



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

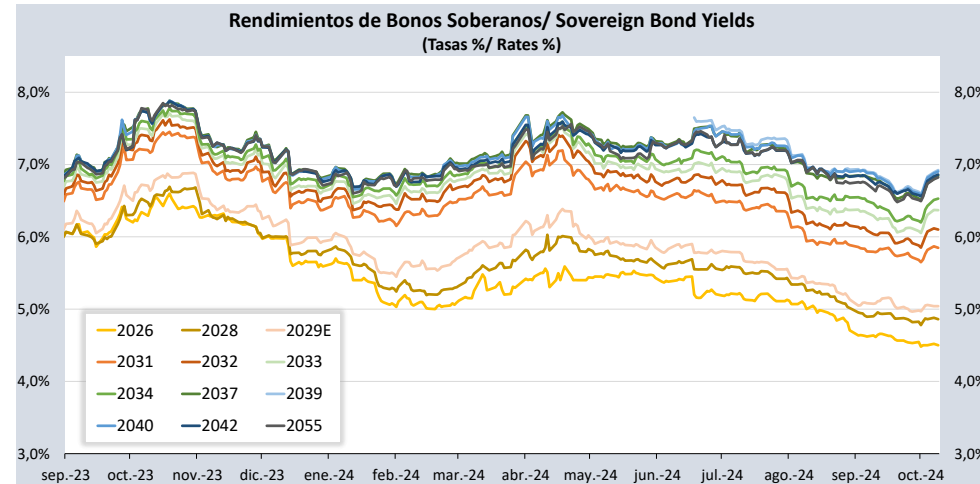
09/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

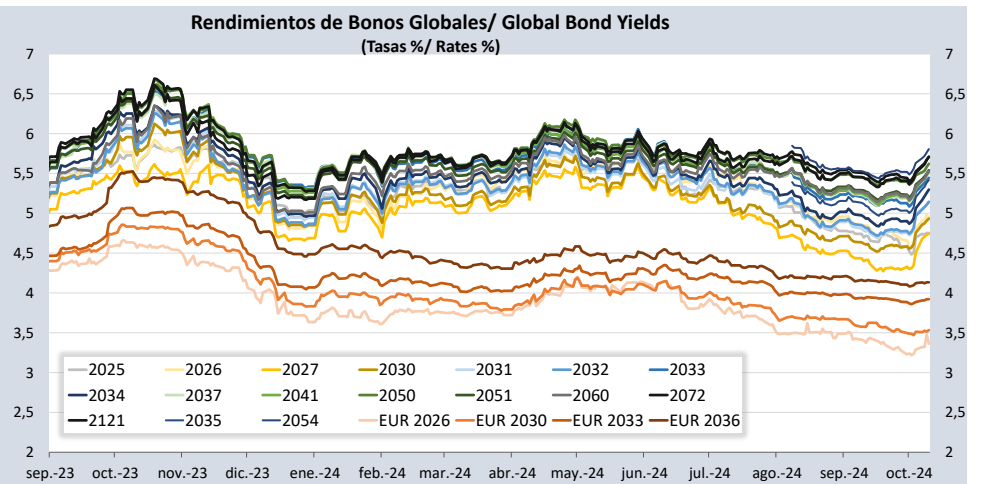
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	1,29	3 937	8,200	106,3442	106,43	106,40	106,4436	4,53	4,48	4,50	4,5000	3	9-Oct-24	5	1,75	1,68	1,84
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,00	7 225	6,350	104,82	105,13	105,10	105,1151	4,94	4,85	4,86	4,8600	1	9-Oct-24	1	3,50	3,34	3,84
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,94	13 176	5,940	103,16	103,40	103,40	103,4073	5,10	5,04	5,04	5,0400	1	9-Oct-24	1	3,93	3,74	4,34
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,10	19 573	6,950	105,77	106,28	106,05	106,1319	5,91	5,82	5,86	5,8479	11	9-Oct-24	26	5,63	5,32	6,84
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,97	21 442	6,150	99,95	100,25	100,19	100,3101	6,16	6,11	6,12	6,1002	15	9-Oct-24	55	6,37	6,01	7,84
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,15	17 855	7,300	105,92	106,24	106,17	106,2550	6,42	6,37	6,38	6,3688	27	9-Oct-24	206	6,77	6,36	8,84
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,85	16 860	5,400	91,73	92,24	91,95	91,9525	6,56	6,49	6,53	6,5287	24	9-Oct-24	85	7,70	7,23	9,84
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,09	20 481	6,900	100,25	100,97	100,53	100,5638	6,88	6,80	6,85	6,8461	16	9-Oct-24	99	8,77	8,20	12,84
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,06	15 436	7,600	105,89	116,61	106,17	106,3310	6,97	5,90	6,94	6,9234	21	9-Oct-24	133	9,29	8,69	14,84
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,84	12 142	5,350	84,88	85,53	85,08	85,2999	6,95	6,88	6,93	6,9028	18	9-Oct-24	147	10,47	9,79	15,84
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,08	5 033	6,850	-	-	-	100,0133	-	-	-	6,8609	-	1-Oct-24	3	10,45	9,78	17,34
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,06	3 462	6,714	-	-	-	98,7830	-	-	-	6,8217	-	19-Sep-24	3	13,28	12,43	30,34
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,35	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,0513	-	-	-	2,0636	-	31-Oct-22	2	0,01	0,01	0,01
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,46	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,9136	-	-	-	2,8839	-	18-Ago-23	20	5,04	4,90	5,34
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,41	911	7,39% + VAC	-	-	-	127,5298	-	-	-	4,0706	-	10-Jun-22	10	7,80	7,49	10,31
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,50	228	3,14%+VAC	-	-	-	85,9154	-	-	-	4,3974	-	10-Ago-23	50	12,11	11,60	15,34
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,60	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,7103	-	-	-	4,3332	-	21-Jul-22	2	14,81	14,20	21,84
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,51	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,4499	-	-	-	4,3111	-	12-Ago-21	10	18,09	17,34	29,34

