



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

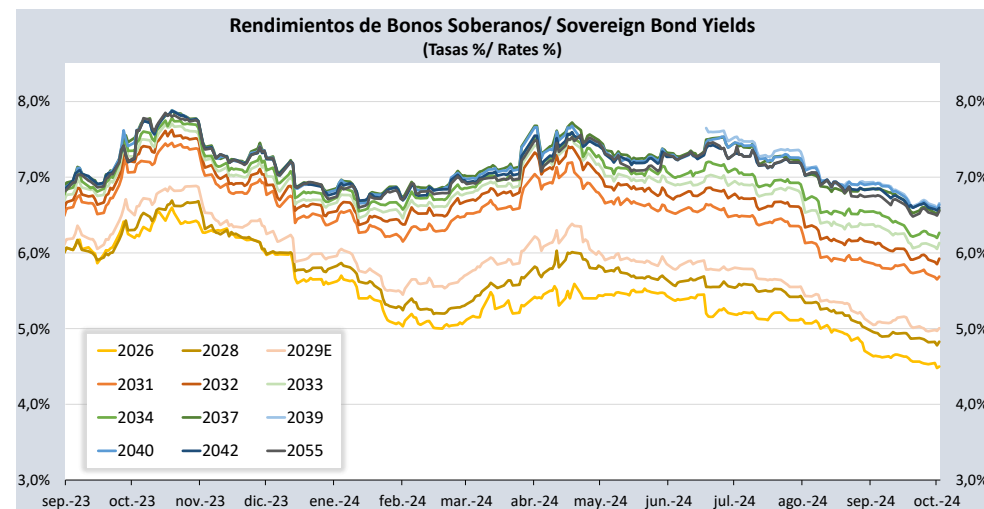
02/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

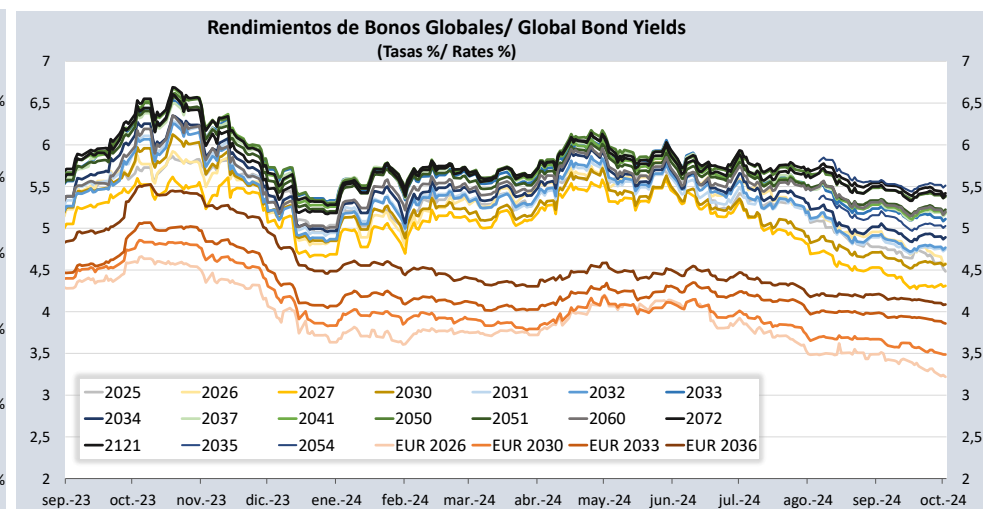
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,14	3 937	8,200	106,4800	106,55	106,46	106,5074	4,49	4,45	4,50	4,5000	2	2-Oct-24	4	1,77	1,70	1,86
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,88	7 225	6,350	105,14	105,41	105,23	105,2519	4,86	4,78	4,83	4,8280	7	2-Oct-24	20	3,52	3,36	3,86
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,82	13 176	5,940	103,41	103,61	103,49	103,5542	5,04	4,99	5,02	5,0059	8	2-Oct-24	72	3,94	3,76	4,36
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,96	19 423	6,950	106,81	107,16	107,04	107,0698	5,73	5,67	5,69	5,6871	14	2-Oct-24	174	5,65	5,35	6,86
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,85	21 442	6,150	101,23	101,41	101,41	101,3920	5,95	5,92	5,92	5,9240	23	2-Oct-24	274	6,40	6,04	7,86
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,01	17 855	7,300	107,73	107,91	107,91	107,9116	6,16	6,13	6,13	6,1307	44	2-Oct-24	211	6,81	6,41	8,86
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,75	16 860	5,400	93,57	93,64	93,64	93,7341	6,29	6,28	6,28	6,2650	27	2-Oct-24	67	7,74	7,29	9,86
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,96	20 481	6,900	102,60	102,90	102,99	102,9102	6,61	6,57	6,56	6,5695	9	2-Oct-24	85	8,84	8,30	12,86
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,92	15 436	7,600	108,56	108,85	108,95	108,9006	6,69	6,66	6,65	6,6557	13	2-Oct-24	88	9,38	8,80	14,86
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,74	12 142	5,350	87,21	87,47	87,47	87,5751	6,68	6,65	6,65	6,6369	14	2-Oct-24	190	10,57	9,91	15,86
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,95	5 033	6,850	-	-	-	102,6932	-	-	-	6,5950	-	1-Oct-24	3	10,56	9,91	17,36
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,93	3 462	6,714	-	-	-	102,1766	-	-	-	6,5558	-	19-Sep-24	3	13,56	12,73	30,36
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,21	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,1406	-	-	-	2,0770	-	31-Oct-22	2	0,03	0,03	0,03
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,40	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,3986	-	-	-	2,7858	-	18-Ago-23	20	5,06	4,92	5,36
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,27	911	7,39% + VAC	-	-	-	130,2677	-	-	-	3,7956	-	10-Jun-22	10	7,85	7,56	10,33
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,44	228	3,14%+VAC	-	-	-	88,7269	-	-	-	4,1214	-	10-Ago-23	50	12,19	11,71	15,36
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,53	424	3,83% + VAC	-	-	-	96,4515	-	-	-	4,0580	-	21-Jul-22	2	14,99	14,41	21,86
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,45	383	3,26%+VAC	-	-	-	86,5415	-	-	-	4,0359	-	12-Ago-21	10	18,42	17,70	29,36

