



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

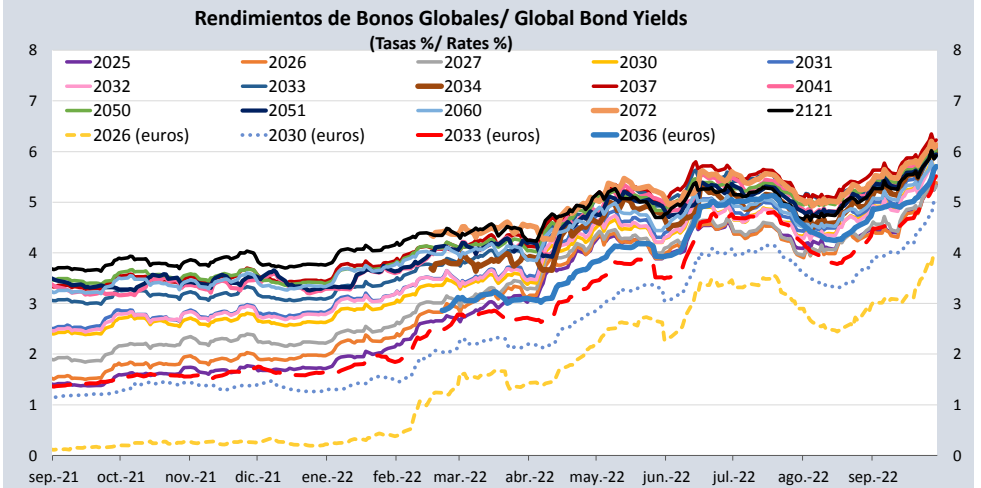
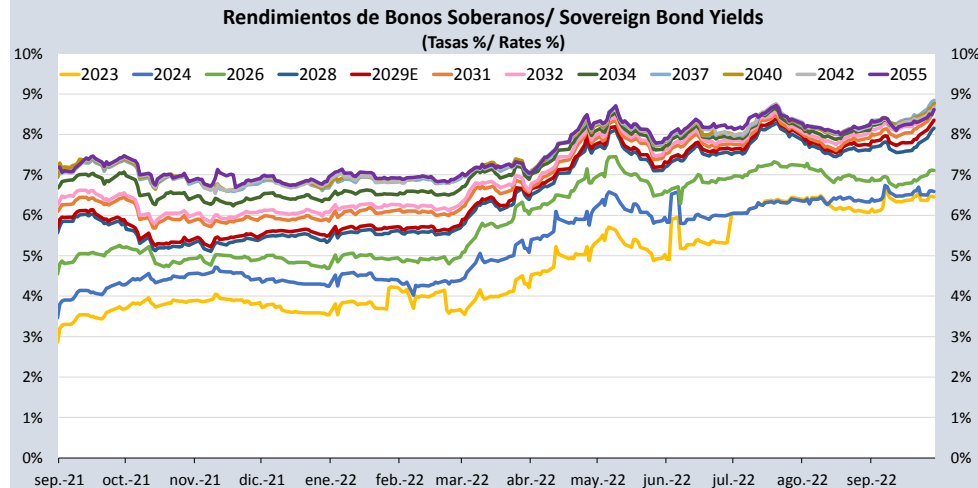
29/09/2022

