



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

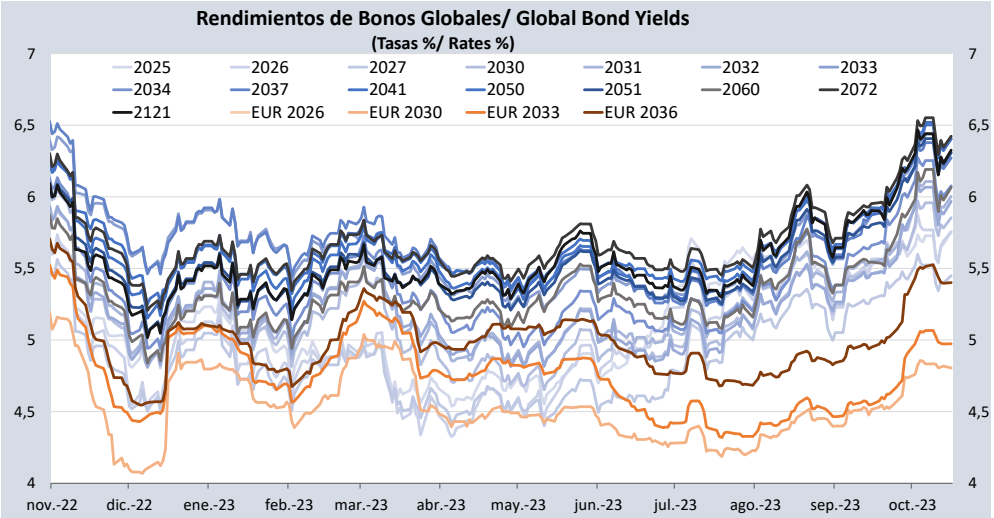
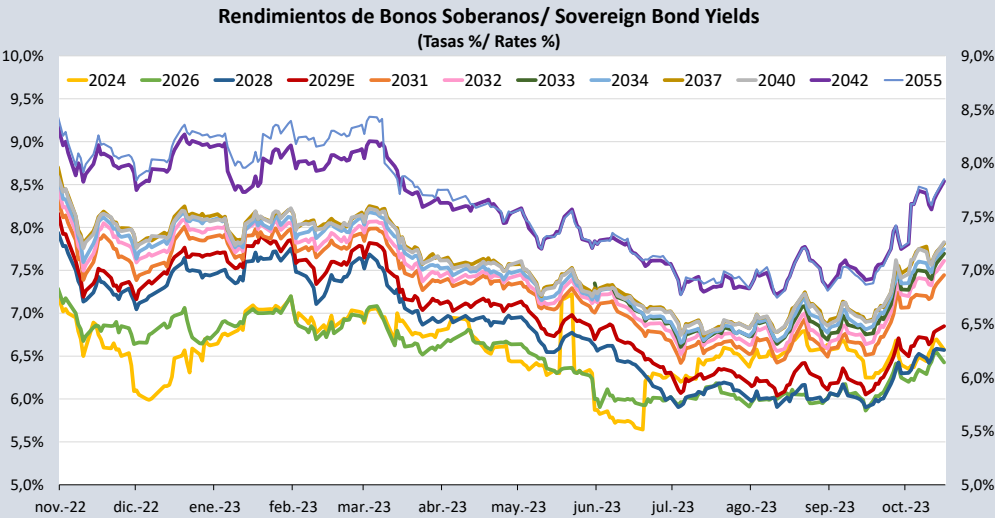
16/10/2023

