



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

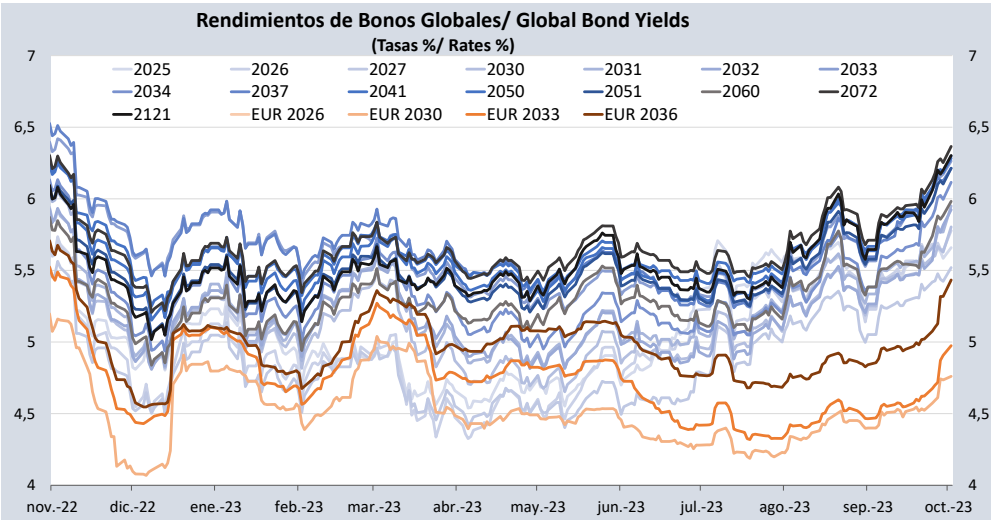
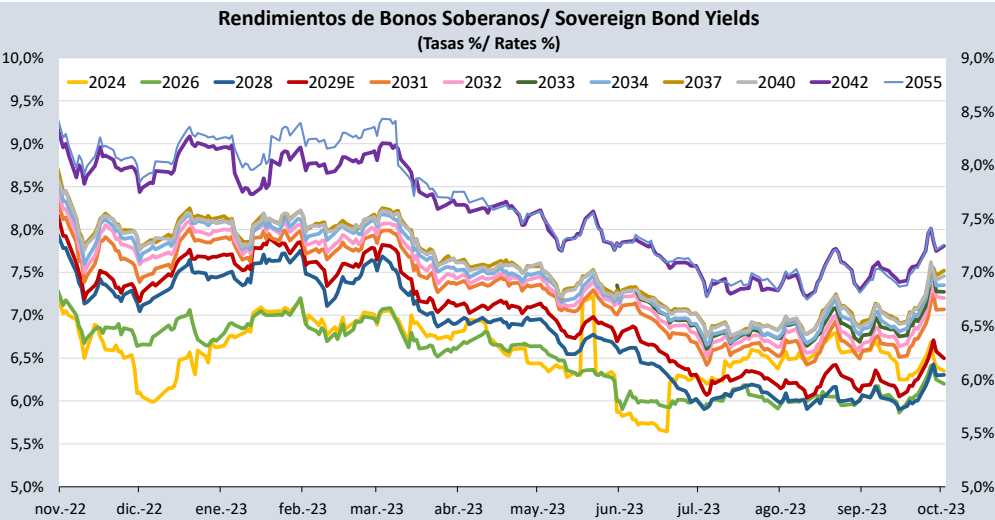
02/10/2023

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 Modificada / Modified	vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)	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	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	0,79	4 238	5,700	-	-	-	99,4524	-	-	-	6,3496	-	29-sep-23	2	0,86	0,81	0,87
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,14	7 042	8,200	105,02	106,08	105,07	105,1663	6,25	5,85	6,23	6,1995	11	02-oct-23	21	2,63	2,47	2,87
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,88	11 518	6,350	100,00	100,61	100,21	100,1918	6,35	6,20	6,30	6,3037	15	02-oct-23	28	4,29	4,03	4,87
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,82	17 934	5,940	96,64	97,50	97,41	97,5065	6,70	6,50	6,52	6,4978	8	02-oct-23	16	4,69	4,41	5,37
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,96	18 372	6,950	99,20	100,37	99,49	99,3825	7,10	6,90	7,05	7,0690	18	02-oct-23	211	6,21	5,80	7,87
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,85	19 591	6,150	93,50	94,30	93,50	93,3167	7,17	7,04	7,17	7,1994	17	02-oct-23	95	6,92	6,46	8,87
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,22	16 358	7,300	100,04	100,45	100,45	100,2911	7,31	7,25	7,25	7,2727	8	02-oct-23	71	7,16	6,67	9,87
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,75	14 400	5,400	85,66	86,03	85,80	85,7189	7,36	7,31	7,34	7,3507	18	02-oct-23	104	8,17	7,61	10,87
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,96	18 356	6,900	94,60	95,97	94,92	94,9155	7,56	7,39	7,52	7,5200	1	02-oct-23	20	9,05	8,41	13,87
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,74	9 229	5,350	79,42	81,02	80,14	80,1502	7,55	7,35	7,46	7,4575	4	02-oct-23	8	10,65	9,91	16,87
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,95	5 033	6,850	-	-	-	96,1902	-	-	-	7,2460	-	27-sep-23	7	10,62	9,90	18,37
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,93	3 204	6,714	-	-	-	93,5326	-	-	-	7,2578	-	27-sep-23	2	13,00	12,12	31,37
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,21	884	6,84% + VAC	-	-	-	104,1933	-	-	-	3,2671	-	31-oct-22	2	1,00	0,97	1,04
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,40	77	2,89%+VAC	-	-	-	104,1933	-	-	-	3,7563	-	18-ago-23	20	5,91	5,69	6,37
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,27	911	7,39% + VAC	-	-	-	126,3673	-	-	-	4,3891	-	10-jun-22	10	8,33	7,98	11,34
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,44	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,4377	-	-	-	4,4773	-	10-ago-23	50	12,67	12,13	16,37
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,53	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,4271	-	-	-	4,2655	-	21-jul-22	2	15,28	14,66	22,87
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,45	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,7159	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	18,46	17,70	30,37

