



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

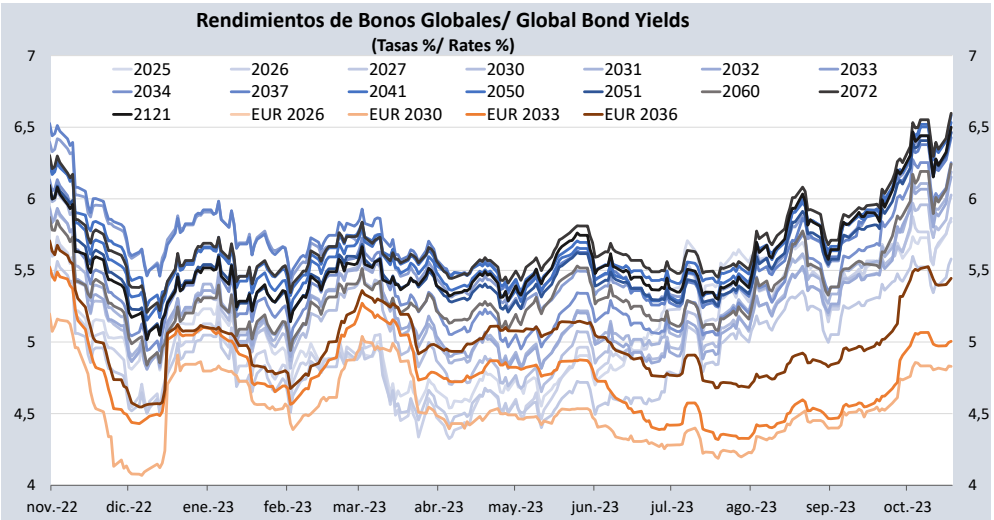
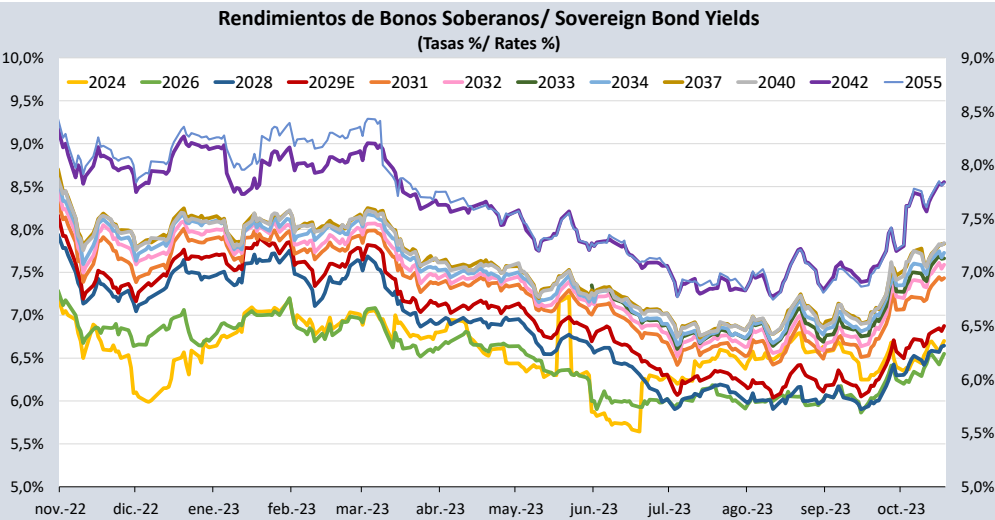
18/10/2023

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	Postura / Position	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Postura / Position	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
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	1,04	4 238	5,700	-	-	-	99,2088	-	-	-	6,7010	-	29-sep-23	2	0,82	0,77	0,82
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,49	7 042	8,200	-	-	-	104,1890	-	-	-	6,5509	-	16-oct-23	16	2,58	2,42	2,82
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,16	11 518	6,350	-	-	-	98,8228	-	-	-	6,6450	-	17-oct-23	94	4,24	3,97	4,82
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,08	17 934	5,940	95,91	96,20	95,91	95,9176	6,88	6,81	6,88	6,8750	3	18-oct-23	4	4,64	4,34	5,32
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,27	18 372	6,950	97,10	97,55	97,27	97,3019	7,47	7,39	7,44	7,4333	12	18-oct-23	146	6,15	5,72	7,82
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,12	19 591	6,150	90,79	92,74	91,14	91,0105	7,63	7,30	7,57	7,5902	15	18-oct-23	220	6,85	6,37	8,82
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,54	16 358	7,300	97,44	99,43	97,60	97,6784	7,70	7,40	7,68	7,6630	13	18-oct-23	391	7,07	6,57	9,82
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,98	14 400	5,400	83,39	83,83	83,39	83,3280	7,72	7,65	7,72	7,7277	14	18-oct-23	26	8,08	7,50	10,82
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,26	18 356	6,900	92,17	93,42	92,40	92,4576	7,87	7,71	7,84	7,8321	6	18-oct-23	26	8,93	8,28	13,82
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,97	9 229	5,350	76,98	78,20	77,12	77,1765	7,87	7,71	7,85	7,8423	5	18-oct-23	183	10,47	9,71	16,82
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,25	5 033	6,850	-	-	-	90,7164	-	-	-	7,8416	-	09-oct-23	2	10,33	9,57	18,32
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,22	3 204	6,714	87,66	88,91	87,36	87,3551	7,80	7,68	7,83	7,8300	1	18-oct-23	15	12,40	11,50	31,32
13-oct-24	PEP01000C789	SB13OCT24	0,09	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,7437	-	-	-	3,5734	-	31-oct-22	2	0,99	0,96	0,99
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,53	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,7437	-	-	-	4,0626	-	18-ago-23	20	5,85	5,63	6,32
31-ene-35	PEP01000C785	SB31ENE35	1,59	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,2835	-	-	-	4,6900	-	10-jun-22	10	8,24	7,87	11,29
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,57	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,3892	-	-	-	4,7838	-	10-ago-23	50	12,54	11,97	16,32
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,70	424	3,83% + VAC	-	-	-	86,6952	-	-	-	4,7809	-	21-jul-22	2	14,90	14,22	22,82
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,59	383	3,26%+VAC	-	-	-	75,7818	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,81	17,00	30,32

