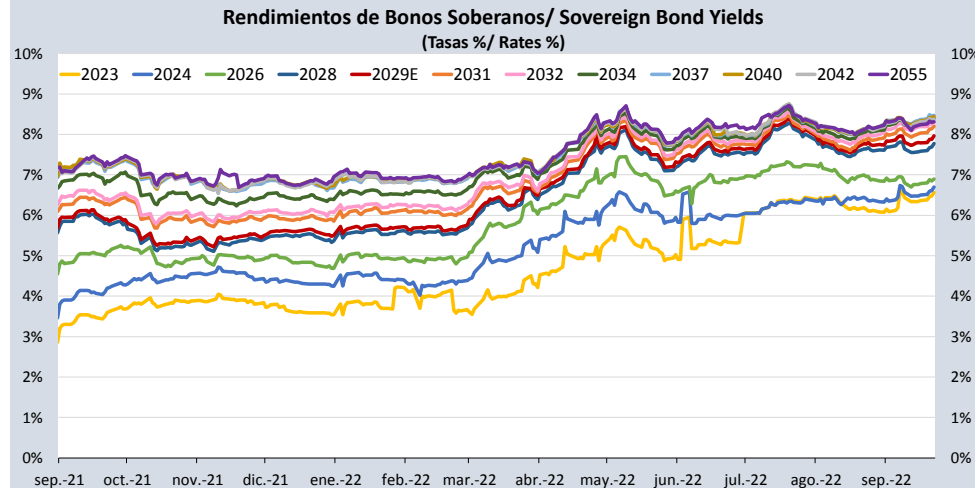
22/09/2022

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 / Duration	Duración / Duración modificada / Modified	Vida media / Average
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	1,44	1 309	5,200	-	-	-	98,7462	-	-	-	6,5618	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,97
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	6,35	6.741	5,700	-	-	-	98,2653	-	-	-	6,6970	-	19-sep-22	1	1,83	1,72	1,89
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	9,14	12 517	8,200	-	-	-	104,4250	-	-	-	6,8950	-	19-sep-22	33	3,44	3,22	3,89
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	7,08	15 726	6,350	93,53	93,57	93,57	93,4836	7,77	7,76	7,76	7,7778	11	22-sep-22	108	5,01	4,64	5,89
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	66,18	17 129	5,940	90,12	90,19	90,19	90,1577	7,98	7,96	7,96	7,9627	11	22-sep-22	52	5,38	4,99	6,39
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	7,74	15 866	6,950	92,52	92,58	92,43	92,4249	8,19	8,18	8,21	8,2054	20	22-sep-22	164	6,72	6,21	8,89
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	6,85	16 297	6,150	86,01	86,13	86,07	85,9412	8,29	8,27	8,28	8,2995	48	22-sep-22	312	7,39	6,82	9,89
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	6,02	11 689	5,400	78,07	78,14	78,07	77,9955	8,39	8,38	8,39	8,4004	36	22-sep-22	248	8,53	7,87	11,89
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	7,69	16 180	6,900	87,14	87,29	87,29	87,1702	8,48	8,46	8,46	8,4748	28	22-sep-22	164	9,18	8,46	14,89
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	5,96	8 566	5,350	71,93	72,43	72,14	72,0638	8,46	8,39	8,43	8,4400	2	22-sep-22	20	10,60	9,77	17,89
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	7,63	4 610	6,850	85,66	87,34	85,83	85,8271	8,40	8,20	8,38	8,3800	1	22-sep-22	2	10,40	9,59	19,39
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	7,48	2 272	6,714	-	-	-	82,5346	-	-	-	8,3141	-	12-sep-22	2	12,18	11,25	32,39
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	52,77	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,3821	-	-	-	3,0831	-	19-sep-22	28	1,93	1,88	2,06
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,24	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,5418	-	-	-	4,3833	-	05-ago-22	10	6,74	6,46	7,39
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	18,50	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	124,5702	-	-	-	4,7236	-	10-jun-22	10	8,83	8,43	12,36
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	4,61	292	3,14%+VAC	-	-	-	80,8835	-	-	-	4,7562	-	15-jun-21	19	13,14	12,55	17,39
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	7,21	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,7755	-	-	-	4,6706	-	21-jul-22	2	15,41	14,72	23,89
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	4,81	492	3,26%+VAC	-	-	-	77,2859	-	-	-	4,6339	-	12-ago-21	10	18,32	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, BLOMBERG, DATATEC.

