



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

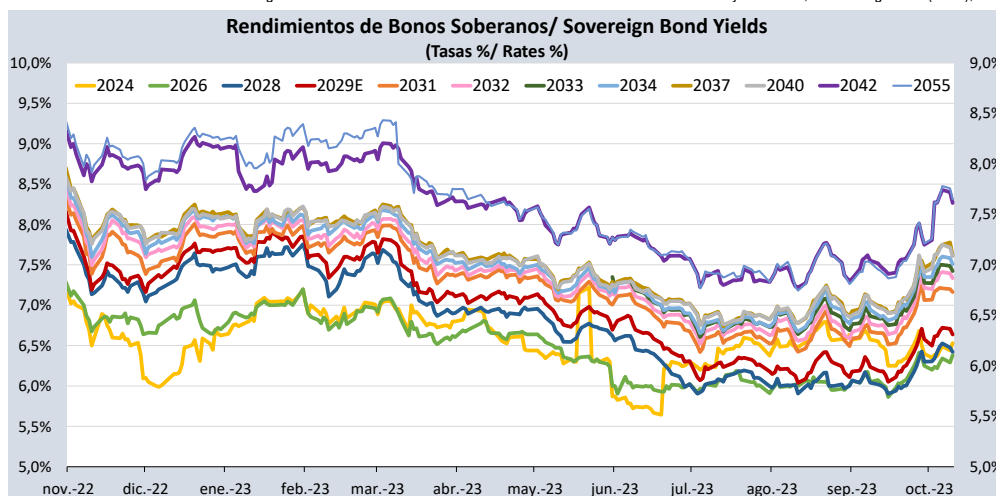
10/10/2023

Bonos soberanos / Sovereign bonds

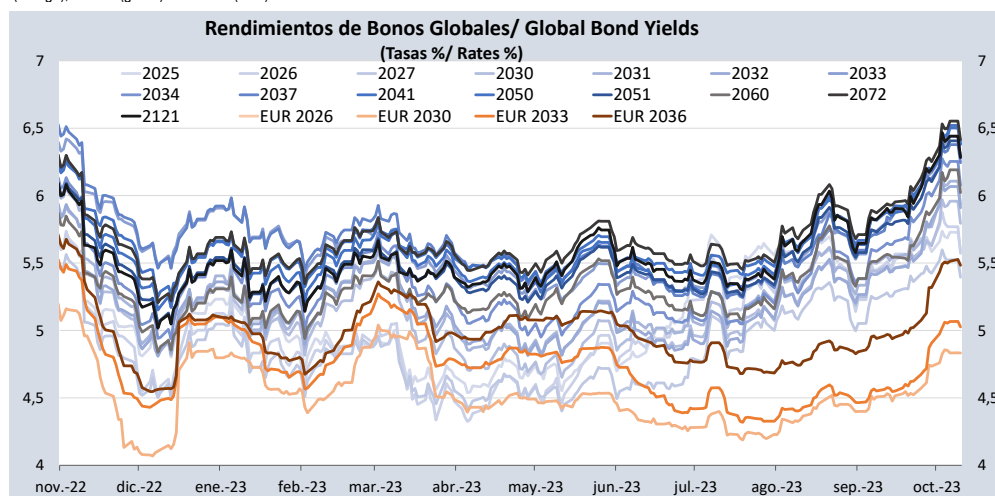
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	0,91	4 238	5,700	-	-	-	99,3230	-	-	-	6,5301	-	29-sep-23	2	0,84	0,79	0,84	
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,31	7 042	8,200	104,65	104,86	104,65	104,6604	6,38	6,30	6,38	6,3800	1	10-oct-23	50	2,60	2,45	2,84	
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,02	11 518	6,350	99,48	99,68	99,72	99,7204	6,48	6,43	6,42	6,4200	1	10-oct-23	2	4,26	4,01	4,84	
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,95	17 934	5,940	96,76	96,95	96,91	96,9189	6,68	6,63	6,64	6,6364	12	10-oct-23	39	4,67	4,38	5,34	
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,11	18 372	6,950	98,63	98,92	98,92	98,8441	7,20	7,15	7,15	7,1622	8	10-oct-23	87	6,19	5,77	7,84	
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,99	19 591	6,150	92,13	92,54	92,49	92,5069	7,40	7,33	7,34	7,3355	29	10-oct-23	159	6,89	6,42	8,84	
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,38	16 358	7,300	99,16	99,50	99,36	99,2746	7,44	7,39	7,41	7,4227	12	10-oct-23	245	7,12	6,63	9,84	
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,87	14 400	5,400	84,23	84,84	84,90	84,7068	7,58	7,49	7,48	7,5088	13	10-oct-23	267	8,13	7,56	10,84	
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,11	18 356	6,900	94,28	94,52	94,36	94,1404	7,60	7,57	7,59	7,6173	41	10-oct-23	363	9,00	8,36	13,84	
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,86	9 229	5,350	77,49	79,27	79,20	78,9762	7,80	7,57	7,58	7,6072	10	10-oct-23	103	10,58	9,83	16,84	
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,10	5 033	6,850	-	-	-	92,7661	-	-	-	7,6122	-	09-oct-23	2	10,44	9,70	18,34	
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,08	3 204	6,714	-	-	-	89,2205	-	-	-	7,6500	-	06-oct-23	32	12,60	11,70	31,34	
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,36	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,9165	-	-	-	3,3962	-	31-oct-22	2	0,98	0,95	1,01	
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,46	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,9165	-	-	-	3,8854	-	18-ago-23	20	5,88	5,66	6,34	
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,43	911	7,39% + VAC	-	-	-	124,7492	-	-	-	4,5457	-	10-jun-22	10	8,29	7,93	11,31	
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,50	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,9349	-	-	-	4,6265	-	10-ago-23	50	12,61	12,05	16,34	
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,61	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,4330	-	-	-	4,6424	-	21-jul-22	2	15,01	14,34	22,84	
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,52	383	3,26%+VAC	-	-	-	77,2327	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,97	17,17	30,34	

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).

