



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

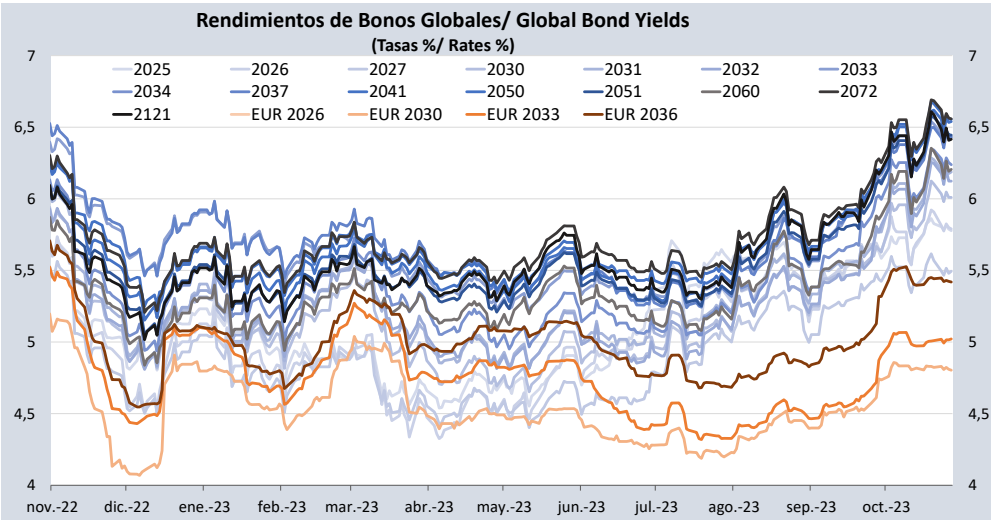
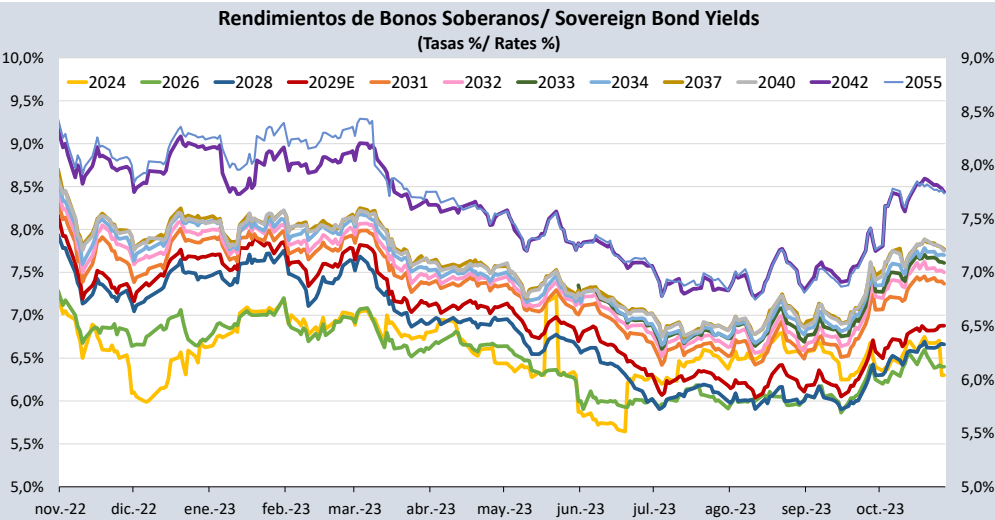
27/10/2023

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	1,18	4 238	5,700	-	-	-	99,5318	-	-	-	6,3000	-	26-oct-23	2	0,79	0,74	0,79
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,69	7 042	8,200	104,42	104,52	104,52	104,5405	6,44	6,40	6,40	6,4000	2	27-oct-23	32	2,56	2,40	2,79
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,31	11 518	6,350	98,62	98,75	98,77	98,7691	6,70	6,67	6,66	6,6600	1	27-oct-23	1	4,21	3,95	4,79
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,23	17 934	5,940	95,84	96,01	95,97	95,9199	6,90	6,86	6,87	6,8783	2	27-oct-23	12	4,62	4,32	5,29
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,44	18 372	6,950	97,61	97,73	97,67	97,6839	7,38	7,36	7,37	7,3668	18	27-oct-23	273	6,13	5,71	7,79
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,27	19 591	6,150	91,36	91,69	91,57	91,5588	7,54	7,48	7,50	7,5000	3	27-oct-23	70	6,83	6,35	8,79
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,72	16 358	7,300	97,97	98,24	98,10	98,0412	7,62	7,58	7,60	7,6089	17	27-oct-23	75	7,05	6,55	9,79
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,12	14 400	5,400	83,61	83,73	83,61	83,5231	7,69	7,67	7,69	7,7008	13	27-oct-23	95	8,06	7,48	10,79
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,43	18 356	6,900	92,64	92,99	92,95	92,9482	7,81	7,77	7,77	7,7701	11	27-oct-23	151	8,92	8,28	13,79
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,10	9 229	5,350	77,83	77,99	77,91	77,8939	7,76	7,74	7,75	7,7505	7	27-oct-23	21	10,48	9,72	16,79
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,41	5 033	6,850	-	-	-	91,5376	-	-	-	7,7496	-	09-oct-23	2	10,34	9,59	18,29
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,39	3 204	6,714	-	-	-	88,3216	-	-	-	7,7363	-	26-oct-23	19	12,47	11,57	31,29
13-oct-24	PEP01000C789	SB13OCT24	0,26	884	6,84% + VAC	-	-	-	104,0074	-	-	-	3,5495	-	31-oct-22	2	0,96	0,94	0,96
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,60	77	2,89%+VAC	-	-	-	104,0074	-	-	-	4,0387	-	18-ago-23	20	5,83	5,60	6,29
31-ene-35	PEP01000C785	SB31ENE35	1,77	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,5555	-	-	-	4,6585	-	10-jun-22	10	8,22	7,86	11,26
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,65	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,2396	-	-	-	4,6995	-	10-ago-23	50	12,54	11,97	16,29
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,79	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,8299	-	-	-	4,6910	-	21-jul-22	2	14,93	14,26	22,79
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,67	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,9845	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,90	17,10	30,29