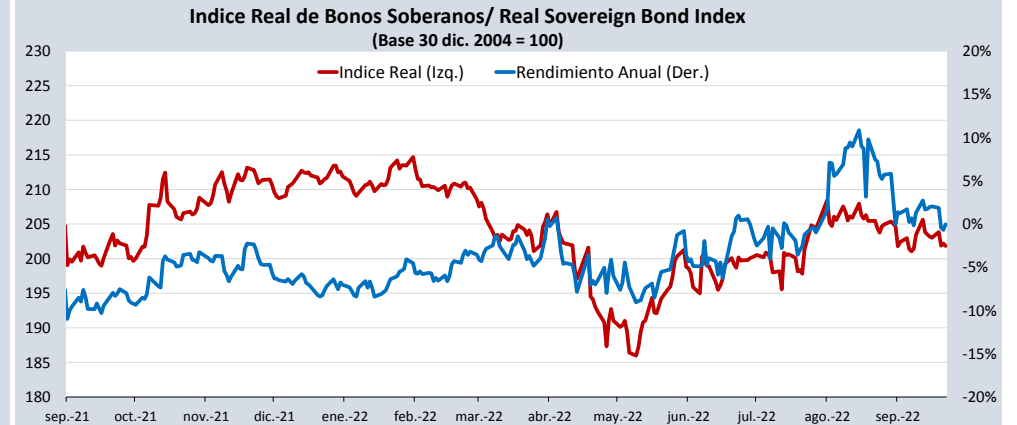
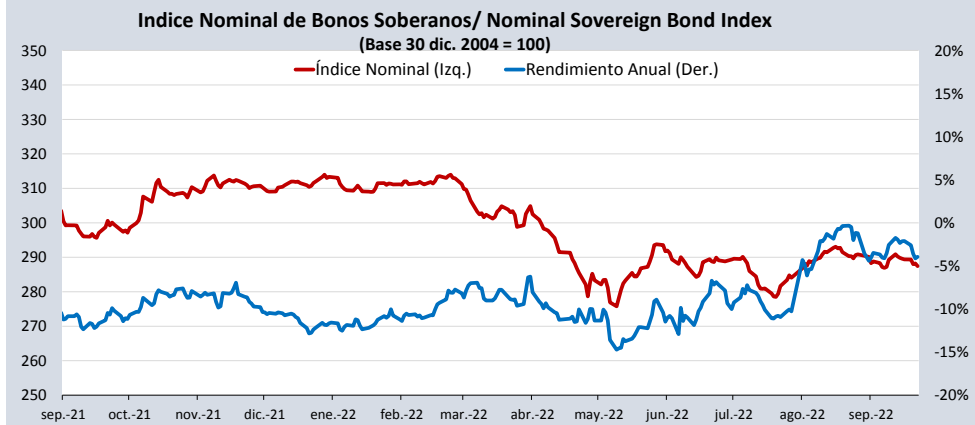
Bonos globales**** / Global bonds

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	106,3510	-0,26	-0,64	-0,52	4,9070	9	22	19	2,59	2,52	2,87
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	92,3810	-0,36	-0,58	-0,54	4,9020	13	21	19	3,21	3,13	3,39
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,7600	-0,38	-1,14	-0,62	3,4670	13	37	20	3,21	3,16	3,41
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	96,5190	-0,50	-0,56	-0,53	4,9310	12	14	13	4,48	4,38	4,99
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	84,5780	-0,64	-0,74	-0,45	5,3000	11	13	8	6,87	6,69	7,86
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	95,5130	-0,61	-1,99	-0,79	4,4700	10	33	13	6,44	6,30	7,46
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	82,0410	-0,77	-0,96	-0,54	5,5000	13	17	9	7,35	7,15	8,46
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	73,3550	-0,83	-0,99	-0,54	5,2780	13	16	8	9,07	8,84	10,34
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	124,9020	-1,10	-1,30	-0,76	5,7000	11	13	8	7,60	7,39	11,33
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	70,5510	-0,72	-1,95	-0,87	4,9190	11	30	13	9,68	9,45	10,62
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	78,5530	-0,78	-1,07	0,70	5,5840	11	15	10	9,35	9,10	11,48
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,2260	-0,58	-1,57	-0,85	5,1720	7	20	11	11,85	11,55	14,36
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	106,0280	-1,20	-1,09	-0,77	5,9240	12	11	8	9,71	9,43	14,69
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	72,4180	-1,00	-1,16	-0,84	5,7430	11	13	9	13,01	12,65	18,74
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	99,2320	-1,42	-1,31	-0,79	5,6790	10	9	6	14,12	13,73	28,57
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	70,9390	-0,93	-0,98	-0,88	5,6050	8	9	8	16,01	15,57	28,88
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,9960	-1,19	-1,20	-0,80	5,3840	11	11	7	18,66	18,17	38,75
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	64,1720	-0,94	-1,24	-1,00	5,8140	8	11	9	17,62	17,12	50,03
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	57,8680	-1,26	-1,24	-0,80	5,5990	12	12	8	18,38	17,88	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	287	-1	-2	-3,94	18	-180	0,00	5,72	11,32	12,87	13,51	13,11	12,53	7,89	12,63	5,35	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	202	0	-1	-0,03	65	-200	32,04	2,29	37,56	6,08	12,27	9,77



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