



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

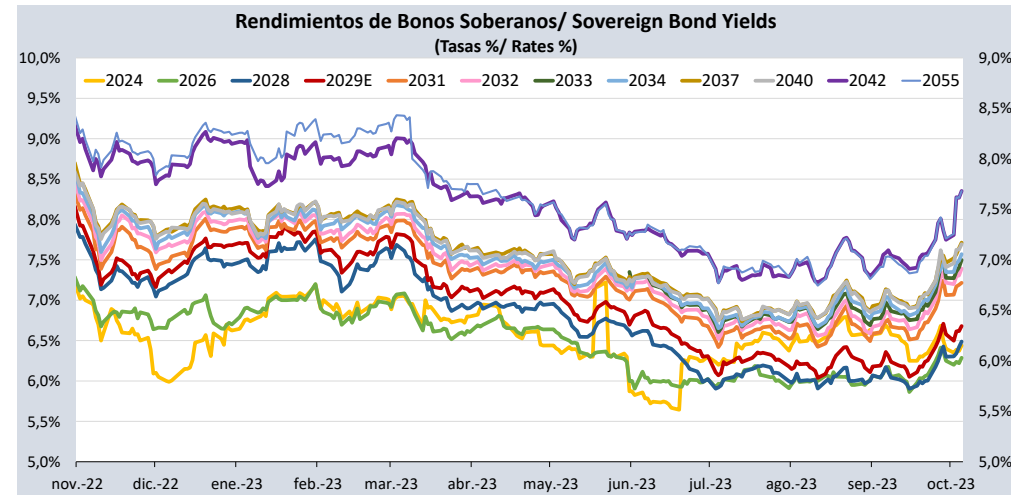
05/10/2023

Bonos soberanos / Sovereign bonds

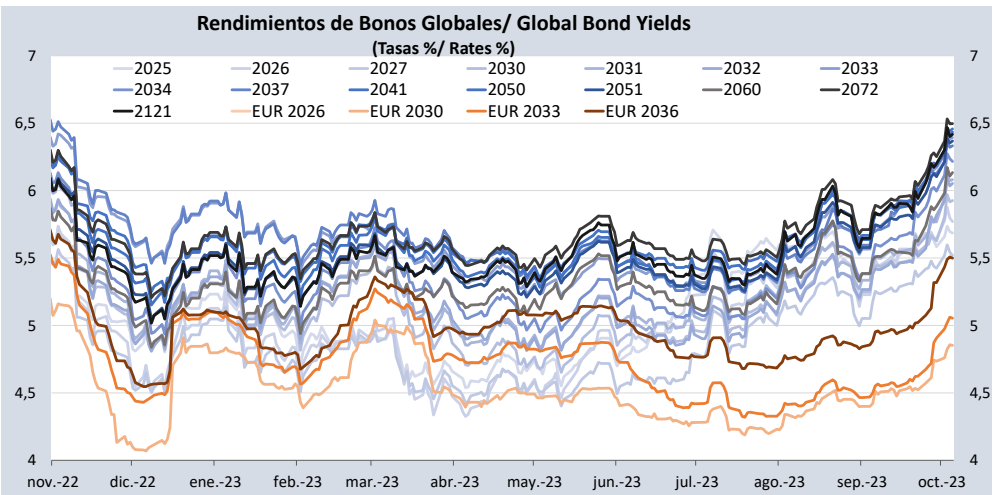
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración /	Duración	Vida media
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones 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
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	0,84	4 238	5,700	-	-	-	99,3862	-	-	-	6,4382	-	29-sep-23	2	0,85	0,80	0,86
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,20	7 042	8,200	-	-	-	104,9207	-	-	-	6,2881	-	04-oct-23	2	2,62	2,46	2,86
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,93	11 518	6,350	99,20	99,46	99,40	99,4419	6,55	6,49	6,50	6,4888	5	05-oct-23	50	4,28	4,01	4,86
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,87	17 934	5,940	96,22	96,78	96,69	96,7253	6,80	6,67	6,69	6,6800	2	05-oct-23	4	4,68	4,39	5,36
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,02	18 372	6,950	98,11	98,51	98,28	98,5341	7,29	7,22	7,26	7,2157	24	05-oct-23	94	6,20	5,78	7,86
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,90	19 591	6,150	91,82	92,24	92,09	92,1641	7,45	7,38	7,41	7,3913	9	05-oct-23	59	6,90	6,43	8,86
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,28	16 358	7,300	98,56	100,79	98,76	98,7667	7,53	7,20	7,50	7,4980	19	05-oct-23	146	7,13	6,63	9,86
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,79	14 400	5,400	83,99	84,44	84,31	84,2992	7,62	7,55	7,57	7,5700	1	05-oct-23	8	8,13	7,56	10,86
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,01	18 356	6,900	92,31	93,48	93,09	93,3762	7,85	7,70	7,75	7,7133	3	05-oct-23	6	8,99	8,35	13,86
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,79	9 229	5,350	-	-	-	78,2867	-	-	-	7,6945	-	04-oct-23	47	10,56	9,80	16,86
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,01	5 033	6,850	-	-	-	92,1281	-	-	-	7,6823	-	04-oct-23	1	10,43	9,68	18,36
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,99	3 204	6,714	-	-	-	88,8876	-	-	-	7,6815	-	03-oct-23	24	12,58	11,68	31,36
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,27	884	6,84% + VAC	-	-	-	104,0599	-	-	-	3,4425	-	31-oct-22	2	0,99	0,96	1,03
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,42	77	2,89%+VAC	-	-	-	104,0599	-	-	-	3,9317	-	18-ago-23	20	5,89	5,67	6,36
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,33	911	7,39% + VAC	-	-	-	124,1252	-	-	-	4,6105	-	10-jun-22	10	8,29	7,93	11,33
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,46	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,0629	-	-	-	4,7128	-	10-ago-23	50	12,59	12,03	16,36
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,56	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,7275	-	-	-	4,6976	-	21-jul-22	2	14,99	14,32	22,86
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,48	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,7825	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,94	17,14	30,36

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).

