



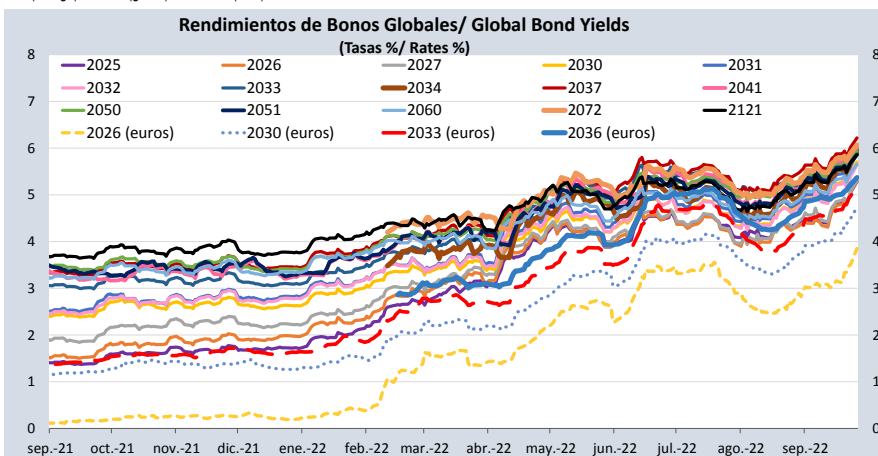
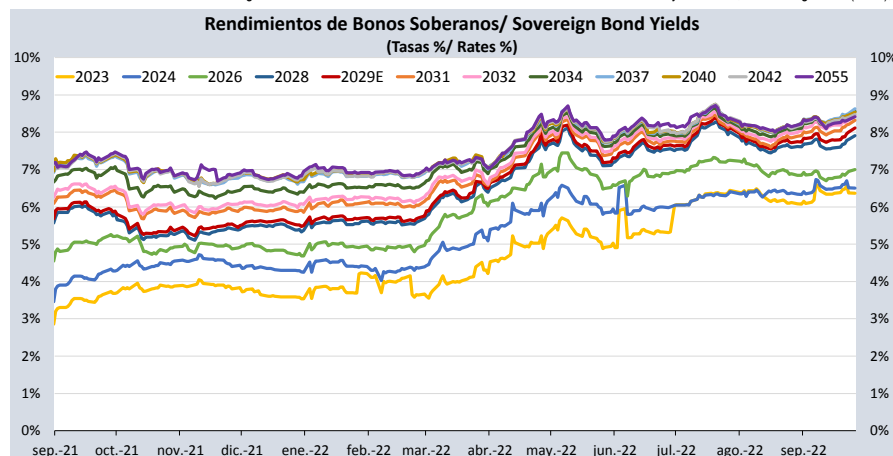
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

26/09/2022

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								
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	2,01	1 309	5,200	-	-	-	98,9349	-	-	-	6,3648	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,96
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	6,97	6.741	5,700	98,45	98,61	98,61	98,6084	6,60	6,50	6,50	6,5000	1	26-sep-22	2	1,82	1,71	1,88
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	10,03	12 517	8,200	103,92	104,05	103,95	104,0683	7,04	7,00	7,03	6,9974	12	26-sep-22	23	3,43	3,20	3,88
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	7,76	15 726	6,350	92,71	92,75	92,71	92,9274	7,96	7,95	7,96	7,9078	39	26-sep-22	168	4,99	4,62	5,88
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	72,64	17 129	5,940	89,29	89,38	89,34	89,4869	8,16	8,14	8,15	8,1144	41	26-sep-22	79	5,37	4,96	6,38
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	8,50	15 866	6,950	91,38	91,60	91,55	91,7804	8,39	8,35	8,36	8,3184	32	26-sep-22	122	6,70	6,19	8,88
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	7,52	16 297	6,150	84,90	85,02	84,90	85,0991	8,48	8,46	8,48	8,4447	39	26-sep-22	107	7,36	6,79	9,88
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	6,60	11 689	5,400	76,86	76,92	77,04	76,9985	8,59	8,58	8,56	8,5651	27	26-sep-22	131	8,49	7,82	11,88
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	8,44	16 180	6,900	85,82	85,96	85,96	86,0159	8,66	8,64	8,64	8,6321	31	26-sep-22	156	9,12	8,40	14,88
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	6,54	8 566	5,350	71,23	71,30	71,23	71,3825	8,56	8,55	8,56	8,5377	9	26-sep-22	26	10,54	9,72	17,88
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	8,38	4 610	6,850	-	-	-	85,0244	-	-	-	8,4777	-	22-sep-22	2	10,39	9,59	19,38
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	8,21	2 272	6,714	-	-	-	81,6359	-	-	-	8,4118	-	12-sep-22	2	12,18	11,25	32,38
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	54,12	1.498	6,84% + VAC	-	-	-	107,7785	-	-	-	2,8732	-	19-sep-22	28	1,92	1,87	2,05
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,66	98	2,89%+VAC	-	-	-	90,0468	-	-	-	4,4701	-	05-ago-22	10	6,73	6,44	7,38
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	19,92	1.539	7,39% + VAC	-	-	-	123,3663	-	-	-	4,8366	-	10-jun-22	10	8,80	8,39	12,35
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	5,07	292	3,14%+VAC	-	-	-	80,2930	-	-	-	4,8152	-	15-jun-21	19	13,11	12,51	17,38
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	7,92	695	3,83% + VAC	-	-	-	87,1394	-	-	-	4,7201	-	21-jul-22	2	15,36	14,67	23,88
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	5,28	492	3,26%+VAC	-	-	-	76,6210	-	-	-	4,6834	-	12-ago-21	10	18,24	17,42	31,38

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).