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).

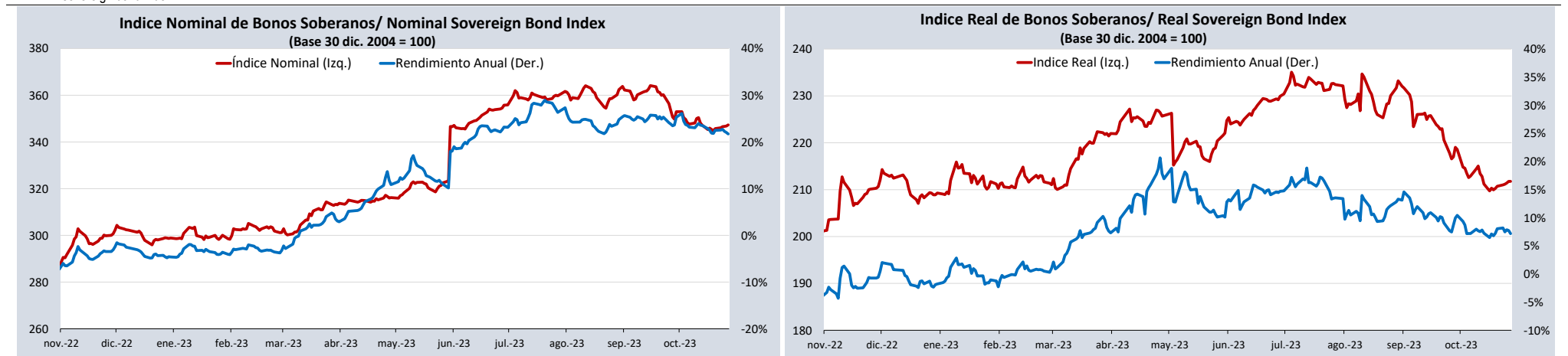


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	102,5350	0,02	0,06	-0,43	5,7770	-1	-5	26	1,63	1,59	1,76
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,9800	0,02	0,28	-0,49	5,7900	-1	-12	25	2,18	2,12	2,28
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,2310	0,04	0,08	-0,65	4,5450	-2	-2	32	2,19	2,14	2,29
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,3350	-0,05	0,27	-0,43	5,4940	1	-8	13	3,55	3,45	3,88
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	82,8710	0,00	0,49	-0,45	6,0100	0	-9	9	5,96	5,79	6,74
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,3490	0,04	0,12	-0,73	4,8030	-1	-2	14	5,56	5,43	6,35
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,3910	-0,05	0,47	-0,50	6,1870	1	-9	10	6,46	6,26	7,35
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,6370	0,01	0,74	-0,48	6,1230	0	-13	9	8,15	7,91	9,23
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	116,9990	-0,01	0,74	-0,82	6,4280	0	-9	10	6,93	6,72	10,22
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,3640	-0,04	-0,03	-0,82	5,0220	1	1	14	8,74	8,52	9,51
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,8160	0,10	0,68	-0,62	6,2380	-1	-10	10	8,53	8,27	10,37
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,1360	0,04	0,20	-0,75	5,4190	-1	-2	10	11,04	10,75	13,25
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	101,0270	-0,08	0,58	-0,81	6,4330	1	-7	9	9,07	8,78	13,58
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	66,5390	0,02	0,87	-0,72	6,5550	0	-11	9	12,19	11,80	17,63
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,4700	-0,07	0,92	-0,75	6,5390	1	-8	7	13,05	12,63	27,46
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,9930	0,02	1,12	-0,78	6,4450	0	-12	9	14,87	14,40	27,77
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,5220	-0,11	1,08	-0,67	6,2050	1	-13	8	17,03	16,52	37,64
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,8960	0,05	1,12	-0,76	6,5580	-1	-13	9	15,94	15,43	48,92
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,4420	-0,06	1,34	-0,56	6,4160	1	-17	7	15,97	15,47	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	21,73	-30	-76	-	5,60	8,62	13,03	13,62	13,61	12,33	9,12	12,96	5,45	3,50	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	212	0	1	7,19	-54	-86	30,75	2,41	38,08	6,30	12,53	9,93



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