



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

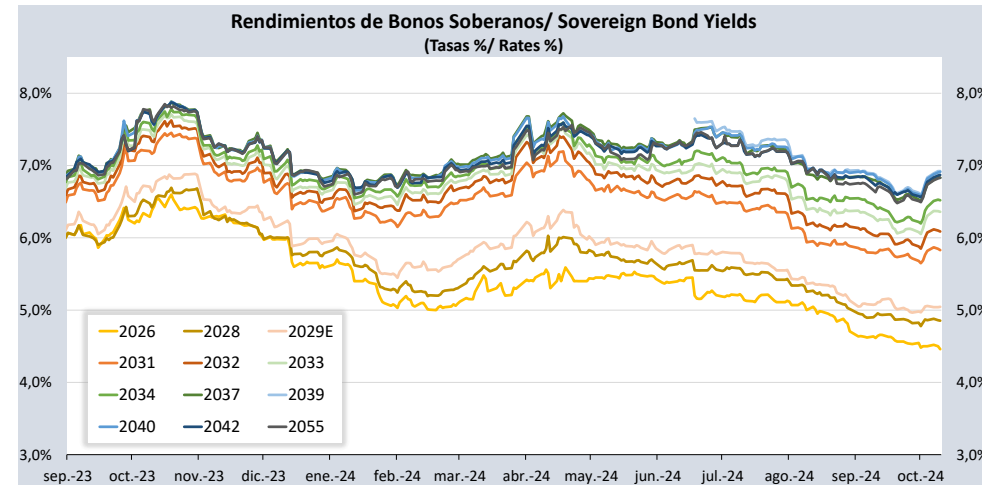
10/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

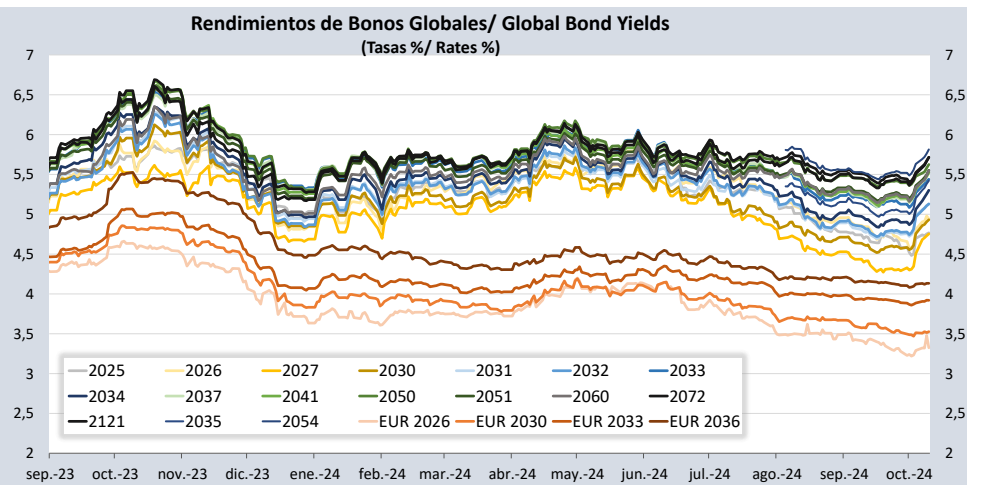
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	1,31	3 937	8,200	106,4197	106,57	106,53	106,4448	4,48	4,40	4,42	4,4943	5	10-Oct-24	26	1,75	1,68	1,84
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,02	7 225	6,350	104,98	105,52	105,13	105,1320	4,89	4,74	4,85	4,8543	7	10-Oct-24	14	3,50	3,33	3,84
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,95	13 176	5,940	103,24	103,55	103,40	103,3832	5,08	5,00	5,04	5,0457	23	10-Oct-24	50	3,92	3,73	4,34
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,11	19 573	6,950	106,22	106,36	106,34	106,2326	5,83	5,81	5,81	5,8299	59	10-Oct-24	380	5,63	5,32	6,84
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,99	21 442	6,150	100,49	100,62	100,55	100,3898	6,07	6,05	6,06	6,0871	47	10-Oct-24	376	6,37	6,01	7,84
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,17	17 855	7,300	106,29	106,65	106,58	106,3145	6,36	6,31	6,32	6,3599	22	10-Oct-24	183	6,77	6,36	8,84
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,87	16 860	5,400	92,07	92,36	92,09	92,0125	6,51	6,47	6,51	6,5200	27	10-Oct-24	68	7,70	7,22	9,84
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,11	20 481	6,900	100,43	101,03	100,87	100,6890	6,86	6,79	6,81	6,8311	27	10-Oct-24	71	8,77	8,21	12,84
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,09	15 436	7,600	105,98	106,74	106,55	106,3296	6,96	6,88	6,90	6,9235	26	10-Oct-24	79	9,29	8,69	14,84
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,86	12 142	5,350	85,12	85,59	85,33	85,2255	6,93	6,87	6,90	6,9118	14	10-Oct-24	51	10,46	9,78	15,84
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,10	5 033	6,850	-	-	-	99,9244	-	-	-	6,8699	-	1-Oct-24	3	10,44	9,77	17,34
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,08	3 462	6,714	-	-	-	98,6714	-	-	-	6,8307	-	19-Sep-24	3	13,27	12,42	30,34
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	3,36	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,0391	-	-	-	1,9846	-	31-Oct-22	2	0,01	0,01	0,01
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,46	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,9688	-	-	-	2,8727	-	18-Ago-23	20	5,04	4,90	5,34
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,43	911	7,39% + VAC	-	-	-	127,6902	-	-	-	4,0534	-	10-Jun-22	10	7,80	7,49	10,31
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,50	228	3,14%+VAC	-	-	-	85,9492	-	-	-	4,3942	-	10-Ago-23	50	12,10	11,59	15,34
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,61	424	3,83% + VAC	-	-	-	104,2006	-	-	-	3,5310	-	21-Jul-22	2	14,81	14,19	21,84
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,52	383	3,26%+VAC	-	-	-	98,4274	-	-	-	3,3300	-	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).

