



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

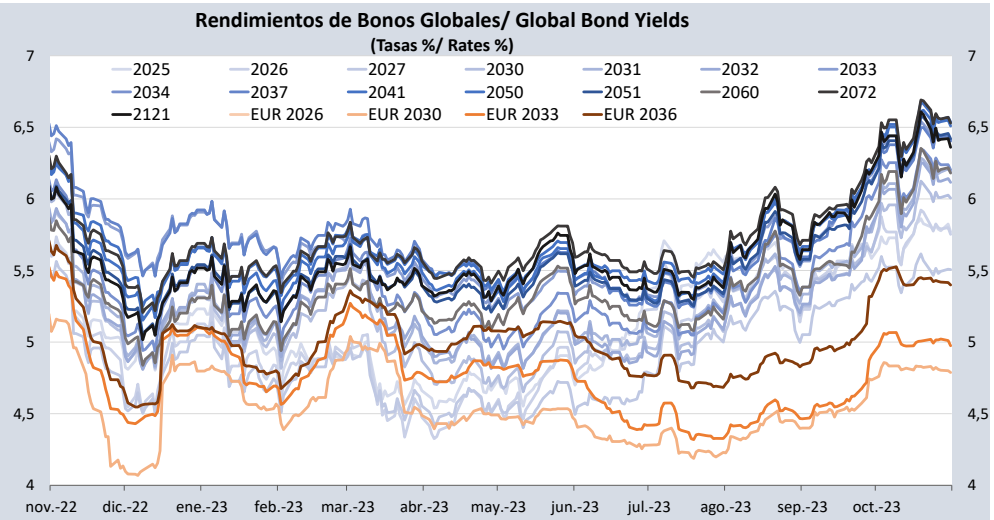
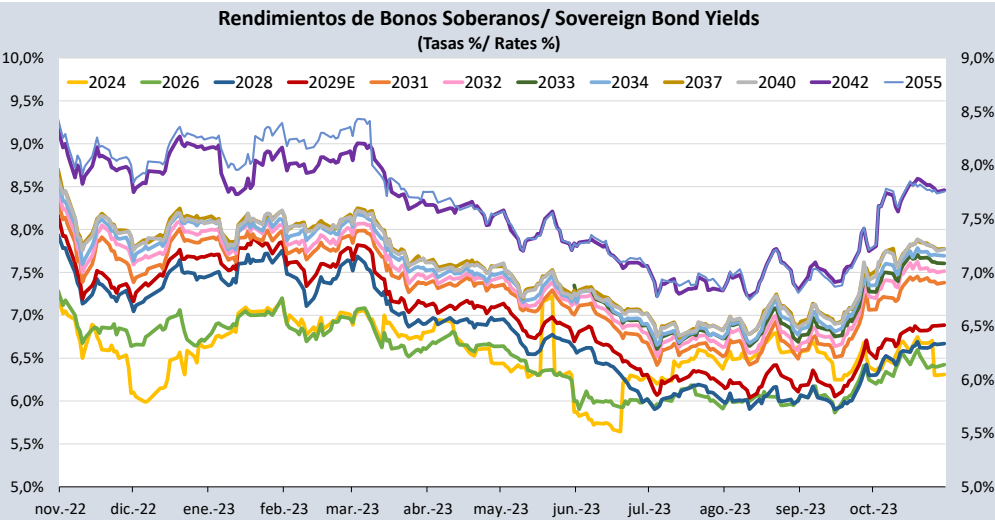
30/10/2023

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	1,22	4 238	5,700	-	-	-	99,5292	-	-	-	6,3100	-	26-oct-23	2	0,78	0,74	0,79
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,76	7 042	8,200	-	-	-	104,4649	-	-	-	6,4250	-	27-oct-23	32	2,55	2,39	2,79
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,36	11 518	6,350	98,46	98,73	98,73	98,7317	6,74	6,67	6,67	6,6700	2	30-oct-23	6	4,20	3,94	4,79
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,28	17 934	5,940	95,84	95,93	95,93	95,8973	6,90	6,88	6,88	6,8850	8	30-oct-23	110	4,61	4,31	5,29
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,49	18 372	6,950	97,56	97,67	97,61	97,6086	7,39	7,37	7,38	7,3805	5	30-oct-23	28	6,12	5,70	7,79
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,32	19 591	6,150	91,40	91,81	91,57	91,4774	7,53	7,46	7,50	7,5148	24	30-oct-23	265	6,82	6,34	8,79
12-ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,78	16 358	7,300	97,87	98,37	98,10	98,0689	7,64	7,56	7,60	7,6050	8	30-oct-23	16	7,04	6,55	9,79
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,16	14 400	5,400	83,53	83,86	83,80	83,5719	7,70	7,65	7,66	7,6944	4	30-oct-23	16	8,05	7,47	10,79
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,48	18 356	6,900	92,64	93,19	93,11	92,9063	7,81	7,74	7,75	7,7758	15	30-oct-23	250	8,91	8,27	13,79
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,15	9 229	5,350	77,68	78,06	77,91	77,7614	7,78	7,73	7,75	7,7685	9	30-oct-23	26	10,46	9,71	16,79
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,47	5 033	6,850	-	-	-	91,3793	-	-	-	7,7676	-	09-oct-23	2	10,32	9,58	18,29
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,44	3 204	6,714	-	-	-	88,1361	-	-	-	7,7543	-	26-oct-23	19	12,44	11,55	31,29
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	0,32	884	6,84% + VAC	-	-	-	103,9638	-	-	-	3,5576	-	31-oct-22	2	0,95	0,93	0,96
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,62	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,9638	-	-	-	4,0468	-	18-ago-23	20	5,82	5,60	6,29
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,83	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,5970	-	-	-	4,6530	-	10-jun-22	10	8,22	7,85	11,26
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,67	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,1030	-	-	-	4,7139	-	10-ago-23	50	12,52	11,96	16,29
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,82	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,6256	-	-	-	4,7074	-	21-jul-22	2	14,91	14,24	22,79
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,70	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,7702	-	-	-	4,0788	-	12-ago-21	10	17,87	17,07	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).

