



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

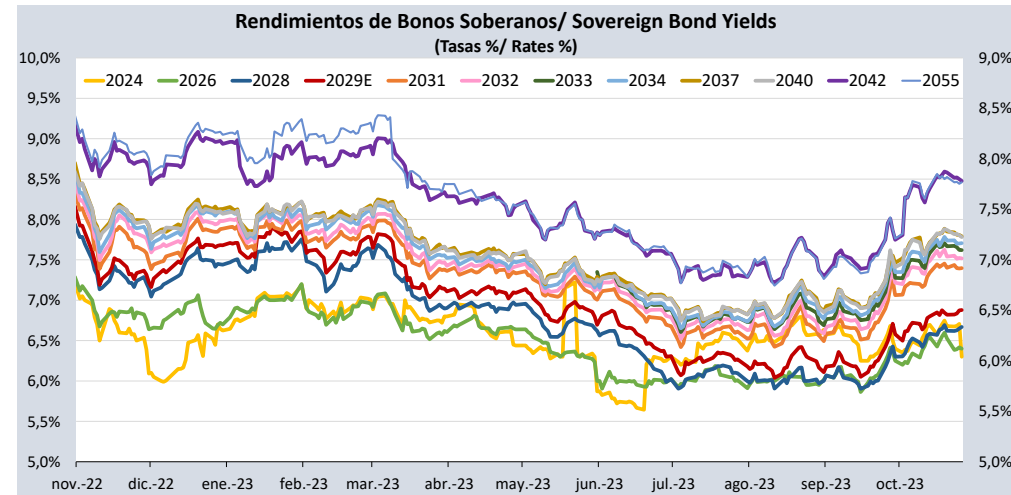
26/10/2023

Bonos soberanos / Sovereign bonds

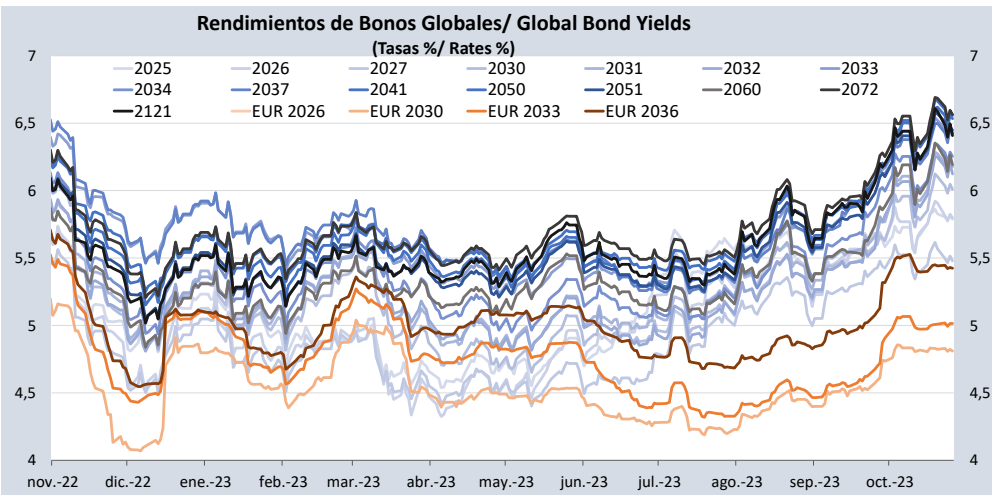
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	1,16	4 238	5,700	99,50	99,58	99,54	99,5302	6,35	6,25	6,30	6,3000	1	26-oct-23	2	0,79	0,75	0,80
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,67	7 042	8,200	104,02	104,52	104,52	104,5444	6,60	6,40	6,40	6,4000	5	26-oct-23	18	2,56	2,41	2,80
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,29	11 518	6,350	98,61	98,81	98,73	98,7321	6,70	6,65	6,67	6,6692	20	26-oct-23	49	4,21	3,95	4,80
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,21	17 934	5,940	95,84	96,05	95,92	95,9181	6,90	6,85	6,88	6,8783	3	26-oct-23	6	4,62	4,32	5,30
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,42	18 372	6,950	97,50	97,73	97,56	97,5142	7,40	7,36	7,39	7,3967	15	26-oct-23	76	6,13	5,71	7,80
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,25	19 591	6,150	90,98	91,57	91,57	91,4531	7,60	7,50	7,50	7,5176	16	26-oct-23	66	6,83	6,35	8,80
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,70	16 358	7,300	97,87	98,77	98,04	97,9613	7,64	7,50	7,61	7,6209	13	26-oct-23	63	7,05	6,55	9,80
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,10	14 400	5,400	83,35	83,79	83,67	83,4817	7,73	7,66	7,68	7,7069	15	26-oct-23	107	8,06	7,48	10,80
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,41	18 356	6,900	92,56	92,95	92,95	92,7874	7,82	7,77	7,77	7,7906	18	26-oct-23	538	8,92	8,27	13,80
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,09	9 229	5,350	77,14	77,83	77,75	77,6499	7,85	7,76	7,77	7,7821	7	26-oct-23	14	10,47	9,71	16,80
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,40	5 033	6,850	-	-	-	91,2558	-	-	-	7,7812	-	09-oct-23	2	10,33	9,58	18,30
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,37	3 204	6,714	87,46	88,23	88,08	87,9943	7,82	7,75	7,76	7,7679	4	26-oct-23	19	12,44	11,54	31,30
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	0,24	884	6,84% + VAC	-	-	-	104,0188	-	-	-	3,5611	-	31-oct-22	2	0,96	0,94	0,97
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,59	77	2,89%+VAC	-	-	-	104,0188	-	-	-	4,0503	-	18-ago-23	20	5,83	5,61	6,30
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,75	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,4790	-	-	-	4,6667	-	10-jun-22	10	8,22	7,86	11,27
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,64	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,9513	-	-	-	4,7284	-	10-ago-23	50	12,53	11,97	16,30
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,78	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,4422	-	-	-	4,7217	-	21-jul-22	2	14,91	14,24	22,80
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,67	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,5774	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,86	17,06	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).