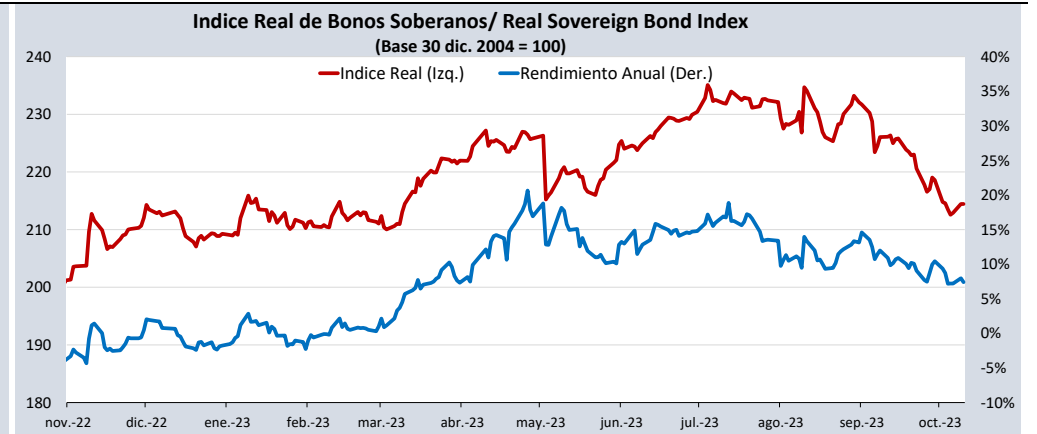
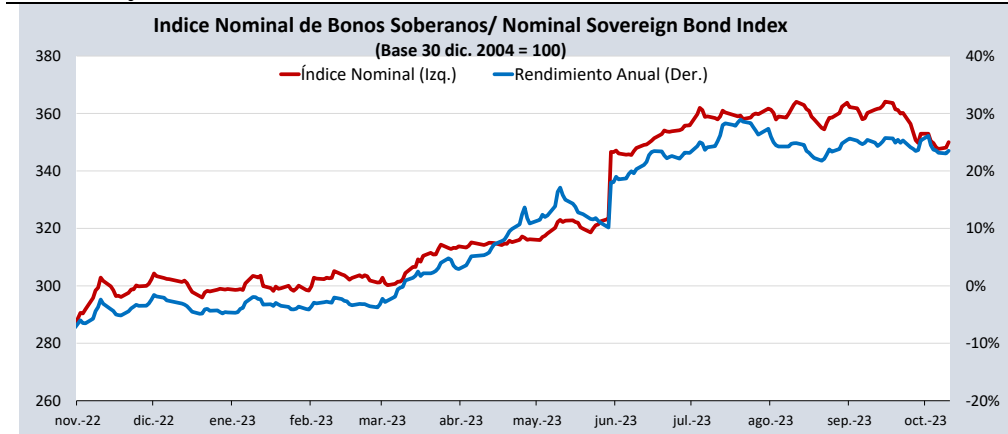


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	102,9150	0,22	0,21	-0,50	5,5940	-13	-14	29	1,68	1,63	1,81
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	93,2740	0,41	0,67	-0,54	5,5720	-20	-30	27	2,23	2,16	2,32
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	95,9920	0,04	-0,03	-0,44	4,6200	-2	3	21	2,24	2,19	2,34
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,6140	0,44	0,70	-0,44	5,3950	-13	-20	13	3,60	3,50	3,93
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,8280	0,81	0,91	-0,42	5,7940	-16	-18	8	6,02	5,85	6,79
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,1500	0,01	-0,03	-0,55	4,8330	0	1	11	5,61	5,48	6,40
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	81,5710	0,89	1,01	-0,54	5,9370	-17	-19	10	6,51	6,32	7,39
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	71,7400	0,91	1,05	-0,61	5,9090	-16	-18	11	8,21	7,97	9,28
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,2460	1,27	1,15	-0,97	6,2830	-15	-14	12	7,00	6,78	10,26
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,2170	0,25	0,01	-0,84	5,0260	-4	1	14	8,78	8,57	9,56
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	76,7680	1,14	1,30	-0,62	6,0760	-18	-20	10	8,59	8,34	10,42
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	67,5820	0,31	0,08	-0,81	5,4830	-4	-1	11	11,08	10,78	13,30
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	102,7440	1,22	1,06	-0,89	6,2440	-13	-12	10	9,15	8,88	13,62
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	67,8550	1,09	0,67	-0,77	6,3850	-14	-8	9	12,30	11,92	17,67
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	90,3310	1,45	0,72	-0,77	6,3790	-12	-6	6	13,24	12,83	27,50
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	64,4600	1,13	0,96	-0,80	6,2850	-12	-10	8	15,07	14,61	27,81
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,1030	1,48	1,32	-0,77	6,0220	-17	-15	9	17,39	16,88	37,69
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,2040	1,26	1,08	-0,85	6,4140	-14	-12	9	16,27	15,77	48,97
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,5220	1,28	1,49	-0,69	6,2820	-16	-19	8	16,36	15,86	99,22

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	350	2	0	23,51	47	-98	-	5,54	8,61	13,03	13,63	13,60	12,34	9,15	12,98	5,47	3,51	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	214	0	0	7,39	-58	-133	31,24		2,40		37,85		6,27		12,43		9,81	



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