



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

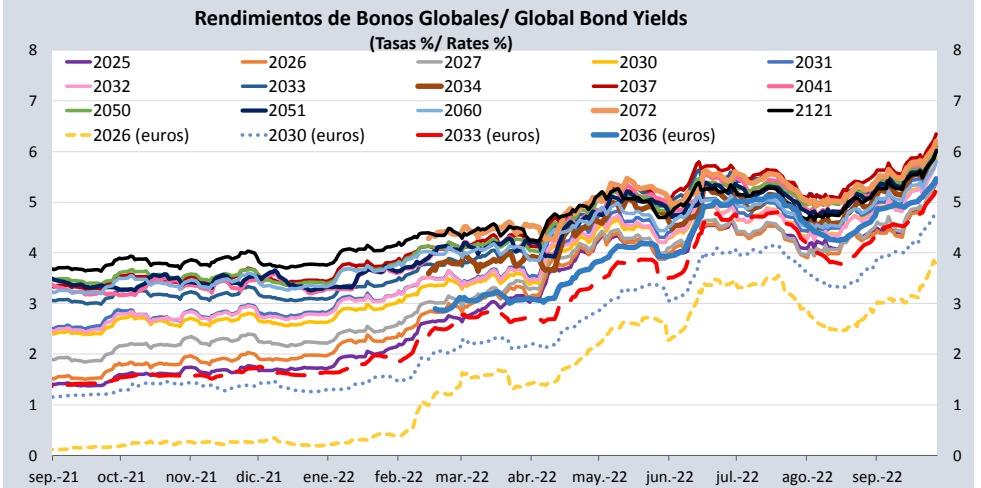
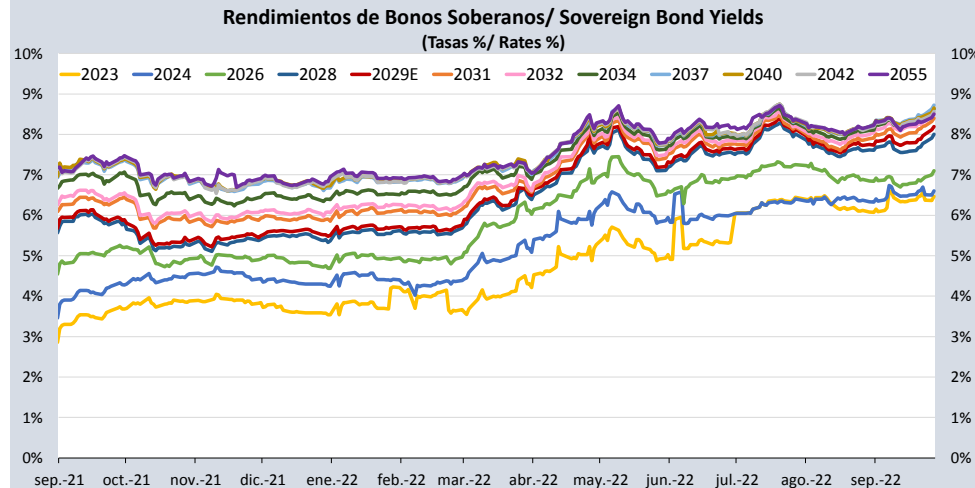
27/09/2022

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	2,16	1 309	5,200	-	-	-	98,8474	-	-	-	6,4657	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,96
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	7,12	6.741	5,700	-	-	-	98,4394	-	-	-	6,6009	-	26-sep-22	2	1,82	1,71	1,88
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	10,25	12 517	8,200	103,65	103,71	103,71	103,7270	7,12	7,10	7,10	7,0983	9	27-sep-22	18	3,43	3,20	3,88
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	7,94	16 325	6,350	92,28	92,33	92,37	92,5011	8,06	8,05	8,04	8,0071	17	27-sep-22	172	4,98	4,62	5,88
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	74,25	17 397	5,940	88,85	88,90	88,90	89,1434	8,26	8,25	8,25	8,1920	23	27-sep-22	93	5,36	4,95	6,38
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	8,69	16 343	6,950	90,81	91,09	91,09	91,2962	8,49	8,44	8,44	8,4035	13	27-sep-22	34	6,69	6,17	8,88
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	7,69	17 086	6,150	84,33	84,44	84,50	84,7251	8,58	8,56	8,55	8,5095	17	27-sep-22	129	7,35	6,78	9,88
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	6,75	11 689	5,400	76,47	76,50	76,50	76,6161	8,66	8,65	8,65	8,6288	30	27-sep-22	182	8,47	7,80	11,88
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	8,63	16 833	6,900	85,24	85,31	85,31	85,3563	8,74	8,73	8,73	8,7232	9	27-sep-22	30	9,10	8,37	14,88
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	6,69	8 566	5,350	-	-	-	70,5703	-	-	-	8,6550	-	26-sep-22	26	10,49	9,66	17,88
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	8,56	4 610	6,850	-	-	-	84,2844	-	-	-	8,5688	-	22-sep-22	2	10,39	9,59	19,38
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	8,39	2 272	6,714	-	-	-	80,8128	-	-	-	8,5029	-	12-sep-22	2	12,18	11,25	32,38
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	54,46	884	6,84% + VAC	-	-	-	107,4762	-	-	-	3,0147	-	19-sep-22	28	1,92	1,86	2,04
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,76	77	2,89%+VAC	-	-	-	89,3400	-	-	-	4,5927	-	05-ago-22	10	6,72	6,42	7,38
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	20,27	911	7,39% + VAC	-	-	-	122,2146	-	-	-	4,9472	-	10-jun-22	10	8,77	8,36	12,34
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	5,18	228	3,14%+VAC	-	-	-	78,7598	-	-	-	4,9692	-	15-jun-21	19	13,06	12,44	17,38
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	8,10	424	3,83% + VAC	-	-	-	85,4567	-	-	-	4,8529	-	21-jul-22	2	15,26	14,55	23,88
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	5,40	383	3,26%+VAC	-	-	-	74,8693	-	-	-	4,8162	-	12-ago-21	10	18,07	17,24	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).



