



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

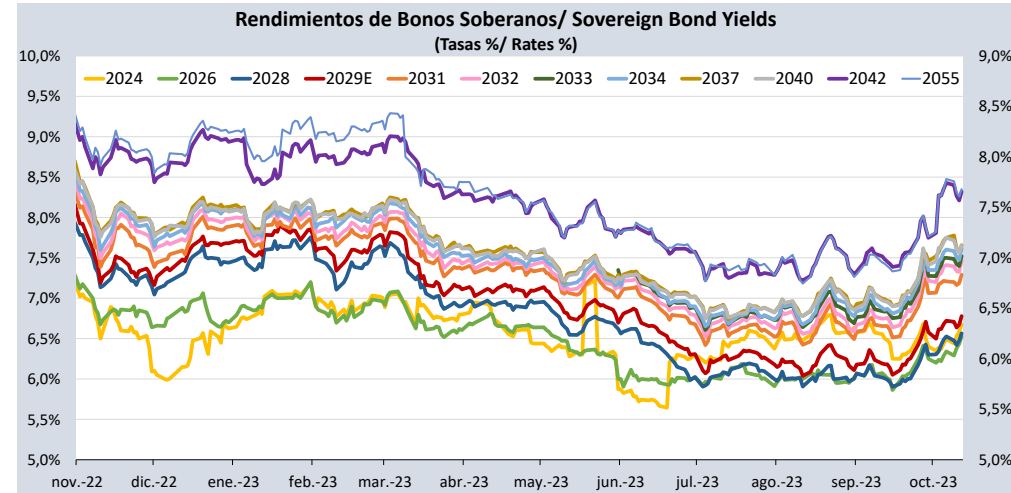
12/10/2023

Bonos soberanos / Sovereign bonds

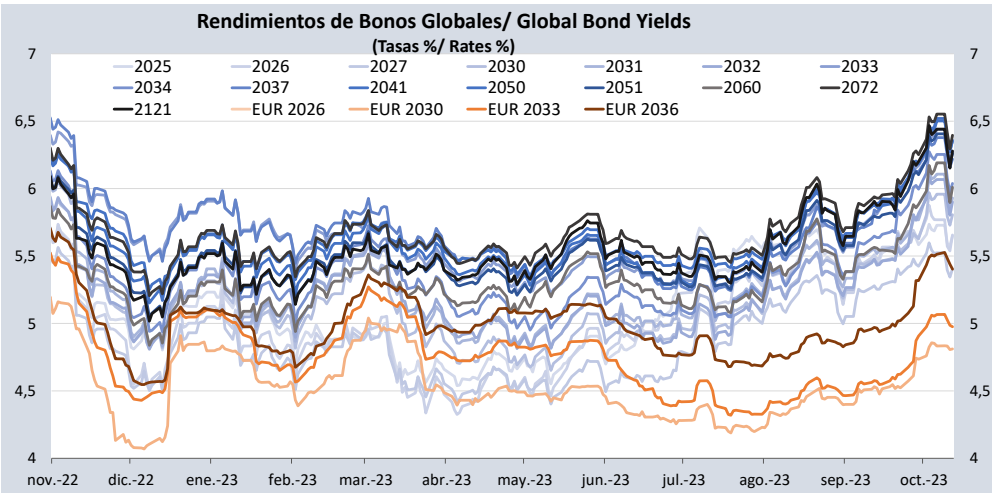
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración /	Duración	Vida media
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones 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	0,94	4 238	5,700	-	-	-	99,2137	-	-	-	6,6751	-	29-sep-23	2	0,83	0,78	0,84
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,36	7 042	8,200	-	-	-	104,2777	-	-	-	6,5250	-	10-oct-23	50	2,60	2,44	2,84
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,05	11 518	6,350	99,32	99,80	99,12	99,1385	6,52	6,40	6,57	6,5650	2	12-oct-23	4	4,25	3,99	4,84
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,98	17 934	5,940	96,57	96,83	96,23	96,3148	6,72	6,66	6,80	6,7787	20	12-oct-23	98	4,66	4,36	5,34
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,15	18 372	6,950	98,34	98,92	98,06	98,1125	7,25	7,15	7,30	7,2898	5	12-oct-23	81	6,17	5,75	7,84
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,02	19 591	6,150	92,01	92,37	91,60	91,7512	7,42	7,36	7,49	7,4627	12	12-oct-23	174	6,88	6,40	8,84
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,42	16 358	7,300	98,76	99,16	98,36	98,6121	7,50	7,44	7,56	7,5216	11	12-oct-23	180	7,10	6,61	9,84
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,90	14 400	5,400	84,39	85,01	83,82	84,0159	7,56	7,47	7,65	7,6170	22	12-oct-23	122	8,11	7,53	10,84
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,14	18 356	6,900	94,04	94,68	93,49	93,8279	7,63	7,55	7,70	7,6568	14	12-oct-23	277	8,99	8,35	13,84
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,89	9 229	5,350	78,77	79,44	78,65	78,6293	7,64	7,55	7,65	7,6520	9	12-oct-23	241	10,55	9,80	16,84
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,14	5 033	6,850	-	-	-	92,3740	-	-	-	7,6555	-	09-oct-23	2	10,42	9,68	18,34
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,11	3 204	6,714	87,66	89,75	88,91	88,9050	7,80	7,60	7,68	7,6800	1	12-oct-23	7	12,56	11,67	31,34
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,40	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,7542	-	-	-	3,5289	-	31-oct-22	2	0,97	0,94	1,01
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,48	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,7542	-	-	-	4,0181	-	18-ago-23	20	5,87	5,65	6,34
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,47	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,7982	-	-	-	4,6404	-	10-jun-22	10	8,27	7,90	11,31
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,52	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,5110	-	-	-	4,6692	-	10-ago-23	50	12,59	12,03	16,34
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,63	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,9562	-	-	-	4,6800	-	21-jul-22	2	14,98	14,31	22,84
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,54	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,8330	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,93	17,12	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).