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).

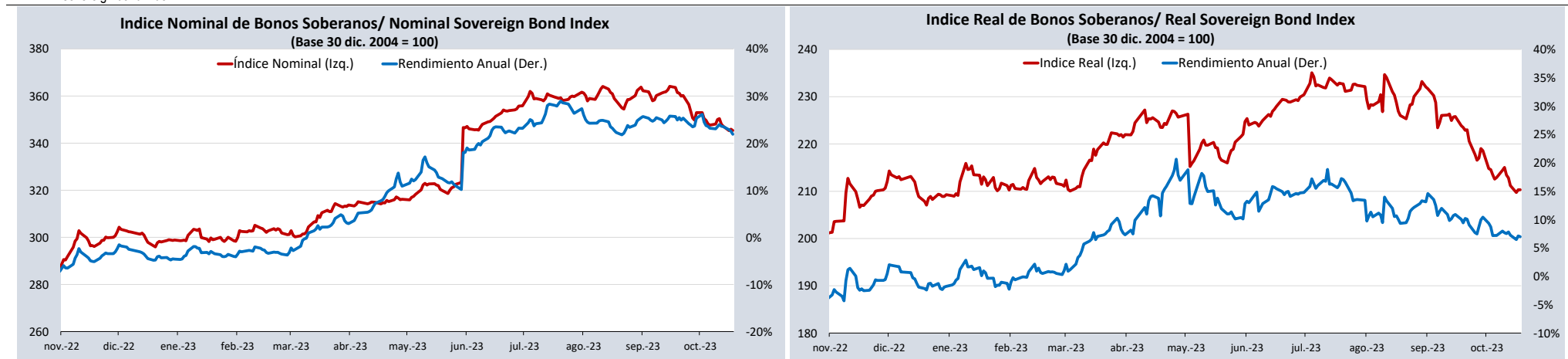


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	102,4690	-0,03	-0,47	-0,47	5,8400	1	27	28	1,66	1,61	1,78
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,7510	-0,08	-0,60	-0,54	5,8640	4	33	27	2,20	2,14	2,30
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,1310	0,08	0,03	-0,50	4,5700	-4	0	24	2,21	2,17	2,32
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,0190	-0,14	-0,77	-0,29	5,5800	4	24	9	3,57	3,48	3,91
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	82,7290	-0,31	-1,43	-0,46	6,0270	7	30	9	5,99	5,81	6,77
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,1840	0,02	-0,11	-0,64	4,8300	0	2	12	5,59	5,45	6,38
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,3270	-0,35	-1,73	-0,52	6,1880	7	34	10	6,48	6,29	7,37
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,4020	-0,41	-1,96	-0,56	6,1530	7	35	10	8,18	7,93	9,26
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	116,7060	-0,53	-2,26	-0,87	6,4680	7	27	11	6,95	6,73	10,24
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,3950	-0,04	-0,07	-0,82	5,0050	1	2	14	8,76	8,55	9,53
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,6780	-0,50	-1,78	-0,64	6,2520	8	28	10	8,55	8,29	10,39
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	67,8980	-0,15	-0,01	-0,76	5,4450	2	1	10	11,06	10,77	13,28
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	101,0810	-0,67	-2,48	-0,78	6,4280	8	27	9	9,09	8,81	13,60
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	66,2790	-0,73	-2,52	-0,77	6,5850	9	32	10	12,20	11,81	17,65
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,5280	-0,78	-2,96	-0,66	6,5330	7	25	6	13,08	12,66	27,48
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,8290	-0,69	-2,68	-0,78	6,4620	8	29	9	14,88	14,41	27,79
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,2030	-0,77	-3,05	-0,74	6,2420	9	35	9	16,99	16,48	37,66
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,5470	-0,69	-2,79	-0,78	6,5970	8	30	9	15,88	15,38	48,95
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	49,7800	-0,61	-2,84	-0,69	6,5000	8	35	9	15,79	15,29	99,20

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	345	-1	-5	21,89	-64	-208	-	5,60	8,66	13,09	13,62	13,58	12,33	9,13	12,94	5,43	2,14

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	210	0	-3	6,99	-13	-55	30,83	2,42	38,20	6,28	12,44	9,83



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