



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

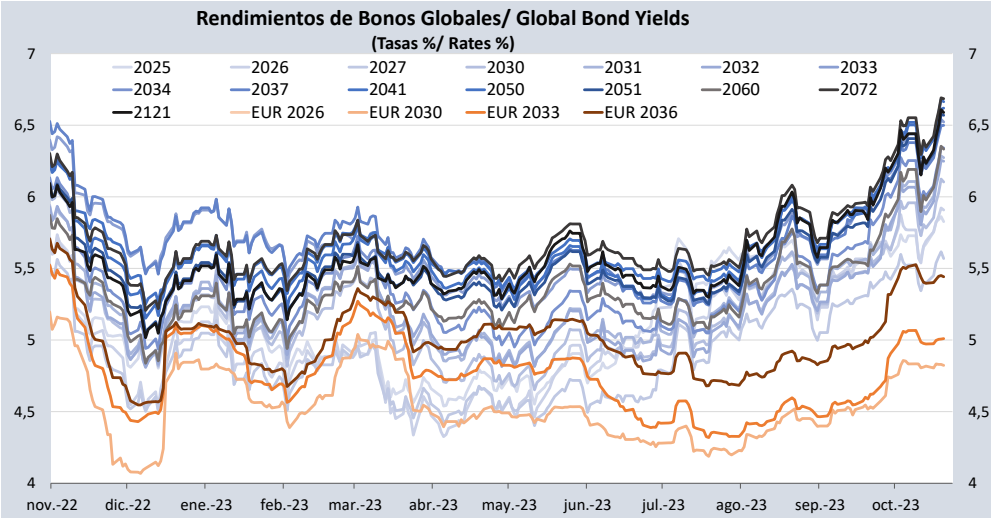
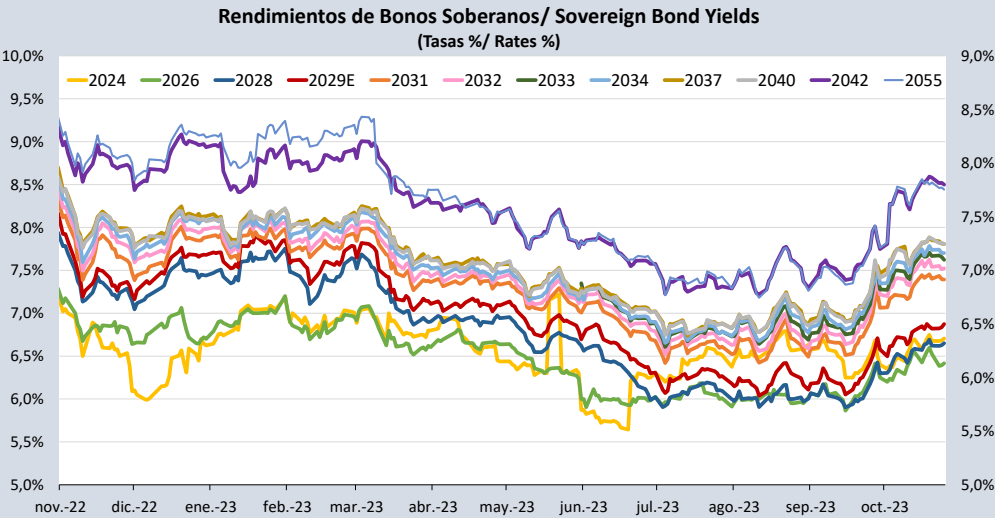
25/10/2023

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	1,15	4 238	5,700	-	-	-	99,2232	-	-	-	6,7060	-	25-oct-23	0	0,80	0,75	0,80
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,65	7 042	8,200	-	-	-	104,5070	-	-	-	6,4162	-	16-oct-23	16	2,56	2,41	2,80
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,28	11 518	6,350	98,61	98,89	98,77	98,8073	6,70	6,63	6,66	6,6500	7	25-oct-23	14	4,22	3,95	4,80
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,19	17 934	5,940	95,63	96,00	95,96	95,9322	6,95	6,86	6,87	6,8745	13	25-oct-23	34	4,62	4,32	5,30
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,40	18 372	6,950	96,94	97,39	97,27	97,5378	7,50	7,42	7,44	7,3924	9	25-oct-23	93	6,13	5,71	7,80
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,24	19 591	6,150	91,09	91,39	91,27	91,4158	7,58	7,53	7,55	7,5236	29	25-oct-23	202	6,83	6,36	8,80
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,68	16 358	7,300	97,64	98,77	97,84	97,9534	7,67	7,50	7,64	7,6220	13	25-oct-23	122	7,06	6,56	9,80
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,09	14 400	5,400	83,28	83,56	83,46	83,5112	7,74	7,70	7,71	7,7018	7	25-oct-23	42	8,06	7,49	10,80
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,39	18 356	6,900	92,41	93,11	92,71	92,6549	7,84	7,75	7,80	7,8075	12	25-oct-23	359	8,92	8,27	13,80
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,08	9 229	5,350	77,18	77,83	77,41	77,4853	7,85	7,76	7,82	7,8034	6	25-oct-23	95	10,46	9,71	16,80
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,38	5 033	6,850	-	-	-	91,0990	-	-	-	7,7988	-	09-oct-23	2	10,32	9,58	18,30
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,35	3 204	6,714	-	-	-	88,1437	-	-	-	7,7534	-	20-oct-23	3	12,46	11,56	31,30
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	0,22	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,6777	-	-	-	3,5572	-	31-oct-22	2	0,97	0,94	0,97
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,58	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,6777	-	-	-	4,0464	-	18-ago-23	20	5,84	5,61	6,30
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,73	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,4990	-	-	-	4,6651	-	10-jun-22	10	8,23	7,86	11,27
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,63	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,7519	-	-	-	4,7484	-	10-ago-23	50	12,53	11,96	16,30
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,77	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,3622	-	-	-	4,7280	-	21-jul-22	2	14,91	14,24	22,80
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,66	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,7308	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,88	17,08	30,30

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.