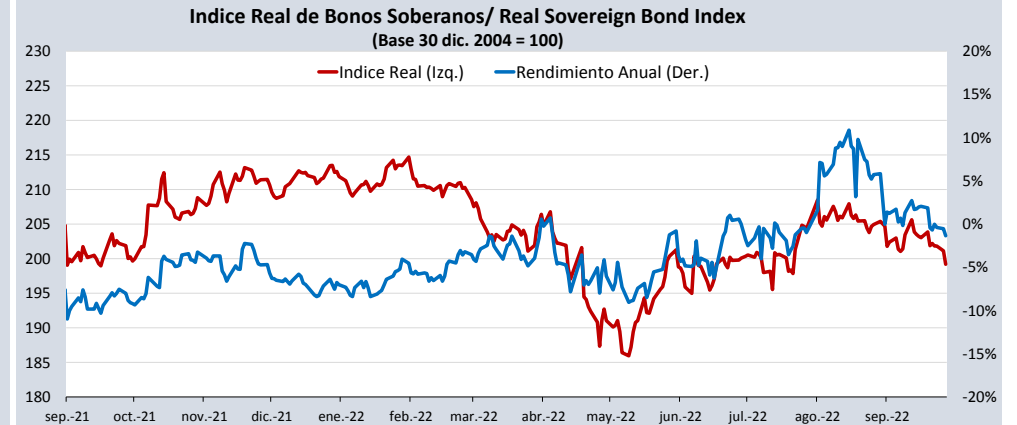
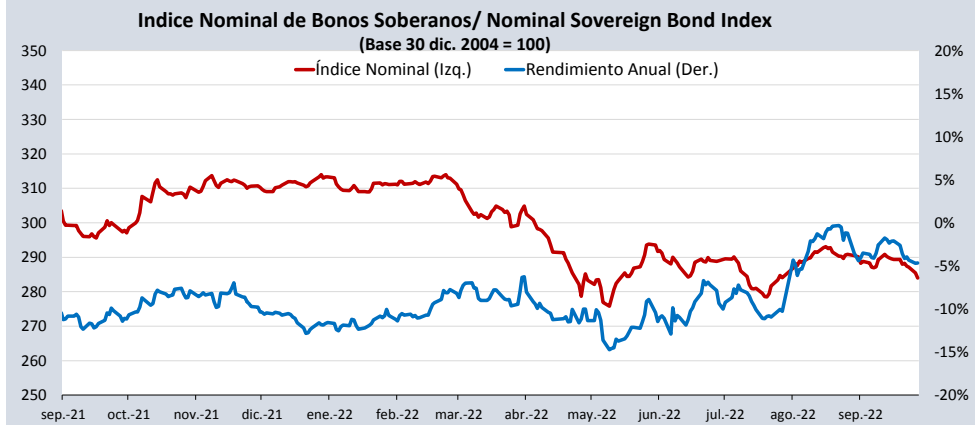
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	105,0540	-0,28	-1,44	-0,41	5,3840	10	52	16	2,57	2,50	2,86
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	90,8220	-0,42	-1,66	-0,38	5,4530	15	60	13	3,19	3,11	3,37
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,8340	0,23	-1,33	-0,58	3,7740	-8	44	19	3,20	3,14	3,39
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	94,4610	-0,49	-2,04	-0,49	5,4250	12	49	12	4,46	4,35	4,98
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	81,4820	-0,85	-2,93	-0,58	5,8580	16	53	11	6,83	6,64	7,84
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	93,7500	-0,23	-2,42	-0,83	4,7660	4	41	14	6,41	6,26	7,45
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	78,7280	-1,09	-3,32	-0,50	6,0790	19	58	9	7,31	7,09	8,44
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	70,0050	-1,03	-3,18	-0,63	5,8080	17	51	10	9,02	8,77	10,33
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	120,6500	-1,34	-4,26	-0,76	6,1600	15	46	8	7,52	7,30	11,31
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	68,5940	-0,53	-2,81	-0,86	5,2260	9	44	14	9,65	9,41	10,61
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	74,8540	-1,20	-3,62	0,70	6,1150	18	52	10	9,27	9,00	11,47
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	66,0240	-0,69	-2,94	-0,81	5,4610	9	39	11	11,78	11,47	14,35
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	101,9160	-1,22	-3,98	-0,76	6,3450	13	41	8	9,59	9,29	14,67
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	68,5410	-1,39	-3,89	-0,90	6,1820	16	44	11	12,82	12,44	18,72
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	94,1440	-1,73	-5,16	-0,53	6,0610	13	39	4	13,74	13,34	28,55
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	66,6250	-1,58	-4,10	-0,84	6,0130	15	39	8	15,57	15,12	28,86
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	53,7780	-1,48	-4,03	-0,67	5,8020	15	40	7	17,89	17,39	38,74
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	60,1240	-1,36	-3,92	-0,99	6,2000	14	38	10	16,76	16,26	50,02
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	53,8120	-1,52	-3,99	-0,62	6,0170	16	41	7	17,11	16,61	100,27

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	284	-1	-4	-4,66	2	-106	0,00	5,80	11,39	12,88	13,50	13,11	12,51	7,86	12,57	5,34	3,43	1,62
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual % / Annual yield %	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
Índice / Index	Valor / Value	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	199	-2	-3	-1,34	-80	-90	32,55	2,29	37,41	6,01	12,13	9,60						



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