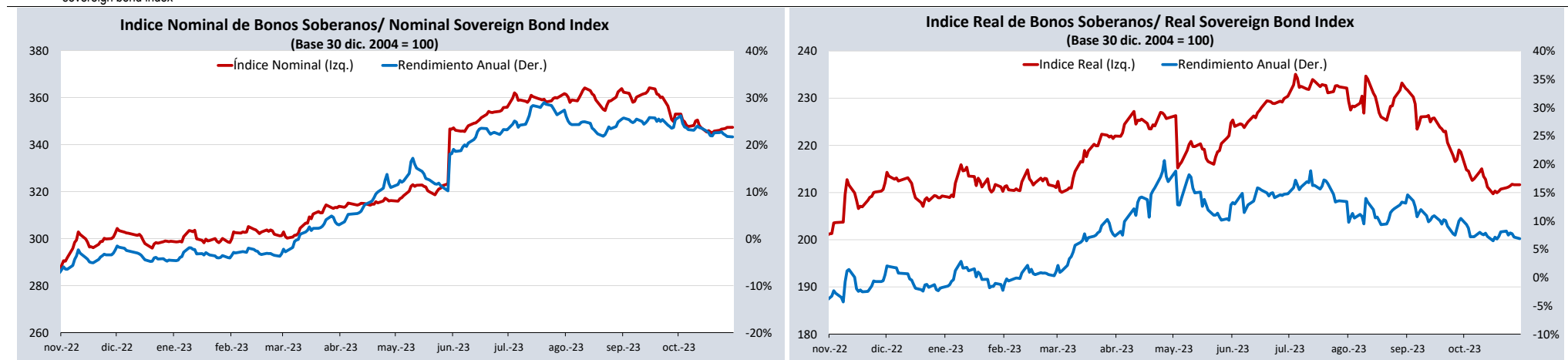


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	102,4540	-0,08	-0,05	-0,45	5,8240	5	2	27	1,62	1,58	1,75
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	92,9700	-0,01	0,08	-0,45	5,7990	1	-1	23	2,17	2,11	2,27
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	96,2470	0,02	0,14	-0,53	4,5390	-1	-6	26	2,18	2,13	2,29
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	95,2860	-0,05	-0,03	-0,36	5,5090	2	1	11	3,54	3,44	3,88
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	82,8000	-0,07	0,08	-0,50	6,0260	2	-1	10	5,96	5,78	6,74
30-ene-30	XS1373156618	€998	3,750	94,3660	0,02	0,17	-0,64	4,8000	0	-3	12	5,55	5,42	6,34
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	80,2820	-0,11	0,02	-0,51	6,2090	2	0	10	6,45	6,25	7,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	70,5390	-0,10	0,24	-0,49	6,1420	2	-3	9	8,14	7,90	9,22
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	116,9260	-0,07	0,14	-0,84	6,4370	1	-2	10	6,92	6,71	10,21
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	72,4320	0,07	0,09	-0,84	5,0110	-1	-1	14	8,73	8,52	9,50
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	75,8120	0,00	0,29	-0,66	6,2390	0	-4	10	8,52	8,26	10,36
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	68,1690	0,03	0,26	-0,73	5,4160	0	-3	10	11,03	10,74	13,24
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	100,9040	-0,12	-0,18	-0,82	6,4470	1	2	9	9,06	8,77	13,57
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	66,4270	-0,11	0,27	-0,76	6,5700	2	-3	10	12,17	11,79	17,62
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,3490	-0,12	0,07	-0,74	6,5500	1	0	6	13,03	12,62	27,45
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,8900	-0,10	0,49	-0,81	6,4570	1	-5	9	14,85	14,38	27,76
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,4170	-0,10	0,17	-0,71	6,2180	1	-2	8	17,00	16,49	37,63
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,7910	-0,11	0,46	-0,78	6,5700	1	-5	9	15,90	15,40	48,91
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,3970	-0,05	0,49	-0,66	6,4210	0	-6	8	15,95	15,45	99,17

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	1	21,63	-10	-92	-	5,60	8,63	13,04	13,62	13,60	12,34	9,13	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	6,87	-26	-133	30,76	2,41	38,11	6,30	12,51	9,91



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