



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

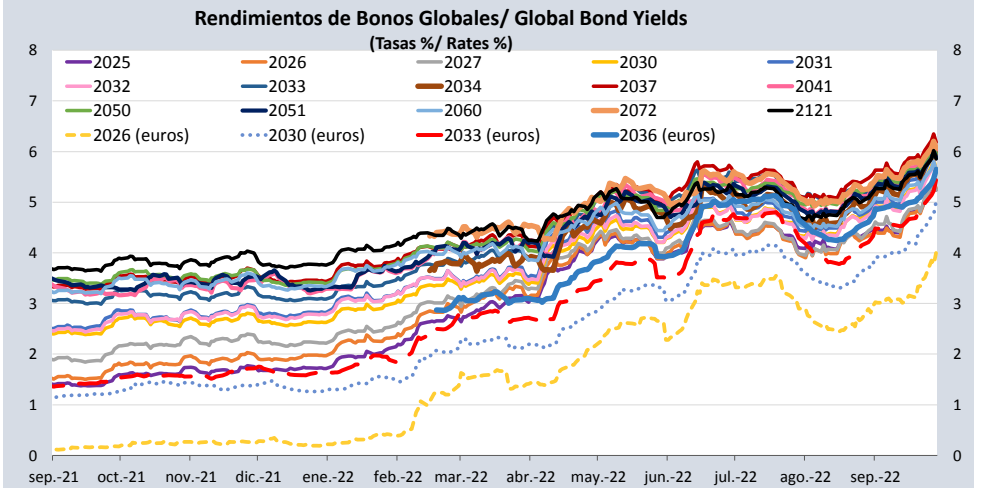
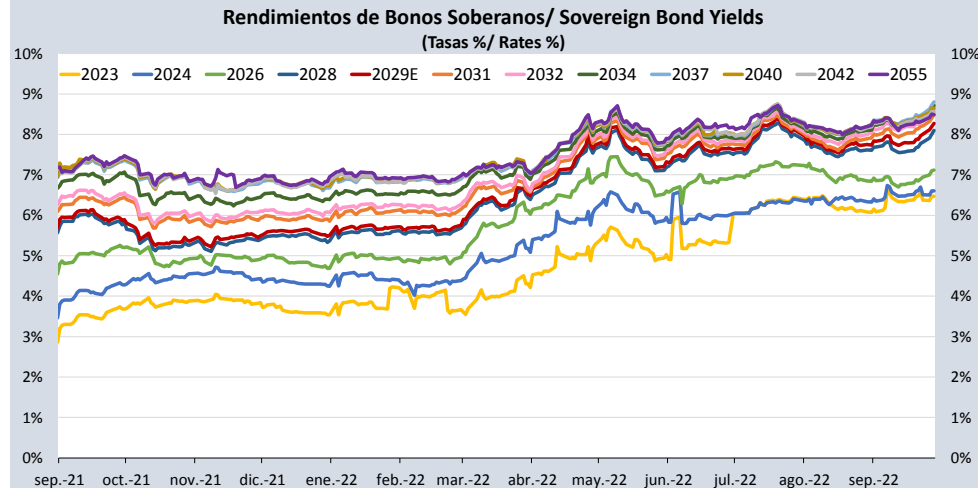
28/09/2022

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	2,30	1 309	5,200	-	-	-	98,8511	-	-	-	6,4648	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,96
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	7,28	6.741	5,700	98,37	98,62	98,37	98,4430	6,65	6,50	6,65	6,6000	2	28-sep-22	20	1,82	1,70	1,87
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	10,47	12 517	8,200	103,71	103,87	103,71	103,6631	7,10	7,05	7,10	7,1167	5	28-sep-22	18	3,42	3,19	3,87
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	8,11	16 325	6,350	92,08	92,12	92,25	92,1192	8,11	8,10	8,07	8,0967	7	28-sep-22	27	4,98	4,61	5,87
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	75,86	17 397	5,940	88,64	88,69	88,73	88,7703	8,31	8,30	8,29	8,2767	27	28-sep-22	91	5,36	4,95	6,37
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	8,88	16 343	6,950	90,37	90,42	90,59	90,7603	8,57	8,56	8,53	8,4984	26	28-sep-22	87	6,68	6,16	8,87
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	7,85	17 086	6,150	83,82	83,88	83,99	83,9655	8,67	8,66	8,64	8,6419	55	28-sep-22	259	7,34	6,75	9,87
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	6,90	11 689	5,400	76,15	76,21	76,21	76,0881	8,71	8,70	8,70	8,7173	39	28-sep-22	233	8,46	7,78	11,87
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	8,81	16 833	6,900	84,81	84,88	84,88	84,7940	8,80	8,79	8,79	8,8017	51	28-sep-22	369	9,07	8,34	14,87
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	6,83	8 566	5,350	70,27	70,62	70,55	70,6625	8,70	8,65	8,66	8,6419	4	28-sep-22	6	10,50	9,66	17,87
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	8,75	4 610	6,850	-	-	-	84,3912	-	-	-	8,5557	-	22-sep-22	2	10,39	9,59	19,37
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	8,58	2 272	6,714	-	-	-	80,9305	-	-	-	8,4898	-	12-sep-22	2	12,18	11,25	32,37
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	54,79	884	6,84% + VAC	-	-	-	107,4652	-	-	-	3,0154	-	19-sep-22	28	1,92	1,86	2,04
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,86	77	2,89%+VAC	-	-	-	88,8512	-	-	-	4,6784	-	05-ago-22	10	6,71	6,41	7,37
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	20,62	911	7,39% + VAC	-	-	-	121,3499	-	-	-	5,0311	-	10-jun-22	10	8,76	8,34	12,34
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	5,29	228	3,14%+VAC	-	-	-	78,7413	-	-	-	4,9713	-	15-jun-21	19	13,05	12,44	17,37
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	8,27	424	3,83% + VAC	-	-	-	85,6167	-	-	-	4,8402	-	21-jul-22	2	15,27	14,56	23,87
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	5,52	383	3,26%+VAC	-	-	-	75,0353	-	-	-	4,8035	-	12-ago-21	10	18,08	17,25	31,37

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.