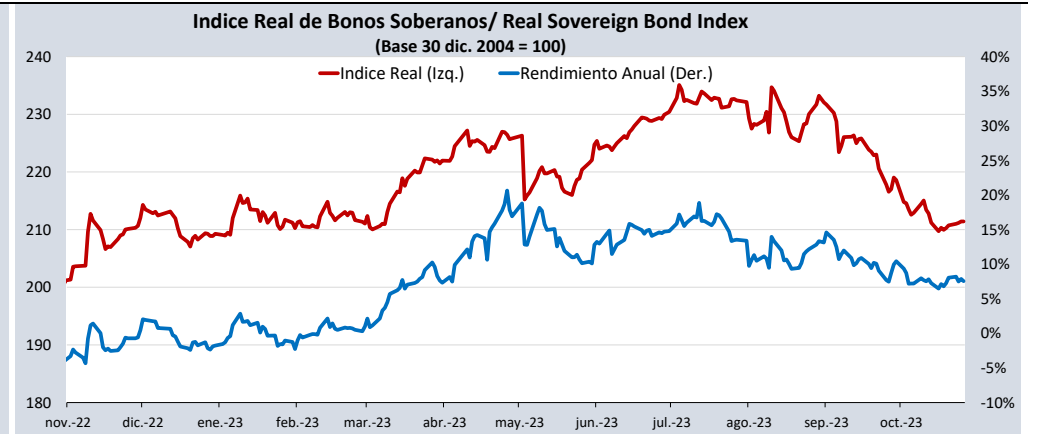
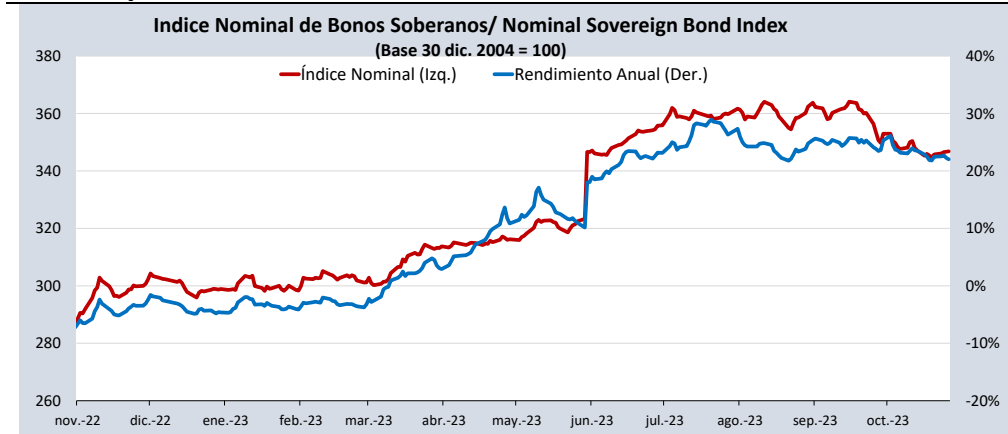


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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 / 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	102,5160	0,03	0,10	-0,45	5,7880	-3	-7	27	1,63	1,59	1,76
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,9620	0,08	0,30	-0,44	5,7990	-3	-12	23	2,18	2,12	2,28
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,1940	0,05	0,07	-0,48	4,5610	-2	-2	23	2,19	2,14	2,30
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,3850	0,13	0,48	-0,34	5,4790	-4	-14	10	3,55	3,46	3,89
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	82,8720	0,20	0,59	-0,43	6,0100	-4	-11	9	5,97	5,79	6,75
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,3080	0,07	0,12	-0,55	4,8100	-1	-2	11	5,56	5,43	6,36
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,4450	0,29	0,59	-0,51	6,1760	-5	-11	10	6,46	6,27	7,35
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,6310	0,46	0,78	-0,45	6,1240	-8	-13	8	8,15	7,91	9,23
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,0040	0,31	0,88	-0,89	6,4270	-4	-11	11	6,94	6,72	10,22
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,4000	0,02	0,00	-0,82	5,0150	0	1	14	8,74	8,53	9,51
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,7160	0,22	0,62	-0,64	6,2530	-3	-9	10	8,53	8,27	10,37
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,0950	0,05	0,22	-0,72	5,4240	-1	-3	10	11,04	10,75	13,25
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	101,1060	0,27	0,65	-0,80	6,4240	-3	-7	9	9,07	8,79	13,58
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	66,5210	0,25	0,97	-0,73	6,5580	-3	-12	9	12,19	11,80	17,63
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,5370	0,34	0,90	-0,69	6,5330	-3	-8	6	13,06	12,64	27,46
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,9710	0,28	1,18	-0,79	6,4480	-3	-13	9	14,87	14,40	27,77
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,6330	0,61	1,36	-0,69	6,1920	-7	-16	8	17,05	16,54	37,64
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,8410	0,28	1,12	-0,76	6,5640	-3	-13	9	15,93	15,42	48,93
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,5050	0,68	1,55	-0,54	6,4080	-9	-20	7	15,99	15,50	99,18

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	0	2	22,03	-23	21	-	5,60	8,63	13,05	13,62	13,61	12,34	9,12	12,95	5,44	3,49	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	211	0	1	7,55	-31	30	30,80		2,41		38,11		6,29		12,50		9,89	



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