



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

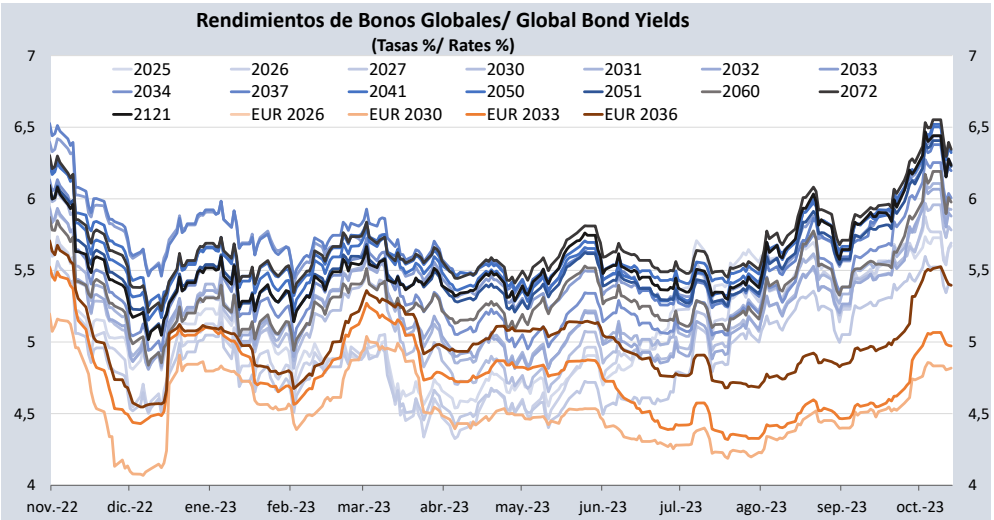
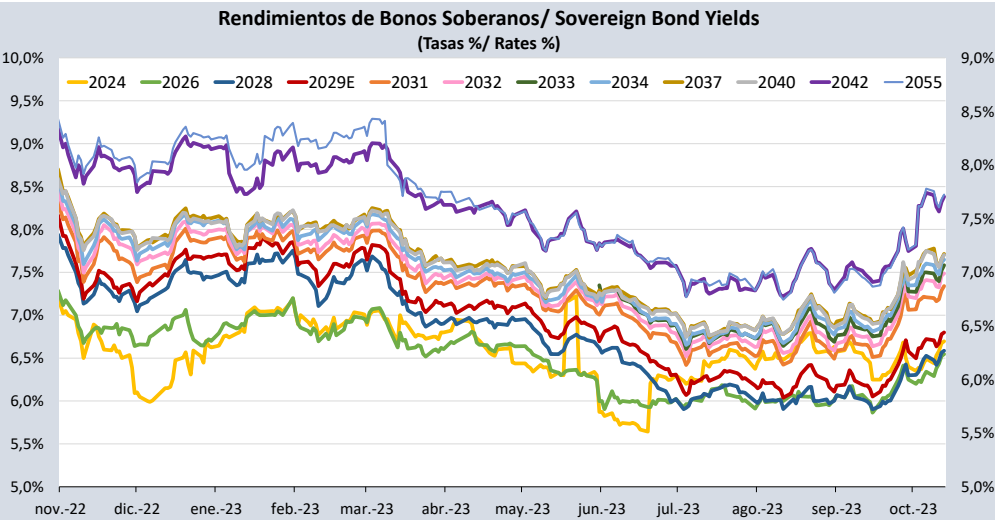
13/10/2023

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	0,96	4 238	5,700	-	-	-	99,1998	-	-	-	6,6962	-	29-sep-23	2	0,83	0,78	0,83
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,38	7 042	8,200	-	-	-	104,2196	-	-	-	6,5461	-	10-oct-23	50	2,60	2,44	2,83
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,07	11 518	6,350	-	-	-	99,0546	-	-	-	6,5861	-	12-oct-23	4	4,25	3,99	4,83
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,00	17 934	5,940	95,94	96,40	96,11	96,2269	6,87	6,76	6,83	6,7998	8	13-oct-23	45	4,66	4,36	5,33
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,17	18 372	6,950	97,66	99,67	97,66	97,8281	7,37	7,02	7,37	7,3398	9	13-oct-23	66	6,17	5,75	7,83
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,04	19 591	6,150	91,25	91,78	91,31	91,6113	7,55	7,46	7,54	7,4866	14	13-oct-23	67	6,87	6,39	8,83
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,44	16 358	7,300	97,90	100,79	98,09	98,2060	7,63	7,20	7,60	7,5827	12	13-oct-23	48	7,09	6,59	9,83
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,91	14 400	5,400	83,44	84,01	83,63	83,8186	7,71	7,62	7,68	7,6483	18	13-oct-23	77	8,10	7,53	10,83
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,16	18 356	6,900	92,71	93,65	93,10	93,3712	7,80	7,68	7,75	7,7147	23	13-oct-23	67	8,97	8,33	13,83
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,90	9 229	5,350	77,69	78,66	77,96	78,2333	7,78	7,65	7,74	7,7032	15	13-oct-23	134	10,53	9,78	16,83
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,15	5 033	6,850	-	-	-	91,9183	-	-	-	7,7061	-	09-oct-23	2	10,40	9,65	18,33
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,13	3 204	6,714	87,66	88,91	88,38	88,4349	7,80	7,68	7,73	7,7250	2	13-oct-23	6	12,52	11,62	31,33
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,42	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,7237	-	-	-	3,5606	-	31-oct-22	2	0,97	0,94	1,00
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,49	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,7237	-	-	-	4,0498	-	18-ago-23	20	5,87	5,64	6,33
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,49	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,4531	-	-	-	4,6749	-	10-jun-22	10	8,26	7,89	11,30
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,53	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,0078	-	-	-	4,7200	-	10-ago-23	50	12,57	12,00	16,33
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,65	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,3590	-	-	-	4,7274	-	21-jul-22	2	14,95	14,27	22,83
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,55	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,2516	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,87	17,06	30,33

