



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

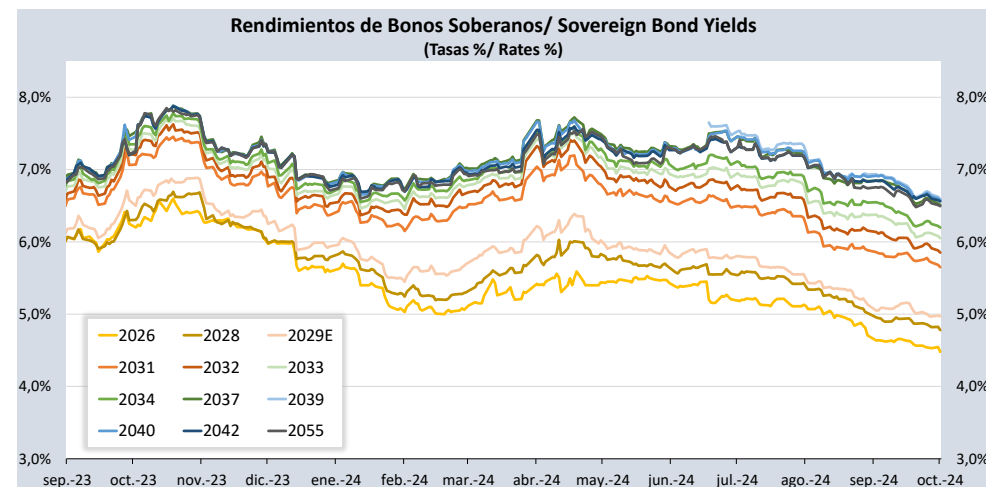
01/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

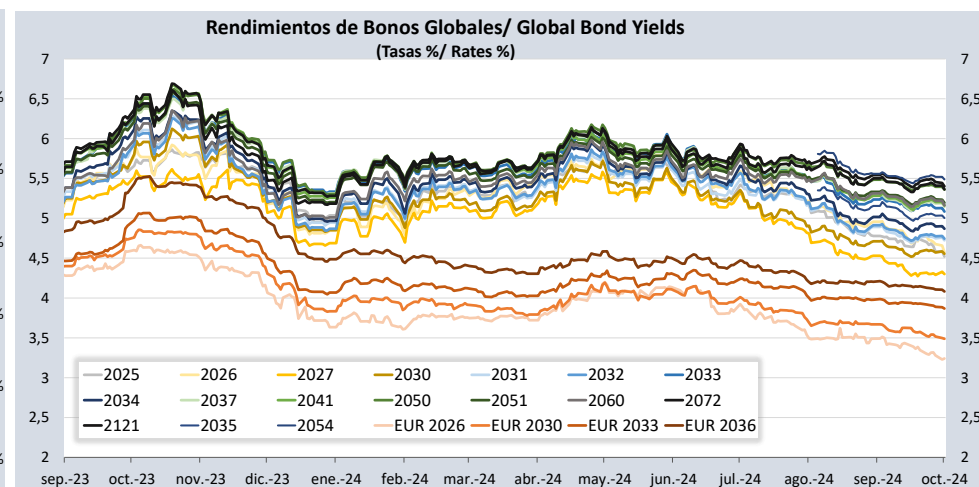
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,11	3 937	8,200	106,4892	106,56	106,53	106,5531	4,50	4,46	4,48	4,4800	2	1-Oct-24	4	1,78	1,70	1,87
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,86	7 225	6,350	105,26	105,42	105,38	105,4305	4,82	4,78	4,79	4,7789	9	1-Oct-24	29	3,52	3,36	3,87
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,81	13 176	5,940	103,61	103,73	103,65	103,7003	4,99	4,96	4,98	4,9692	27	1-Oct-24	82	3,95	3,76	4,37
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,94	19 423	6,950	107,11	107,57	107,22	107,2914	5,68	5,60	5,66	5,6492	45	1-Oct-24	146	5,66	5,36	6,87
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,84	21 442	6,150	101,60	101,83	101,66	101,8455	5,89	5,85	5,88	5,8509	15	1-Oct-24	217	6,41	6,06	7,87
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,99	17 855	7,300	108,12	108,68	108,19	108,4652	6,10	6,02	6,09	6,0520	30	1-Oct-24	244	6,82	6,43	8,87
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,73	16 860	5,400	93,98	94,05	94,05	94,1957	6,23	6,22	6,22	6,1980	26	1-Oct-24	101	7,75	7,30	9,87
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,94	20 481	6,900	103,16	103,68	103,25	103,4216	6,54	6,48	6,53	6,5104	28	1-Oct-24	269	8,85	8,31	12,87
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,90	15 436	7,600	109,30	109,44	109,35	109,5781	6,62	6,60	6,61	6,5866	34	1-Oct-24	378	9,40	8,82	14,87
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,73	12 142	5,350	87,86	88,39	87,90	88,1153	6,61	6,55	6,60	6,5753	26	1-Oct-24	290	10,59	9,94	15,87
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,93	5 033	6,850	102,6415	103,68	103,05	103,0539	6,60	6,50	6,56	6,5600	2	1-Oct-24	3	10,58	9,93	17,37
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,91	3 462	6,714	-	-	-	102,9902	-	-	-	6,4942	-	19-Sep-24	3	13,62	12,79	30,37
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,20	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,1532	-	-	-	2,0835	-	31-Oct-22	2	0,03	0,03	0,04
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,39	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,5792	-	-	-	2,7495	-	18-Ago-23	20	5,06	4,93	5,37
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,25	911	7,39% + VAC	-	-	-	130,9148	-	-	-	3,7314	-	10-Jun-22	10	7,86	7,57	10,33
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,43	228	3,14%+VAC	-	-	-	89,3947	-	-	-	4,0576	-	10-Ago-23	50	12,21	11,73	15,37
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,52	424	3,83% + VAC	-	-	-	97,0560	-	-	-	4,0149	-	21-Jul-22	2	15,02	14,44	21,87
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,44	383	3,26%+VAC	-	-	-	87,4420	-	-	-	3,9778	-	12-Ago-21	10	18,48	17,78	29,37

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).

