



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

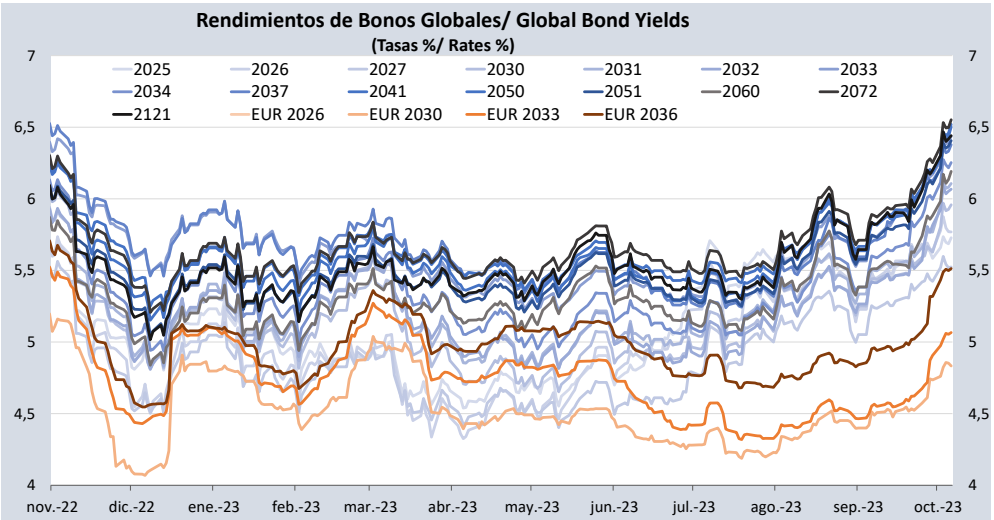
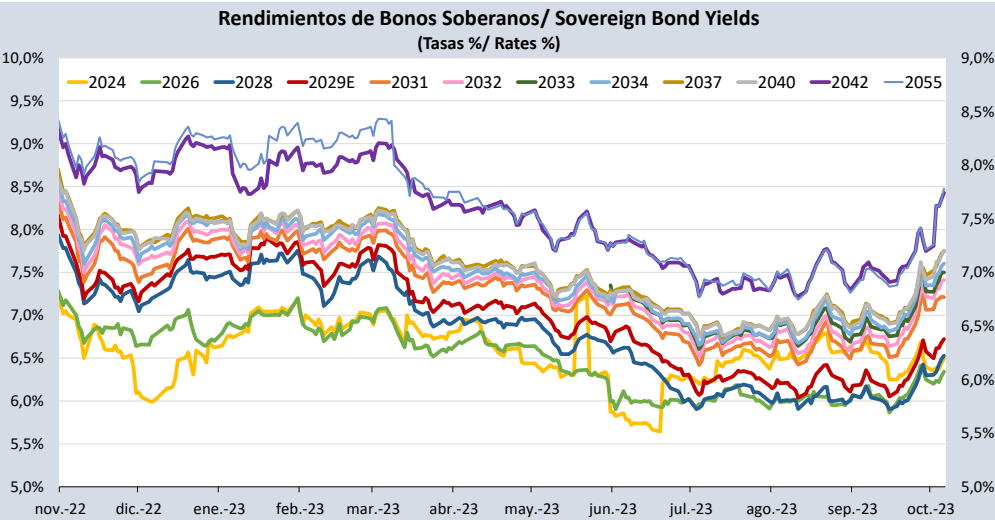
06/10/2023

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	0,85	4 238	5,700	-	-	-	99,3449	-	-	-	6,4921	-	29-sep-23	2	0,85	0,80	0,85
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,23	7 042	8,200	104,66	104,79	104,71	104,7757	6,38	6,33	6,36	6,3420	5	06-oct-23	10	2,62	2,46	2,85
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,95	11 518	6,350	99,00	99,36	99,36	99,2861	6,60	6,51	6,51	6,5276	20	06-oct-23	152	4,27	4,01	4,85
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,89	17 934	5,940	95,38	96,61	96,56	96,5475	7,00	6,71	6,72	6,7219	46	06-oct-23	213	4,68	4,38	5,35
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,04	18 372	6,950	98,34	98,63	98,43	98,5719	7,25	7,20	7,24	7,2092	18	06-oct-23	89	6,19	5,78	7,85
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,92	19 591	6,150	91,94	92,12	92,00	92,0499	7,43	7,40	7,42	7,4107	20	06-oct-23	128	6,90	6,42	8,85
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,30	16 358	7,300	98,76	98,89	98,76	98,7558	7,50	7,48	7,50	7,4997	8	06-oct-23	59	7,12	6,63	9,85
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,81	14 400	5,400	82,85	84,38	84,38	84,0891	7,80	7,56	7,56	7,6031	14	06-oct-23	68	8,13	7,55	10,85
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,03	18 356	6,900	91,93	93,49	93,25	93,1033	7,90	7,70	7,73	7,7481	8	06-oct-23	31	8,98	8,34	13,85
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,80	9 229	5,350	77,49	78,25	77,87	77,8598	7,80	7,70	7,75	7,7500	2	06-oct-23	4	10,54	9,78	16,85
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,02	5 033	6,850	-	-	-	91,5908	-	-	-	7,7422	-	04-oct-23	1	10,40	9,65	18,35
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,00	3 204	6,714	87,66	89,75	88,38	87,8638	7,80	7,60	7,73	7,7800	3	06-oct-23	32	12,48	11,58	31,35
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,29	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,9955	-	-	-	3,4644	-	31-oct-22	2	0,99	0,96	1,02
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,43	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,9955	-	-	-	3,9536	-	18-ago-23	20	5,89	5,67	6,35
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,35	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,7993	-	-	-	4,6429	-	10-jun-22	10	8,28	7,92	11,32
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,47	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,5647	-	-	-	4,7634	-	10-ago-23	50	12,58	12,00	16,35
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,57	424	3,83% + VAC	-	-	-	86,8348	-	-	-	4,7688	-	21-jul-22	2	14,94	14,26	22,85
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,49	383	3,26%+VAC	-	-	-	75,5675	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,83	17,01	30,35