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).

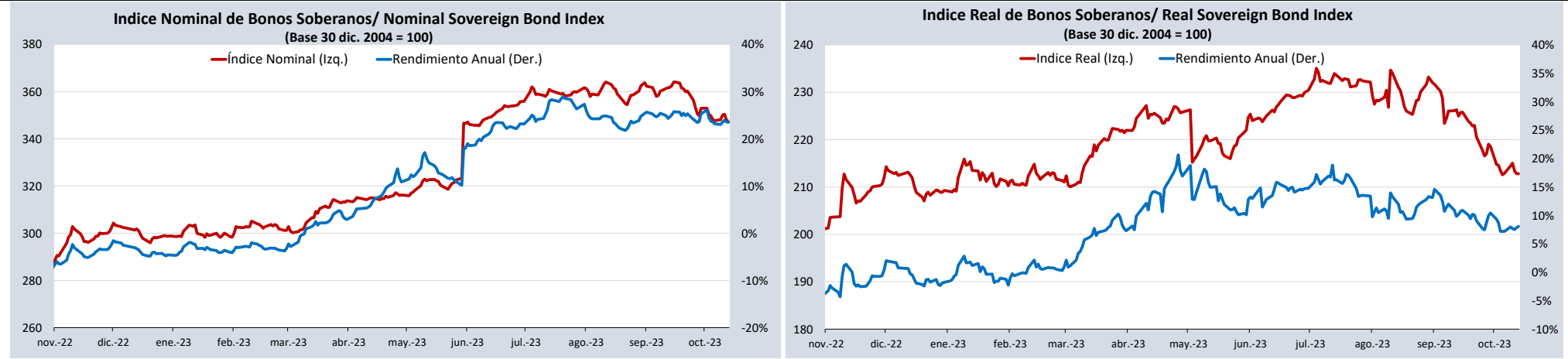
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	102,7640	-0,04	0,07	-0,45	5,6710	2	-6	27	1,67	1,62	1,80
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	93,0720	-0,06	0,20	-0,55	5,6910	4	-8	27	2,22	2,16	2,31
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,0520	0,01	0,10	-0,72	4,6020	0	-3	35	2,23	2,18	2,33
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,6200	0,03	0,44	-0,42	5,3970	-1	-13	13	3,59	3,49	3,92
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,9160	0,13	0,90	-0,39	5,7820	-2	-18	8	6,01	5,84	6,78
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,2380	-0,03	0,09	-0,77	4,8180	1	-2	15	5,60	5,47	6,39
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	81,6580	0,03	0,97	-0,52	5,9250	-1	-18	10	6,50	6,32	7,39
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	71,9440	0,13	1,12	-0,49	5,8790	-2	-19	9	8,20	7,97	9,27
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,5520	0,23	1,57	-0,90	6,2440	-3	-19	11	6,99	6,78	10,26
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,5750	0,03	0,62	-0,82	4,9720	0	-9	14	8,78	8,57	9,55
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	77,2440	0,21	1,62	-0,63	6,0060	-3	-25	10	8,59	8,34	10,41
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,2370	0,05	0,88	-0,76	5,3960	-1	-12	10	11,08	10,79	13,29
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	103,1860	0,22	1,66	-0,81	6,1960	-2	-18	9	9,16	8,88	13,61
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	68,3770	0,30	1,62	-0,74	6,3220	-4	-20	9	12,31	11,93	17,66
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	90,8430	0,17	1,96	-0,78	6,3360	-1	-17	7	13,27	12,86	27,49
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,0250	0,32	1,69	-0,79	6,2260	-3	-18	8	15,12	14,66	27,81
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,5180	0,30	1,90	-0,70	5,9770	-3	-21	8	17,46	16,95	37,68
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,8500	0,46	1,91	-0,72	6,3460	-5	-21	8	16,40	15,90	48,96
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,9230	0,37	1,68	-0,64	6,2340	-4	-21	8	16,48	15,98	99,21

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	347	-1	0	23,52	-7	35	-	5,57	8,63	13,05	13,61	13,58	12,32	9,13	12,99	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	213	0	0	8,08	25	87	31,44	2,39	37,77	6,25	12,38	9,77						



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