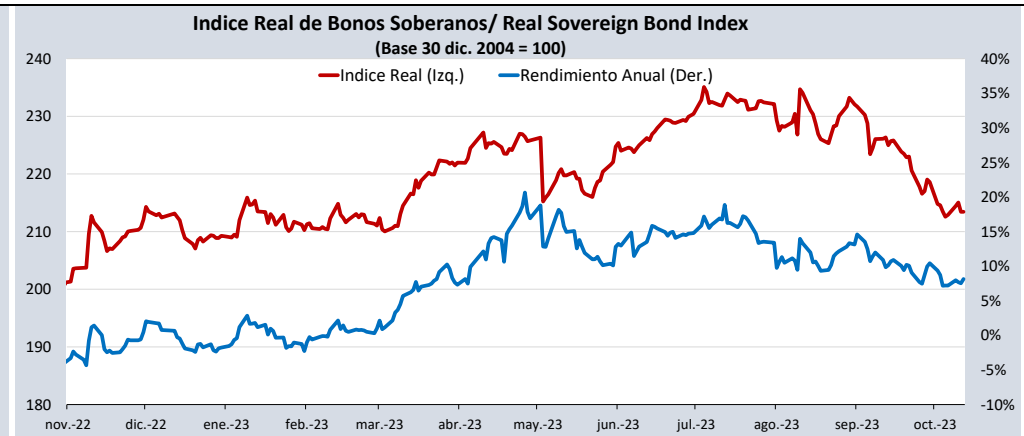
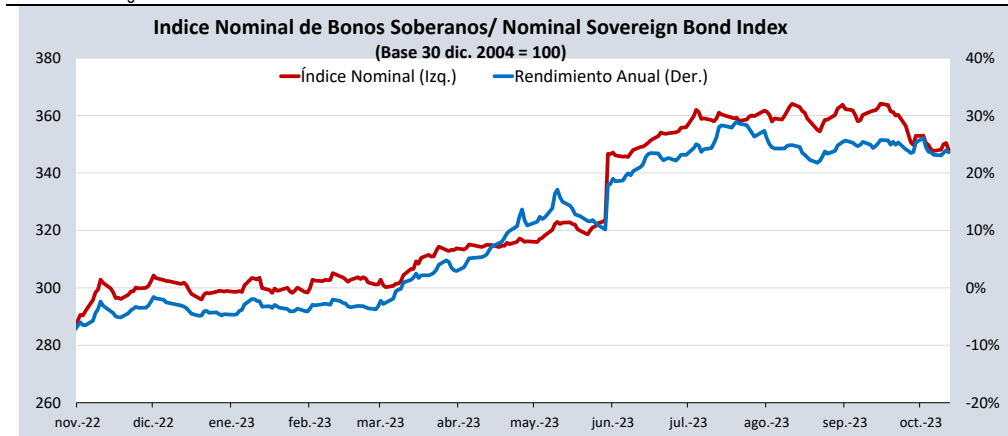


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	102,8060	-0,14	0,04	-0,46	5,6490	7	-4	27	1,67	1,63	1,80	
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	93,1340	-0,22	0,28	-0,54	5,6560	12	-11	27	2,22	2,16	2,32	
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,0440	-0,06	0,15	-0,59	4,6030	3	-6	29	2,23	2,18	2,34	
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,5900	-0,20	0,40	-0,34	5,4050	6	-11	10	3,59	3,50	3,93	
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,7900	-0,37	0,62	-0,43	5,8060	8	-12	9	6,01	5,84	6,79	
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,2730	-0,02	0,23	-0,73	4,8110	0	-4	14	5,60	5,47	6,39	
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	81,6230	-0,43	0,81	-0,42	5,9310	9	-15	8	6,51	6,32	7,39	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	71,8120	-0,55	0,91	-0,54	5,9010	10	-15	9	8,20	7,97	9,27	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,3240	-0,64	0,99	-0,92	6,2720	8	-12	11	6,99	6,78	10,26	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,5450	0,08	0,52	-0,81	4,9760	-1	-8	13	8,78	8,57	9,55	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	77,0310	-0,42	1,17	-0,69	6,0380	7	-18	11	8,59	8,34	10,41	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,1840	0,28	0,73	-0,77	5,4030	-4	-10	11	11,09	10,79	13,29	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	102,9700	-0,59	1,02	-0,75	6,2190	6	-11	8	9,15	8,88	13,62	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	68,0720	-0,73	0,82	-0,72	6,3590	9	-10	9	12,30	11,92	17,67	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	90,6690	-0,82	0,99	-0,63	6,3510	7	-8	5	13,25	12,85	27,50	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	64,7060	-0,80	1,03	-0,81	6,2600	8	-11	9	15,09	14,63	27,81	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,2160	-1,04	1,10	-0,67	6,0100	11	-12	8	17,40	16,90	37,68	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,3870	-0,95	0,95	-0,80	6,3950	10	-10	9	16,30	15,80	48,96	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,5520	-1,07	1,12	-0,62	6,2790	13	-14	7	16,36	15,86	99,22	

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index																		
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	-2	0	23,59	-37	1	-	5,55	8,61	13,03	13,61	13,57	12,34	9,13	13,01	5,48	3,51	2,15
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	1	8,15	61	95	31,35		2,39		37,76		6,26		12,43		9,81	



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