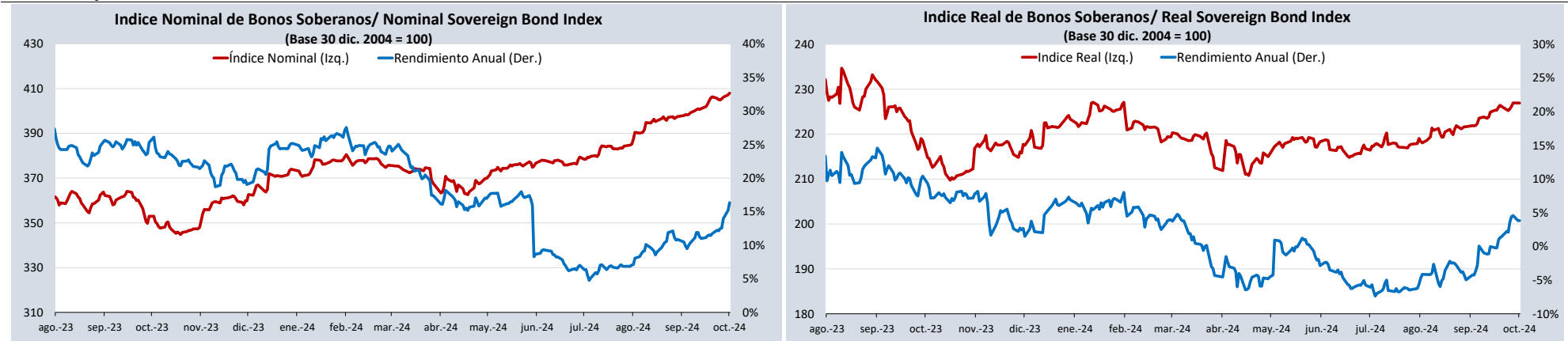


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	425	7,350	102,1960	0,05	0,06	-0,41	4,5210	-7	-15	52	0,79	0,77	0,81
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,2550	0,11	0,23	-0,48	4,5750	-8	-15	39	1,29	1,26	1,33
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3630	-0,02	0,07	-0,42	3,2410	1	-5	33	1,31	1,29	1,35
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	99,5240	0,08	0,00	-0,47	4,3000	-3	0	18	2,75	2,69	2,94
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	91,4690	0,14	0,19	-0,51	4,5550	-3	-4	11	5,25	5,13	5,80
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,2540	0,04	0,13	-0,59	3,4880	-1	-3	12	4,86	4,77	5,41
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	89,5110	0,17	0,24	-0,52	4,7240	-3	-4	10	5,76	5,63	6,40
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,6780	0,21	0,30	-0,54	4,7440	-3	-4	9	7,48	7,30	8,29
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	126,5180	0,36	0,59	-0,87	5,0840	-4	-8	10	6,64	6,48	9,27
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,4530	0,10	0,32	-0,90	3,8680	-2	-4	14	7,98	7,83	8,56
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	86,1710	0,23	0,44	-0,57	4,8680	-3	-6	8	8,01	7,82	9,43
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,9650	0,26	0,37	-0,49	5,0040	-3	-5	6	8,05	7,85	10,51
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,9240	0,19	0,39	-0,66	4,0820	-2	-4	8	10,57	10,36	12,31
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	112,8040	0,43	0,54	-0,92	5,1440	-4	-6	9	8,92	8,70	12,63
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	79,5110	0,39	0,56	-0,74	5,1640	-4	-6	8	12,26	11,95	16,68
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	103,6780	0,50	0,76	-0,50	5,3610	-4	-5	3	13,93	13,57	26,51
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	76,4870	0,45	0,80	-0,71	5,1950	-4	-7	6	15,88	15,47	26,82
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	105,6550	0,50	0,61	-0,59	5,4870	-3	-4	4	14,69	14,30	30,29
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	61,1710	0,68	0,96	-0,65	5,1610	-6	-8	6	18,77	18,30	36,69
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	69,3280	0,53	1,04	-0,74	5,4010	-4	-8	6	18,44	17,95	47,98
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	60,4560	0,54	0,78	-0,71	5,3630	-5	-7	6	19,16	18,66	98,23

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-26	12-Ago-28	12-Feb-29	12-Ago-31	12-Ago-32	12-Ago-33	12-Ago-34	12-Ago-37	12-Ago-39	12-Ago-40	12-Feb-42	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	408	1	3	16,34	115	421	2,61	4,73	8,48	12,94	13,55	12,03	9,85	13,15	10,59	6,64	3,22	2,21
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	227	0	2	3,82	0	171	29,00	2,46	38,21	6,50	13,13	10,69						



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

* Para mayor información respecto a la valorización de los bonos y letras puede consultar en: http://www.mef.gob.pe/contenidos/tesoro_pub/gestion_act_pas/Manual_valorizacion_instrumentos_del_Tesoro.pdf

** Precio de los bonos a fecha de liquidación T+0.

*** Última negociación 1:30 pm

**** Información con horario de corte 4:30 pm.