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).



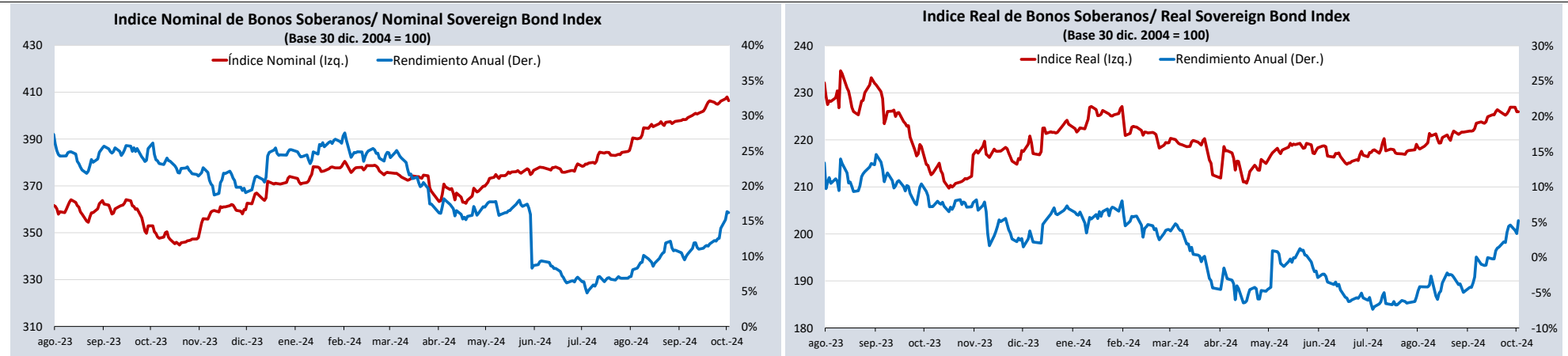
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	102,2190	0,02	0,11	-0,43	4,4830	-4	-20	54	0,79	0,77	0,81
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,2540	0,00	0,22	-0,45	4,5800	0	-14	37	1,29	1,26	1,33
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3920	0,03	0,13	-0,56	3,2190	-2	-10	44	1,31	1,29	1,35
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	99,4990	-0,03	-0,02	-0,48	4,3100	1	1	18	2,75	2,69	2,94
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	91,4090	-0,06	0,17	-0,55	4,5690	1	-3	12	5,25	5,13	5,80
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,2620	0,01	0,26	-0,84	3,4870	0	-5	17	4,85	4,77	5,41
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	89,4070	-0,10	0,16	-0,54	4,7460	2	-2	11	5,76	5,63	6,40
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,5390	-0,14	0,23	-0,53	4,7680	2	-3	9	7,47	7,30	8,28
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	126,2810	-0,24	0,48	-0,90	5,1110	3	-6	11	6,63	6,47	9,27
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,5110	0,06	0,34	-0,92	3,8590	-1	-5	15	7,97	7,82	8,56
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	86,0150	-0,16	0,31	-0,59	4,8920	2	-4	9	8,01	7,82	9,42
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,7730	-0,19	0,26	-0,50	5,0270	2	-3	6	8,05	7,85	10,50
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,8820	-0,04	0,30	-0,69	4,0870	0	-3	8	10,57	10,35	12,30
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	112,5300	-0,27	0,40	-0,84	5,1720	3	-4	9	8,92	8,69	12,63
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	79,2790	-0,23	0,45	-0,72	5,1890	3	-4	8	12,25	11,94	16,68
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	103,4380	-0,24	0,61	-0,56	5,3780	2	-4	4	13,91	13,55	26,51
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	76,1600	-0,33	0,62	-0,70	5,2230	3	-5	6	15,85	15,44	26,82
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	105,2690	-0,39	0,44	-0,56	5,5130	3	-3	4	14,66	14,27	30,28
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,7480	-0,42	0,69	-0,67	5,1980	4	-6	6	18,70	18,23	36,69
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	69,0890	-0,24	0,93	-0,71	5,4200	2	-8	6	18,39	17,91	47,98
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	60,1120	-0,34	0,60	-0,70	5,3940	3	-5	6	19,05	18,55	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	406	-2	2	16,19	-15	372	2,62	4,74	8,50	12,97	13,55	12,02	9,84	13,14	10,57	6,63	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	226	0	0	5,21	183	164	29,13	2,47	38,19	6,48	13,11	10,63



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.