



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

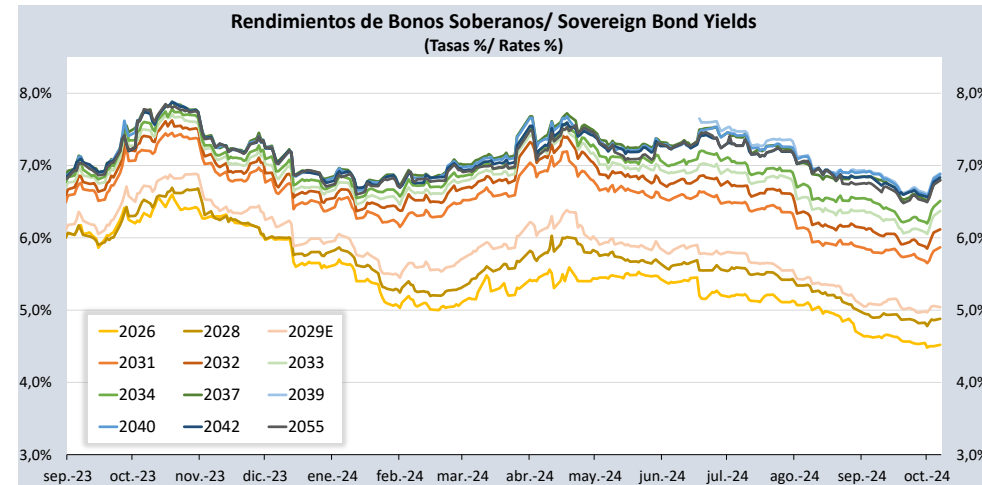
07/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