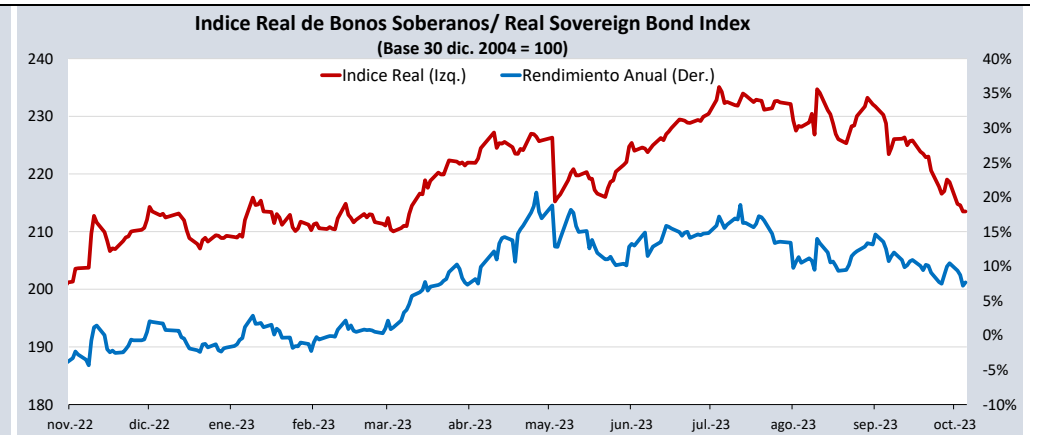
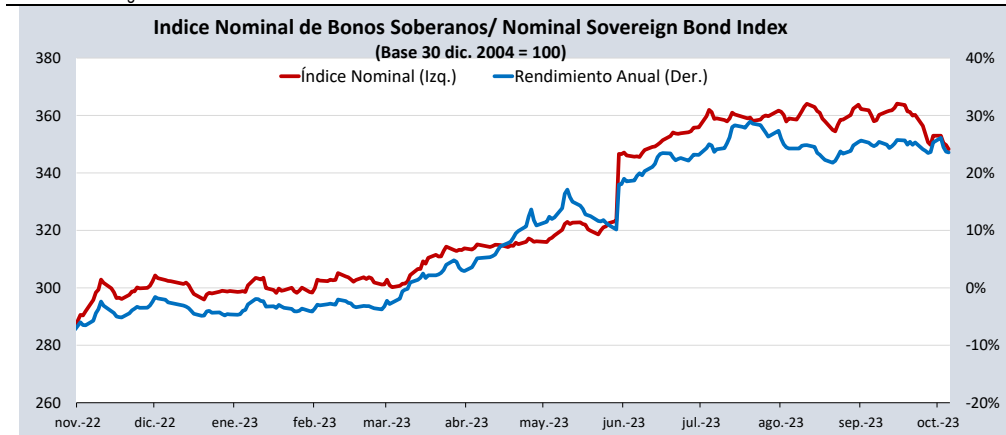


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	
21-jul-25	US715638AS19	888	7,350	102,7680	0,00	-0,13	-0,47	5,6860	-1	5	28	1,69	1,65	1,82	
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,8560	0,09	-0,18	-0,50	5,7700	-3	12	25	2,24	2,18	2,34	
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	95,8900	0,00	-0,13	-0,61	4,6620	1	8	29	2,25	2,20	2,36	
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,1910	0,09	-0,25	-0,38	5,5190	-2	8	11	3,61	3,51	3,94	
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,1660	-0,02	-1,35	-0,43	5,9260	1	28	9	6,03	5,85	6,81	
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,0400	0,03	-0,56	-0,73	4,8530	0	11	14	5,62	5,49	6,41	
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,8130	-0,02	-1,58	-0,53	6,0810	1	31	10	6,52	6,33	7,41	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,9030	-0,07	-1,60	-0,48	6,0530	2	29	8	8,22	7,98	9,29	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,3370	-0,10	-2,02	-0,88	6,3940	1	24	11	7,00	6,78	10,28	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,0300	0,06	-1,07	-0,84	5,0540	-1	18	14	8,80	8,58	9,57	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,8590	0,15	-1,20	-0,66	6,2160	-2	19	10	8,59	8,33	10,43	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	67,4530	0,08	-1,29	-0,80	5,4990	-1	18	11	11,09	10,79	13,31	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	101,9470	-0,10	-1,87	-0,91	6,3320	1	20	10	9,15	8,87	13,64	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	67,2540	-0,14	-2,05	-0,76	6,4580	2	25	10	12,28	11,90	17,69	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	89,6830	-0,30	-3,02	-0,70	6,4340	3	25	6	13,20	12,79	27,52	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	63,6780	-0,13	-2,30	-0,81	6,3680	2	24	9	15,00	14,54	27,83	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,1150	-0,22	-2,49	-0,70	6,1340	3	28	8	17,21	16,70	37,70	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	57,4420	-0,02	-2,04	-0,84	6,4970	0	22	9	16,12	15,61	48,98	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,4310	-0,14	-2,02	-0,67	6,4170	2	25	9	16,03	15,53	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	348	-1	-1	23,58	-14	-6	-	5,58	8,63	13,06	13,65	13,60	12,33	9,14	12,93	5,44	3,50	2,15
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	213	0	-6	7,66	48	-230	31,39	2,40	37,80	6,22	12,38	9,80						



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