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).

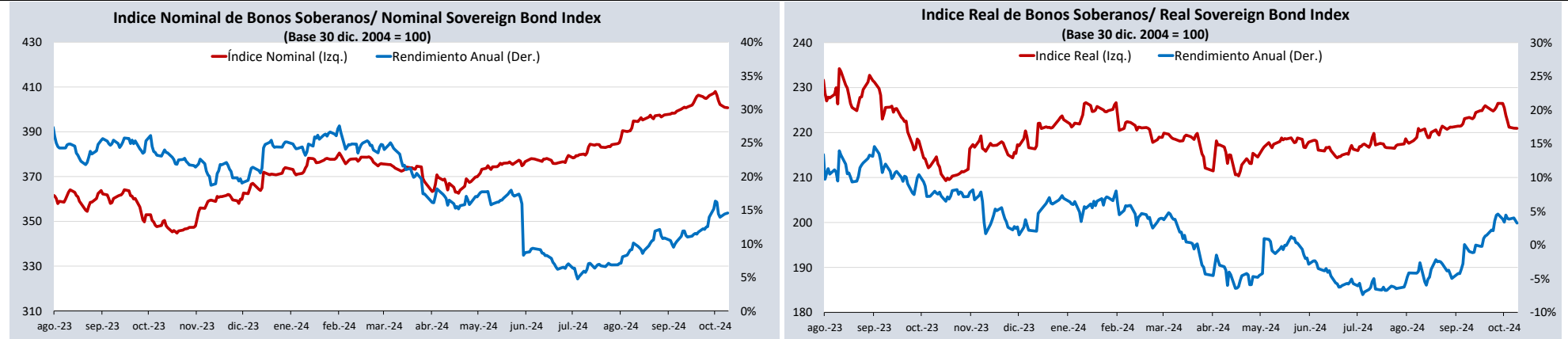


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,9560	-0,02	-0,26	-0,45	4,7540	2	27	58	0,77	0,75	0,79
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8120	-0,08	-0,44	-0,45	4,9790	7	40	38	1,27	1,24	1,31
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,0770	-0,20	-0,31	-0,57	3,4790	16	26	46	1,29	1,27	1,33
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,3860	-0,07	-1,11	-0,44	4,7300	3	42	17	2,73	2,67	2,92
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,8550	-0,16	-1,55	-0,55	4,9070	4	34	12	5,22	5,10	5,78
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,1260	0,06	-0,14	-0,63	3,5140	-1	3	13	4,83	4,75	5,39
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,6240	-0,16	-1,78	-0,52	5,1090	3	36	11	5,73	5,59	6,38
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,5940	-0,17	-1,95	-0,55	5,1080	3	34	10	7,44	7,26	8,26
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,6810	-0,34	-2,60	-0,94	5,4210	4	31	12	6,59	6,41	9,25
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1590	-0,09	-0,35	-0,89	3,9210	1	6	14	7,95	7,80	8,54
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,6160	-0,28	-2,40	-0,58	5,2560	4	36	9	7,96	7,76	9,40
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,9290	-0,40	-2,84	-0,48	5,3830	5	36	6	7,99	7,78	10,48
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5370	-0,09	-0,34	-0,70	4,1330	1	5	9	10,54	10,33	12,28
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,6280	-0,45	-2,90	-0,95	5,4710	5	30	10	8,84	8,61	12,61
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,5980	-0,34	-2,68	-0,70	5,4790	4	29	8	12,15	11,82	16,66
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	100,6000	-0,67	-2,84	-0,52	5,5810	5	20	4	13,72	13,35	26,49
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,0450	-0,39	-3,11	-0,72	5,4960	4	27	6	15,58	15,17	26,80
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,5740	-0,63	-3,70	-0,66	5,7630	4	25	5	14,38	13,98	30,26
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,5840	-0,62	-3,16	-0,67	5,4920	6	29	7	18,19	17,70	36,67
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,1080	-0,48	-2,98	-0,72	5,6680	4	25	6	17,82	17,33	47,96
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,1320	-0,59	-2,98	-0,66	5,6720	6	28	6	18,12	17,62	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	0	-6	14,58	15	-161	2,66	4,80	8,62	13,05	13,61	12,02	9,81	13,05	10,48	6,55	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	-3	3,24	-76	-120	29,72		2,51		38,18		6,40		12,86		10,34	



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.