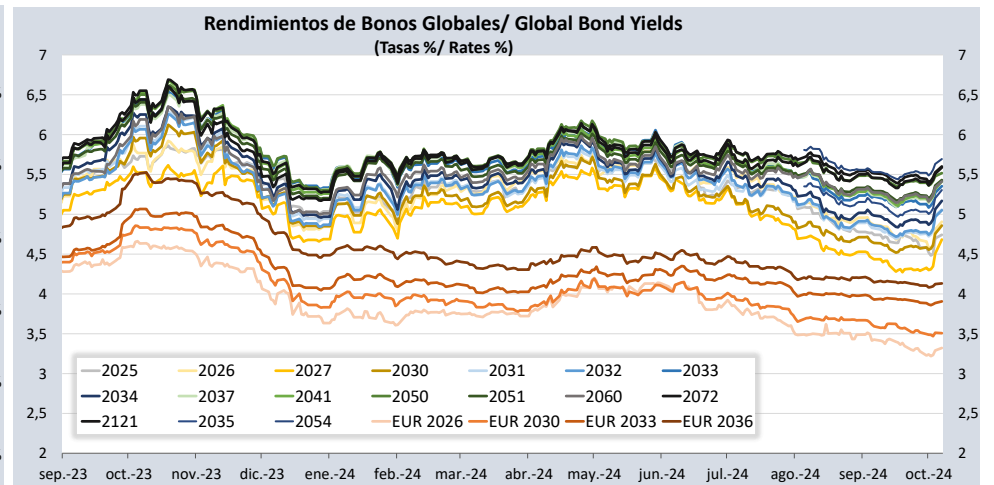
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones \$ / 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. \$) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,25	3 937	8,200	-	-	-	106,4255	-	-	-	4,5200	-	4-Oct-24	10	1,76	1,68	1,86
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,97	7 225	6,350	104,90	105,18	105,04	105,0508	4,92	4,84	4,88	4,8800	1	7-Oct-24	1	3,50	3,34	3,86
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,90	13 176	5,940	103,17	103,44	103,40	103,4111	5,10	5,03	5,04	5,0400	1	7-Oct-24	1	3,93	3,74	4,36
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,06	19 423	6,950	105,81	106,25	106,12	106,0173	5,90	5,83	5,85	5,8687	7	7-Oct-24	31	5,63	5,32	6,86
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,94	21 442	6,150	99,89	100,34	100,25	100,2050	6,17	6,10	6,11	6,1175	14	7-Oct-24	82	6,38	6,01	7,86
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,11	17 855	7,300	106,04	106,52	106,31	106,2326	6,40	6,33	6,36	6,3725	8	7-Oct-24	65	6,77	6,37	8,86
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,82	16 860	5,400	91,81	92,32	92,15	92,0755	6,55	6,48	6,50	6,5099	8	7-Oct-24	130	7,70	7,23	9,86
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,05	20 481	6,900	100,57	101,03	100,80	100,9395	6,85	6,79	6,82	6,8012	9	7-Oct-24	34	8,78	8,22	12,86
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,02	15 436	7,600	106,17	106,98	106,55	106,6312	6,94	6,86	6,90	6,8917	14	7-Oct-24	54	9,30	8,70	14,86
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,81	12 142	5,350	85,24	85,89	85,33	85,5091	6,91	6,83	6,90	6,8777	13	7-Oct-24	28	10,48	9,80	15,86
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,04	5 033	6,850	-	-	-	100,2618	-	-	-	6,8358	-	1-Oct-24	3	10,46	9,79	17,36
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,02	3 462	6,714	-	-	-	99,0953	-	-	-	6,7966	-	19-Sep-24	3	13,31	12,46	30,36
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,31	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,0765	-	-	-	2,0909	-	31-Oct-22	2	0,02	0,02	0,03
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,44	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,8353	-	-	-	2,8998	-	18-Ago-23	20	5,05	4,90	5,36
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,37	911	7,39% + VAC	-	-	-	127,6816	-	-	-	4,0561	-	10-Jun-22	10	7,80	7,50	10,33
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,48	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,1105	-	-	-	4,3776	-	10-Ago-23	50	12,12	11,61	15,36
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,58	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,9307	-	-	-	4,3165	-	21-Jul-22	2	14,83	14,21	21,86
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,50	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,6875	-	-	-	4,2945	-	12-Ago-21	10	18,11	17,37	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	101,9780	-0,04	-0,17	-0,45	4,7430	5	16	58	0,77	0,75	0,80
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8870	-0,11	-0,26	-0,45	4,9060	10	25	37	1,28	1,25	1,31
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,2700	-0,04	-0,11	-0,46	3,3210	3	9	36	1,29	1,27	1,33
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,5080	-0,47	-0,94	-0,49	4,6830	18	35	19	2,73	2,67	2,92
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,0690	-0,47	-1,26	-0,54	4,8590	10	28	12	5,23	5,11	5,78
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,1570	0,03	-0,05	-0,66	3,5080	0	1	14	4,84	4,75	5,39
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,8680	-0,35	-1,47	-0,54	5,0580	7	30	11	5,74	5,60	6,39
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,9170	-0,47	-1,55	-0,54	5,0500	8	27	9	7,45	7,27	8,27
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	124,2390	-0,69	-1,92	-0,97	5,3540	8	23	12	6,60	6,43	9,26
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,2440	-0,12	-0,11	-0,93	3,9060	2	2	15	7,96	7,81	8,55
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,1810	-0,69	-1,76	-0,60	5,1690	11	27	9	7,97	7,77	9,41
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,5500	-0,80	-2,16	-0,53	5,3040	10	27	7	8,00	7,80	10,49
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5320	-0,06	-0,21	-0,69	4,1320	1	3	9	10,55	10,33	12,29
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,2410	-0,69	-2,13	-0,91	5,4070	7	22	9	8,86	8,63	12,61
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,1700	-0,93	-1,95	-0,73	5,4160	10	21	8	12,17	11,85	16,66
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	101,4820	-0,55	-1,70	-0,28	5,5170	4	12	2	13,78	13,41	26,49
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,7820	-0,80	-2,26	-0,73	5,4300	7	20	6	15,65	15,23	26,81
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	102,5760	-0,90	-2,58	-0,61	5,6940	6	17	4	14,46	14,06	30,27
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,4240	-0,79	-2,07	-0,60	5,4120	7	19	6	18,33	17,84	36,68
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,8950	-0,90	-1,91	-0,72	5,6010	8	16	6	17,98	17,49	47,96
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	58,0080	-0,84	-1,91	-0,62	5,5870	8	18	6	18,39	17,89	98,21

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	401	-1	-6	14,43	48	-76	2,66	4,80	8,61	13,03	13,58	12,00	9,81	13,08	10,50	6,56	3,19	2,17
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	221	0	-5	4,08	26	26	29,68		2,50		38,17		6,41		12,88		10,35	