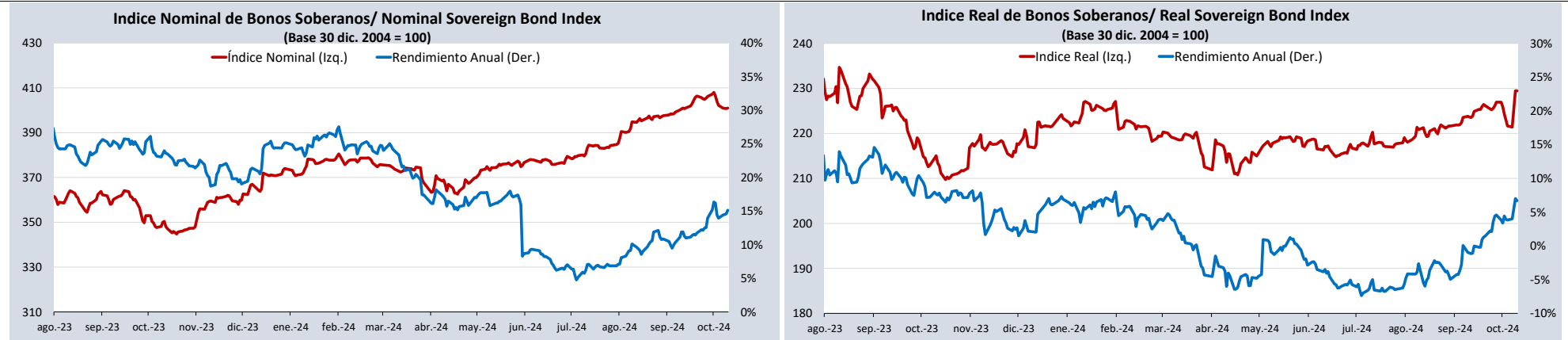


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,9390	-0,02	-0,26	-0,50	4,7670	1	27	65	0,76	0,75	0,79	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8630	0,05	-0,35	-0,47	4,9420	-4	32	39	1,27	1,24	1,31	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,2750	0,20	-0,10	-0,64	3,3240	-16	9	51	1,29	1,26	1,33	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,3250	-0,06	-1,08	-0,45	4,7540	2	41	17	2,73	2,66	2,91	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,7480	-0,11	-1,47	-0,52	4,9310	2	32	11	5,22	5,09	5,78	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,0630	-0,06	-0,28	-0,84	3,5260	1	6	17	4,83	4,75	5,38	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,5430	-0,08	-1,63	-0,53	5,1260	2	33	11	5,73	5,59	6,38	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,4690	-0,13	-1,80	-0,51	5,1310	2	32	9	7,44	7,25	8,26	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,5200	-0,16	-2,44	-0,98	5,4400	2	29	12	6,58	6,41	9,25	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1820	0,02	-0,27	-0,90	3,9200	0	5	14	7,95	7,80	8,54	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,3270	-0,29	-2,40	-0,57	5,3010	4	37	9	7,96	7,75	9,40	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,6230	-0,31	-2,77	-0,47	5,4220	4	35	6	7,98	7,77	10,48	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5480	0,01	-0,27	-0,70	4,1330	0	4	9	10,54	10,33	12,28	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,1810	-0,45	-2,86	-0,91	5,5190	5	30	10	8,83	8,60	12,61	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,1730	-0,42	-2,71	-0,72	5,5260	5	30	8	12,13	11,80	16,66	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	100,0000	-0,60	-2,87	-0,31	5,6250	4	21	2	13,68	13,31	26,49	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,4170	-0,63	-3,25	-0,72	5,5530	6	29	7	15,53	15,11	26,80	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,8550	-0,72	-3,73	-0,64	5,8140	5	26	4	14,33	13,92	30,26	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,9980	-0,59	-3,23	-0,66	5,5490	6	30	6	18,09	17,60	36,67	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,5410	-0,57	-3,04	-0,69	5,7170	5	26	6	17,71	17,22	47,95	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,7060	-0,43	-2,96	-0,68	5,7140	4	28	7	17,98	17,48	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	-3	15,13	55	68	2,66	4,80	8,61	13,06	13,61	12,02	9,81	13,06	10,48	6,55	3,18	2,16
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	229	0	6	6,71	-31	279	28,68		2,42		36,89		6,18		13,94		11,89	



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.