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds			Intereses corridos SI. / Accrued Interest PEN	Saldo vigente Millones SI. / Millions PEN	Cupón % / Coupon %	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº 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	2,44	1 309	5,200	-	-	-	98,8637	-	-	-	6,4538	-	07-sep-22	13	0,99	0,93	0,95
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	7,43	6.741	5,700	-	-	-	98,4637	-	-	-	6,5890	-	28-sep-22	20	1,81	1,70	1,87
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	10,70	12 517	8,200	103,61	103,81	103,67	103,6976	7,13	7,07	7,11	7,1057	5	29-sep-22	4	3,42	3,19	3,87
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	8,28	16 325	6,350	91,82	91,91	91,70	91,8798	8,17	8,15	8,20	8,1534	7	29-sep-22	80	4,98	4,60	5,87
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	77,48	17 397	5,940	88,47	88,51	88,29	88,4229	8,35	8,34	8,39	8,3561	27	29-sep-22	68	5,35	4,94	6,37
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	9,06	16 343	6,950	90,03	90,09	89,92	90,0784	8,63	8,62	8,65	8,6202	26	29-sep-22	168	6,67	6,14	8,87
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	8,02	17 086	6,150	83,47	83,48	83,31	83,5349	8,73	8,73	8,76	8,7179	55	29-sep-22	163	7,33	6,74	9,87
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	7,04	11 689	5,400	75,62	75,79	75,62	75,7115	8,80	8,77	8,80	8,7811	39	29-sep-22	141	8,44	7,76	11,87
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	9,00	16 833	6,900	84,39	84,60	84,46	84,5252	8,86	8,83	8,85	8,8396	51	29-sep-22	80	9,06	8,32	14,87
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	6,98	8 566	5,350	69,66	69,80	69,60	69,8232	8,79	8,77	8,80	8,7650	4	29-sep-22	28	10,45	9,60	17,87
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	8,94	4 610	6,850	-	-	-	83,4048	-	-	-	8,6788	-	22-sep-22	2	10,28	9,47	19,37
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	8,76	2 272	6,714	-	-	-	79,8385	-	-	-	8,6129	-	12-sep-22	2	11,83	10,90	32,37
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	55,13	884	6,84% + VAC	-	-	-	107,4774	-	-	-	3,0048	-	19-sep-22	28	1,91	1,86	2,04
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	4,97	77	2,89%+VAC	-	-	-	88,3241	-	-	-	4,7715	-	05-ago-22	10	6,71	6,40	7,37
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	20,98	911	7,39% + VAC	-	-	-	120,7581	-	-	-	5,0889	-	10-jun-22	10	8,74	8,32	12,34
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	5,41	228	3,14%+VAC	-	-	-	77,7167	-	-	-	5,0765	-	15-jun-21	19	13,02	12,39	17,37
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	8,45	424	3,83% + VAC	-	-	-	84,1434	-	-	-	4,9592	-	21-jul-22	2	15,18	14,46	23,87
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	5,64	383	3,26%+VAC	-	-	-	73,5114	-	-	-	4,9224	-	12-ago-21	10	17,93	17,09	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.

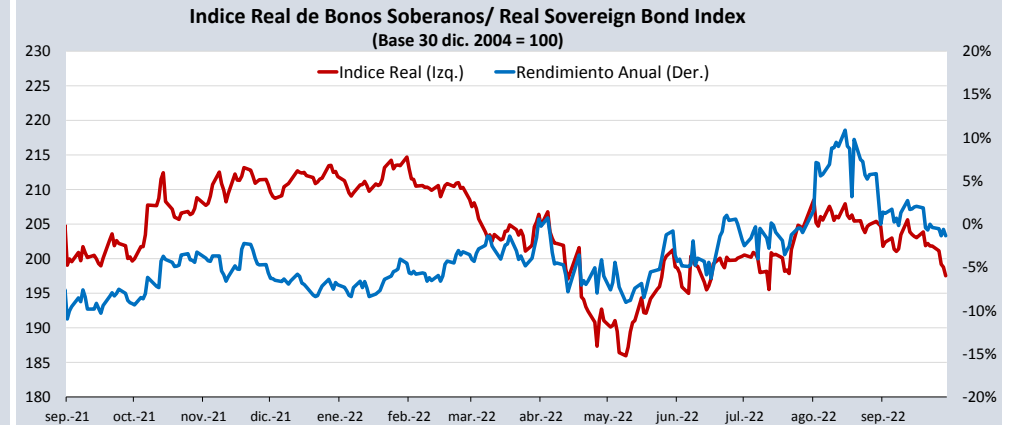
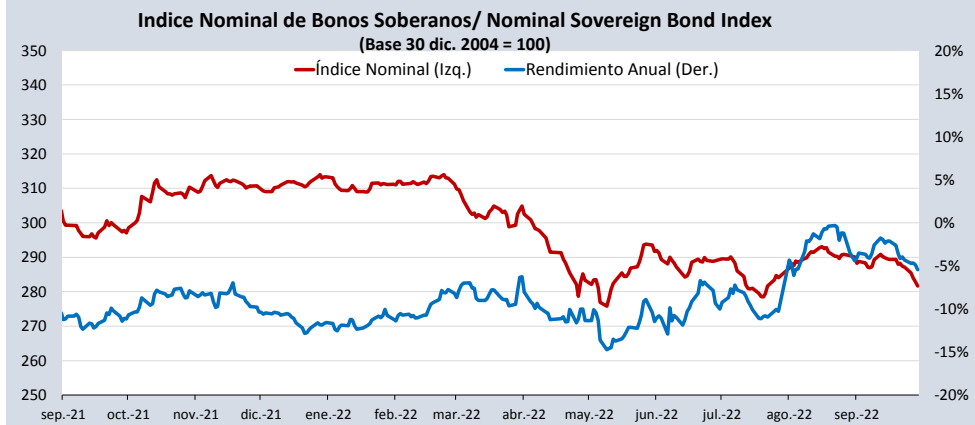
Bonos globales**** / Global bonds