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	1,01	4 238	5,700	-	-	-	99,3000	-	-	-	6,5764	-	29-sep-23	2	0,82	0,77	0,83
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,45	7 042	8,200	104,44	104,68	104,57	104,5166	6,45	6,36	6,40	6,4263	7	16-oct-23	16	2,59	2,43	2,83
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,12	11 518	6,350	98,84	99,38	99,08	99,1187	6,64	6,51	6,58	6,5704	3	16-oct-23	104	4,24	3,98	4,83
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,05	17 934	5,940	95,86	96,11	96,09	96,0255	6,89	6,83	6,84	6,8486	11	16-oct-23	22	4,65	4,35	5,33
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,23	18 372	6,950	97,21	97,66	97,38	97,2344	7,45	7,37	7,42	7,4450	6	16-oct-23	12	6,15	5,73	7,83
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,09	19 591	6,150	90,72	91,31	91,13	90,8793	7,64	7,54	7,57	7,6119	14	16-oct-23	266	6,85	6,37	8,83
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,50	16 358	7,300	97,70	97,96	97,76	97,4620	7,66	7,62	7,65	7,6957	25	16-oct-23	296	7,07	6,57	9,83
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,95	14 400	5,400	82,69	83,51	83,38	83,1924	7,83	7,70	7,72	7,7483	4	16-oct-23	12	8,08	7,50	10,83
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,22	18 356	6,900	92,24	93,10	92,63	92,6136	7,86	7,75	7,81	7,8118	13	16-oct-23	282	8,94	8,29	13,83
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,94	9 229	5,350	76,69	77,81	77,42	77,2745	7,91	7,76	7,81	7,8289	3	16-oct-23	127	10,48	9,72	16,83
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,21	5 033	6,850	-	-	-	90,8014	-	-	-	7,8318	-	09-oct-23	2	10,34	9,58	18,33
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,19	3 204	6,714	-	-	-	87,1441	-	-	-	7,8507	-	13-oct-23	6	12,39	11,49	31,33
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	0,06	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,8099	-	-	-	3,6289	-	31-oct-22	2	0,99	0,96	1,00
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,51	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,8099	-	-	-	4,1181	-	18-ago-23	20	5,86	5,63	6,33
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,55	911	7,39% + VAC	-	-	-	122,5023	-	-	-	4,7706	-	10-jun-22	10	8,24	7,86	11,30
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,55	228	3,14%+VAC	-	-	-	80,8702	-	-	-	4,8365	-	10-ago-23	50	12,53	11,95	16,33
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,68	424	3,83% + VAC	-	-	-	85,8589	-	-	-	4,8485	-	21-jul-22	2	14,86	14,17	22,83
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,58	383	3,26%+VAC	-	-	-	74,6913	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,72	16,90	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).