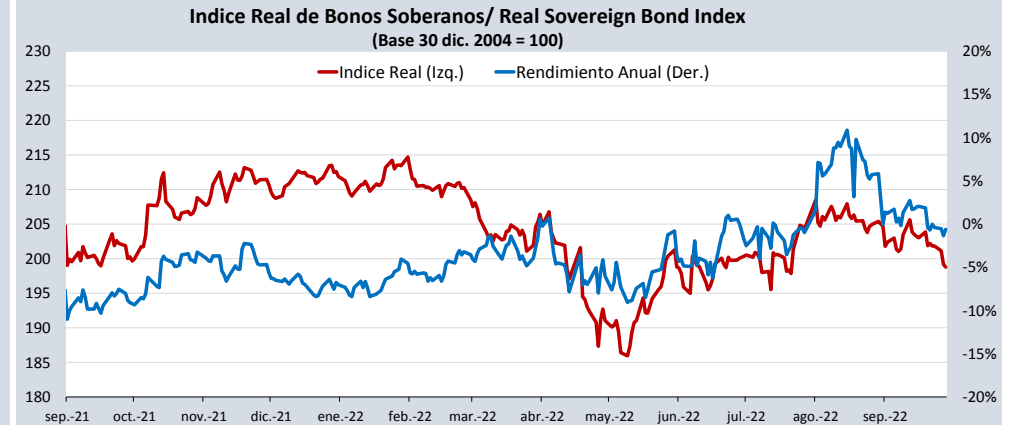
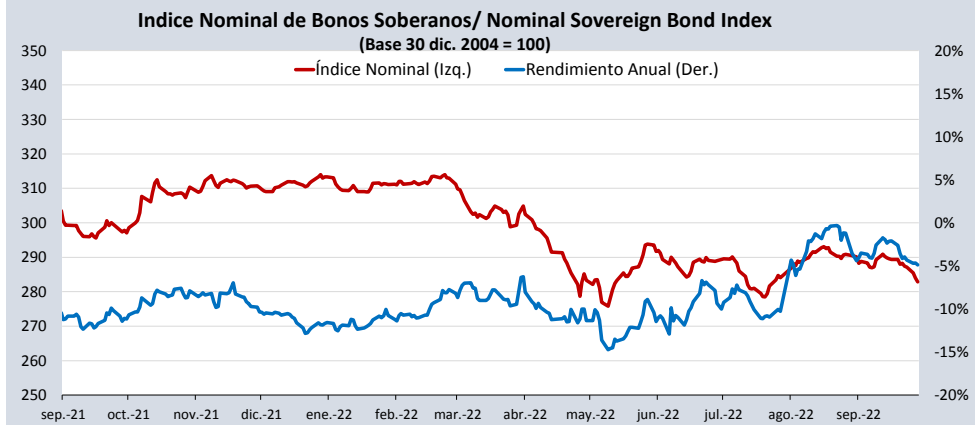
Bonos globales**** / Global bonds

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	105,4370	0,38	-1,17	-0,43	5,2390	-15	42	16	2,57	2,50	2,85
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	91,4050	0,58	-1,33	-0,48	5,2500	-20	48	17	3,19	3,11	3,37
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,1670	-0,67	-1,97	-0,58	3,9970	22	66	20	3,20	3,13	3,39
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	95,2340	0,77	-1,78	-0,52	5,2390	-19	43	13	4,46	4,35	4,98
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	82,7110	1,23	-2,51	-0,50	5,6350	-22	45	9	6,84	6,65	7,84
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	92,3340	-1,42	-3,79	-0,83	5,0090	24	64	14	6,40	6,24	7,45
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	80,0100	1,28	-2,80	-0,26	5,8530	-23	48	5	7,31	7,11	8,44
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	71,2290	1,22	-2,95	-0,48	5,6130	-19	46	8	9,03	8,79	10,33
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	122,0220	1,37	-3,98	-0,68	6,0080	-15	42	8	7,54	7,32	11,31
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	67,2750	-1,32	-4,00	-0,93	5,4380	21	63	15	9,64	9,38	10,60
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	76,1920	1,34	-3,14	0,67	5,9200	-20	45	10	9,29	9,03	11,46
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	64,6470	-1,38	-4,16	-0,92	5,6470	19	55	13	11,75	11,42	14,34
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	103,4940	1,58	-3,74	-0,71	6,1810	-16	38	7	9,63	9,34	14,67
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	69,8450	1,30	-3,57	-0,82	6,0310	-15	40	9	12,88	12,50	18,72
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	95,4030	1,26	-5,25	-0,60	5,9630	-10	39	4	13,83	13,43	28,55
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	68,0030	1,38	-3,86	-0,83	5,8790	-13	36	8	15,71	15,26	28,86
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,3230	1,55	-3,87	-0,65	5,6430	-16	37	7	18,17	17,68	38,73
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	61,4360	1,31	-3,68	-0,82	6,0700	-13	34	8	17,04	16,54	50,02
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	55,3190	1,51	-3,81	-0,59	5,8540	-16	37	6	17,58	17,08	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	283	-1	-5	-4,88	-22	-76	0,00	5,82	11,41	12,89	13,52	13,11	12,52	7,86	12,54	5,31	3,42	1,61

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	199	0	-3	-0,62	72	6	32,63	2,29	37,24	6,02	12,18	9,65



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