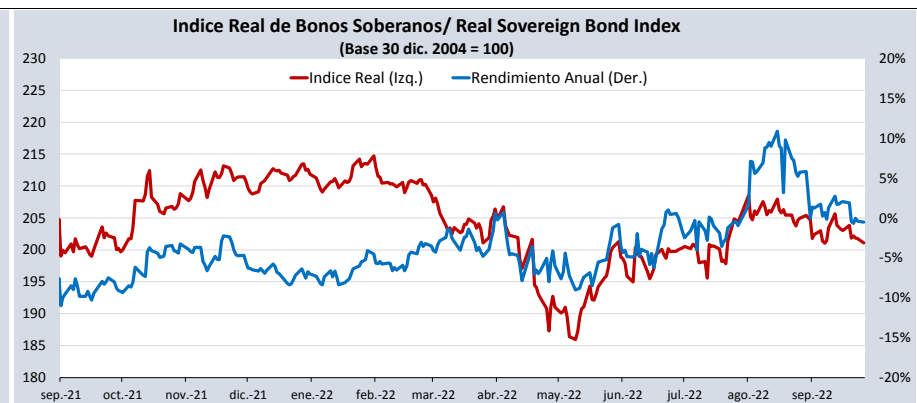
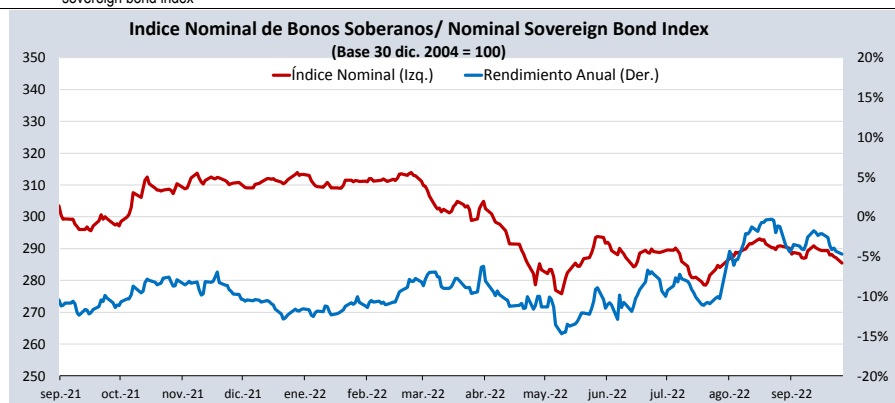
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	105,3330	-0,64	-1,27	-0,45	5,2810	24	46	17	2,57	2,51	2,86
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	91,2440	-0,69	-1,42	-0,47	5,3020	24	51	17	3,20	3,11	3,38
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,6060	-1,04	-2,24	-0,71	3,8490	34	73	24	3,20	3,14	3,39
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	94,9520	-0,98	-1,76	-0,54	5,3060	24	42	13	4,47	4,35	4,98
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	82,3310	-1,44	-2,43	-0,56	5,7020	26	44	10	6,84	6,65	7,84
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	93,9810	-1,38	-3,36	-0,85	4,7270	23	56	14	6,42	6,27	7,45
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	79,8140	-1,61	-2,48	-0,59	5,8860	28	43	10	7,32	7,11	8,45
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	71,0350	-1,61	-2,58	-0,65	5,6420	25	41	10	9,04	8,79	10,33
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	121,9890	-1,85	-3,43	-0,58	6,0130	20	37	6	7,55	7,32	11,32
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	69,1280	-1,05	-2,93	-0,79	5,1410	16	45	12	9,66	9,42	10,61
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	76,0530	-1,65	-2,73	0,67	5,9390	24	39	10	9,30	9,03	11,47
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	66,7170	-1,17	-2,75	-0,86	5,3690	15	36	11	11,80	11,49	14,35
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	103,1360	-1,91	-3,40	-0,86	6,2180	20	35	9	9,62	9,33	14,68
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	69,9260	-1,61	-2,94	-0,85	6,0210	18	33	10	12,89	12,51	18,73
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	95,8720	-2,12	-3,93	-0,85	5,9280	16	29	6	13,87	13,47	28,56
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	68,2050	-1,77	-2,92	-0,94	5,8600	17	27	9	15,73	15,28	28,87
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,2560	-1,72	-3,15	-0,81	5,6500	17	31	8	18,17	17,67	38,74
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	61,4890	-1,83	-3,00	-0,95	6,0650	17	28	9	17,06	16,55	50,02
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	55,3280	-1,65	-3,04	-0,72	5,8530	17	30	8	17,58	17,08	100,28

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	285	-2	-4	-4,68	-37	-208	0,00	5,76	11,33	12,86	13,48	13,11	12,53	7,90	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 (%)											
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	201	-1	-3		-0,54	-14	-241	32,31	2,29	37,37	6,06	12,24	9,73					



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