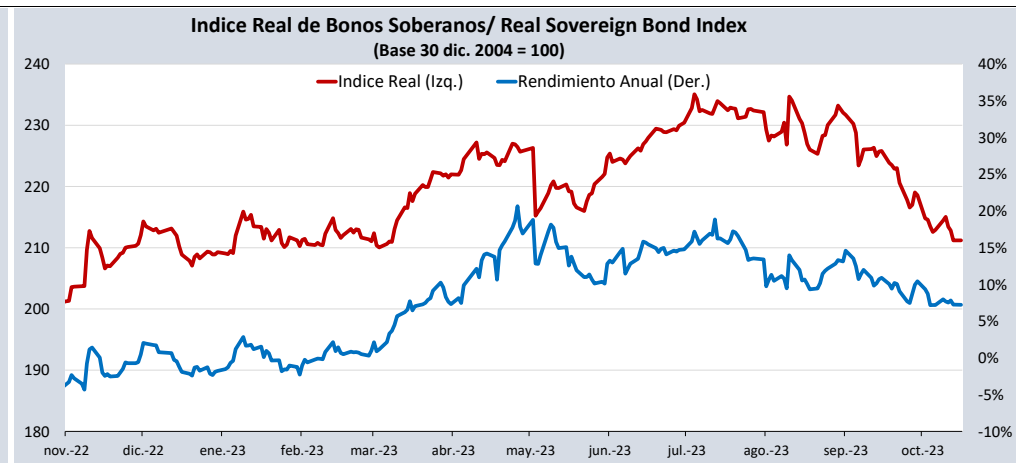
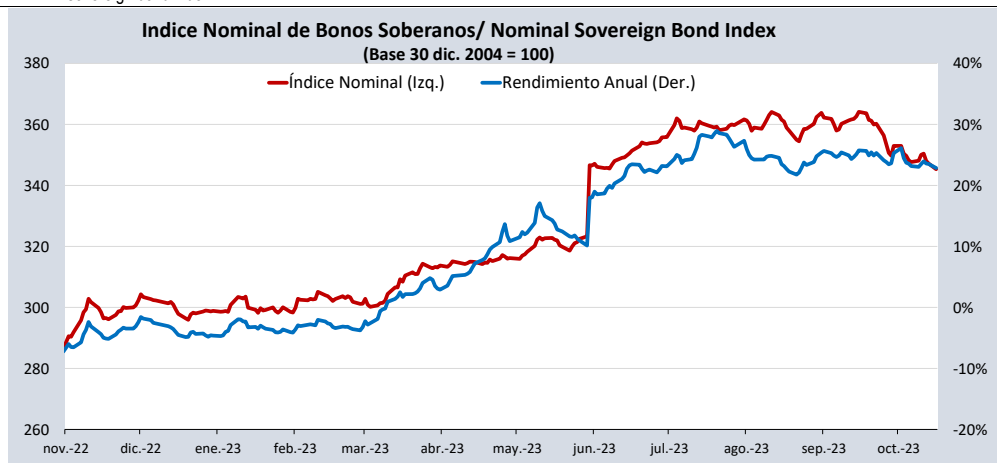
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	102,6200	-0,14	-0,07	-0,50	5,7540	8	3	30	1,66	1,62	1,79
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,9490	-0,12	0,08	-0,53	5,7560	7	-1	27	2,21	2,15	2,31
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,1160	0,06	0,16	-0,59	4,5730	-3	-6	29	2,22	2,17	2,33
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,4460	-0,17	0,27	-0,38	5,4500	5	-7	11	3,58	3,48	3,91
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	83,5650	-0,35	0,55	-0,46	5,8540	7	-10	9	6,00	5,83	6,78
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,3100	0,07	0,17	-0,73	4,8050	-1	-3	14	5,59	5,46	6,38
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	81,2600	-0,40	0,58	-0,52	6,0030	8	-10	10	6,49	6,30	7,38
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	71,4410	-0,50	0,61	-0,53	5,9680	9	-10	9	8,19	7,95	9,26
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,9970	-0,56	1,02	-0,85	6,3100	7	-13	10	6,98	6,76	10,25
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,5690	-0,01	0,61	-0,83	4,9740	0	-9	14	8,77	8,56	9,54
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	76,7920	-0,45	1,17	-0,65	6,0760	7	-18	10	8,57	8,32	10,40
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,2090	-0,03	0,94	-0,73	5,4010	0	-13	10	11,07	10,78	13,28
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	102,4880	-0,70	0,96	-0,86	6,2720	8	-11	9	9,13	8,85	13,61
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	67,7060	-0,67	0,95	-0,75	6,4050	8	-11	9	12,27	11,89	17,66
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	90,0360	-0,81	1,15	-0,74	6,4040	7	-10	6	13,20	12,79	27,49
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	64,2660	-0,76	0,94	-0,76	6,3060	8	-10	8	15,03	14,57	27,80
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,7190	-0,80	1,10	-0,69	6,0660	9	-13	8	17,30	16,79	37,67
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,1230	-0,73	1,18	-0,80	6,4230	8	-13	9	16,24	15,73	48,95
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,1620	-0,76	0,92	-0,64	6,3260	9	-12	8	16,23	15,73	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	345	-2	-3	22,87	-65	-17	-	5,61	8,69	13,10	13,61	13,56	12,30	9,12	12,96	5,43	3,48	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	211	0	-3	7,23	-3	-75	31,71	2,40	37,77	6,21	12,27	9,64						



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