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	105,1360	-0,30	-1,22	-0,42	5,3460	11	44	16	2,57	2,50	2,85
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	91,0410	-0,36	-1,34	-0,44	5,3860	14	48	16	3,19	3,10	3,37
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,1470	-0,02	-1,61	-0,62	4,0060	1	54	21	3,19	3,13	3,39
Perú Global 27	US715638BU55	1 013	4,125	94,9060	-0,33	-1,61	-0,53	5,3200	8	39	13	4,46	4,34	4,98
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	82,2780	-0,43	-2,30	-0,50	5,7160	8	42	9	6,83	6,64	7,84
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	91,7310	-0,60	-3,78	-0,79	5,1150	11	65	14	6,39	6,23	7,44
Perú Global 31	US715638DF60	3 750	2,783	79,7440	-0,27	-2,30	-0,48	5,9030	5	40	8	7,31	7,10	8,44
Perú Global 32	US715638DP43	1 000	1,862	70,7170	-0,51	-2,64	-0,59	5,6970	8	42	9	9,03	8,78	10,32
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	121,3980	-0,62	-3,50	-0,46	6,0760	7	38	5	7,53	7,31	11,31
Perú Global 33	XS2314020806	€825	1,250	66,8320	-0,44	-3,72	-0,97	5,5130	8	59	16	9,63	9,37	10,60
Perú Global 34	US715638DU38	2 250	3,000	75,6690	-0,52	-2,88	0,65	5,9980	8	41	9	9,28	9,01	11,46
Perú Global 36	XS2408608219	€1 000	1,950	64,2540	-0,39	-3,97	-0,89	5,7030	6	53	12	11,73	11,41	14,34
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	103,0270	-0,47	-3,00	-0,73	6,2290	5	31	8	9,61	9,32	14,67
Perú Global 41	US715638DS81	1 250	3,300	69,2480	-0,60	-3,17	-0,85	6,1010	7	36	10	12,85	12,47	18,72
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	94,6670	-0,74	-4,57	-0,73	6,0200	6	34	6	13,78	13,37	28,55
Perú Global 51	US715638DT64	1 750	3,550	67,3630	-0,64	-3,58	-0,88	5,9410	6	34	9	15,64	15,19	28,86
Perú Global 60	US715638DQ26	2 000	2,780	54,5980	-0,73	-3,40	-0,72	5,7170	7	33	8	18,04	17,54	38,73
Perú Global 72	US715638DW93	1 000	3,600	60,7800	-0,66	-3,39	-0,96	6,1350	6	32	9	16,90	16,39	50,01
Perú Global 2121	US715638DR09	1 000	3,230	54,7010	-0,62	-3,17	-0,79	5,9200	7	32	8	17,38	16,88	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	282	-1	-6	-5,42	-54	-148	0,00	5,84	11,45	12,89	13,52	13,09	12,46	7,84	12,52	5,34	3,43	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	198	-1	-4	-1,35	-73	-132	32,85	2,29	37,31	5,98	12,05	9,52



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