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).

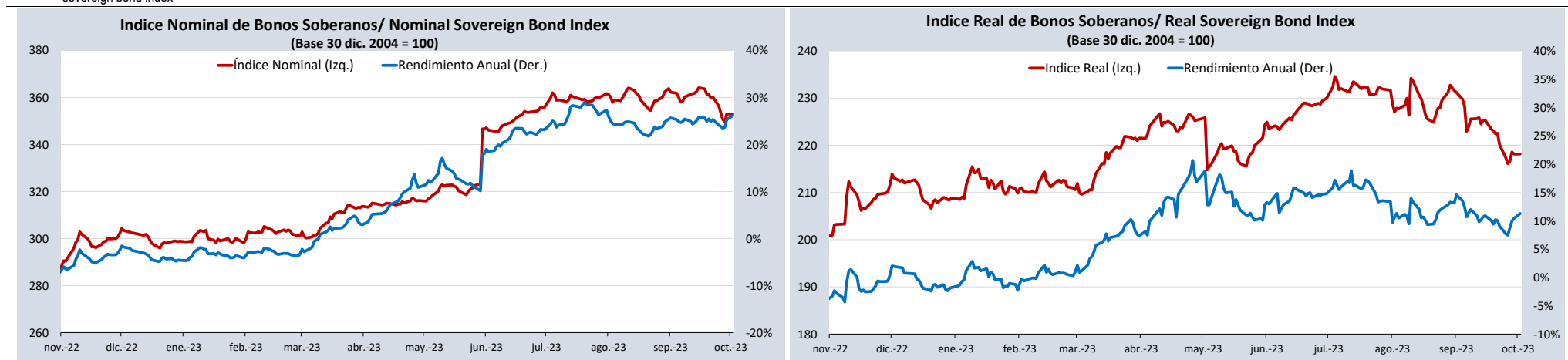
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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 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
21-jul-25	US715638AS19	888	7,350	102,8390	-0,13	-0,03	-0,45	5,6590	8	0	26	1,70	1,65	1,83
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,7930	-0,27	-0,13	-0,48	5,7780	14	9	23	2,25	2,18	2,34
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	95,9940	-0,04	-0,36	-0,61	4,6010	2	18	29	2,26	2,21	2,36
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,1680	-0,32	-0,32	-0,35	5,5200	10	10	11	3,62	3,52	3,95
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,7350	-0,88	-1,02	-0,42	5,8040	18	21	9	6,04	5,87	6,81
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,5110	-0,13	-0,98	-0,73	4,7600	2	19	14	5,63	5,50	6,42
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	81,4550	-0,95	-1,49	-0,53	5,9500	18	29	10	6,53	6,35	7,42
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	71,6010	-0,62	-2,03	-0,53	5,9240	11	35	9	8,23	7,99	9,30
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,4390	-0,77	-1,63	-0,89	6,2630	9	19	11	7,02	6,81	10,29
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,4790	-0,41	-1,82	-0,85	4,9750	7	30	14	8,81	8,59	9,58
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	76,4750	-0,77	-1,53	-0,63	6,1150	12	24	10	8,61	8,35	10,44
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	67,9090	-0,84	-2,63	-0,87	5,4330	12	36	12	11,11	10,81	13,32
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	103,0320	-0,82	-1,33	-0,89	6,2130	9	14	10	9,18	8,91	13,64
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	68,5300	-0,95	-1,94	-0,70	6,2990	12	23	9	12,35	11,97	17,69
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,4790	-1,22	-2,49	-0,75	6,2830	10	20	6	13,34	12,94	27,53
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,1220	-1,08	-2,29	-0,77	6,2140	11	23	8	15,16	14,70	27,84
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,4560	-0,91	-2,26	-0,63	5,9820	10	24	7	17,48	16,97	37,71
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,6520	-1,09	-2,28	-0,84	6,3660	11	23	9	16,39	15,89	48,99
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,3590	-0,86	-2,08	-0,76	6,3020	10	24	9	16,33	15,83	99,24

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-ago-24	12-ago-26	12-ago-28	12-feb-29	12-ago-31	12-ago-32	12-ago-33	12-ago-34	12-ago-37	12-ago-40	12-feb-42	12-feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	353	0	-3	26,10	80	198	-	5,51	8,57	12,98	13,57	13,58	12,34	9,17	12,95	5,50	3,60	2,23
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	218	0	1	11,30	87	360	30,67	2,37	37,55	6,25	12,87	10,30						



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