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).

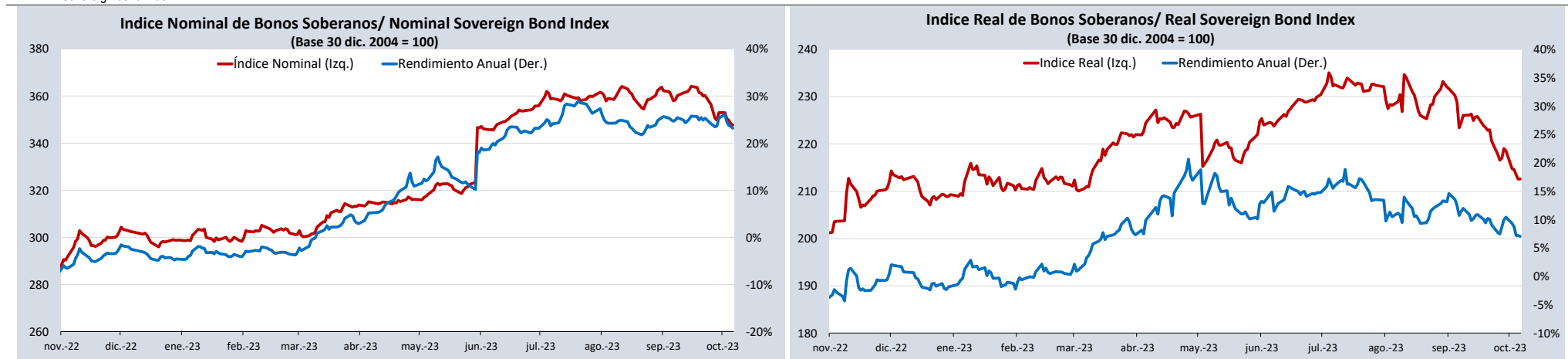


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	102,6920	-0,08	-0,28	-0,46	5,7280	4	14	27	1,69	1,64	1,82
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,8680	0,01	-0,20	-0,53	5,7690	0	13	26	2,24	2,17	2,33
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	95,9530	0,06	-0,08	-0,54	4,6340	-3	5	26	2,25	2,20	2,35
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,1760	-0,02	-0,31	-0,28	5,5240	0	10	8	3,61	3,51	3,94
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,0160	-0,15	-1,60	-0,48	5,9580	3	33	10	6,02	5,85	6,80
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,1440	0,10	-0,50	-0,67	4,8330	-2	10	13	5,62	5,49	6,41
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,6830	-0,13	-1,72	-0,52	6,1070	3	34	10	6,52	6,32	7,41
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,8280	-0,08	-1,39	-0,50	6,0670	1	25	9	8,21	7,97	9,29
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	116,9790	-0,36	-2,23	-1,06	6,4380	4	27	13	6,99	6,77	10,28
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	71,9600	-0,07	-0,93	-0,86	5,0660	1	16	14	8,79	8,58	9,57
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,6270	-0,23	-1,62	-0,67	6,2530	4	26	11	8,59	8,33	10,43
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	67,3560	-0,10	-1,39	-0,84	5,5130	1	20	12	11,09	10,79	13,31
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	101,5270	-0,42	-2,33	-0,92	6,3780	5	25	10	9,14	8,86	13,63
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	66,7610	-0,49	-2,72	-0,74	6,5200	6	34	9	12,26	11,87	17,68
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,8840	-0,80	-3,81	-0,79	6,5020	7	32	7	13,14	12,72	27,51
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	63,3310	-0,35	-2,87	-0,80	6,4060	4	30	9	14,96	14,50	27,83
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,6210	-0,49	-2,74	-0,80	6,1910	6	31	9	17,11	16,60	37,70
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,9450	-0,50	-2,80	-0,84	6,5520	5	30	9	16,01	15,50	48,98
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,2420	-0,19	-1,97	-0,70	6,4410	2	24	9	15,97	15,47	99,23

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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	348	-1	-5	23,17	-41	-214	-	5,58	8,63	13,06	13,68	13,61	12,35	9,14	12,91	5,43	2,13

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	7,04	-16	-339	31,51	2,41	37,87	6,21	12,31	9,68



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