



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

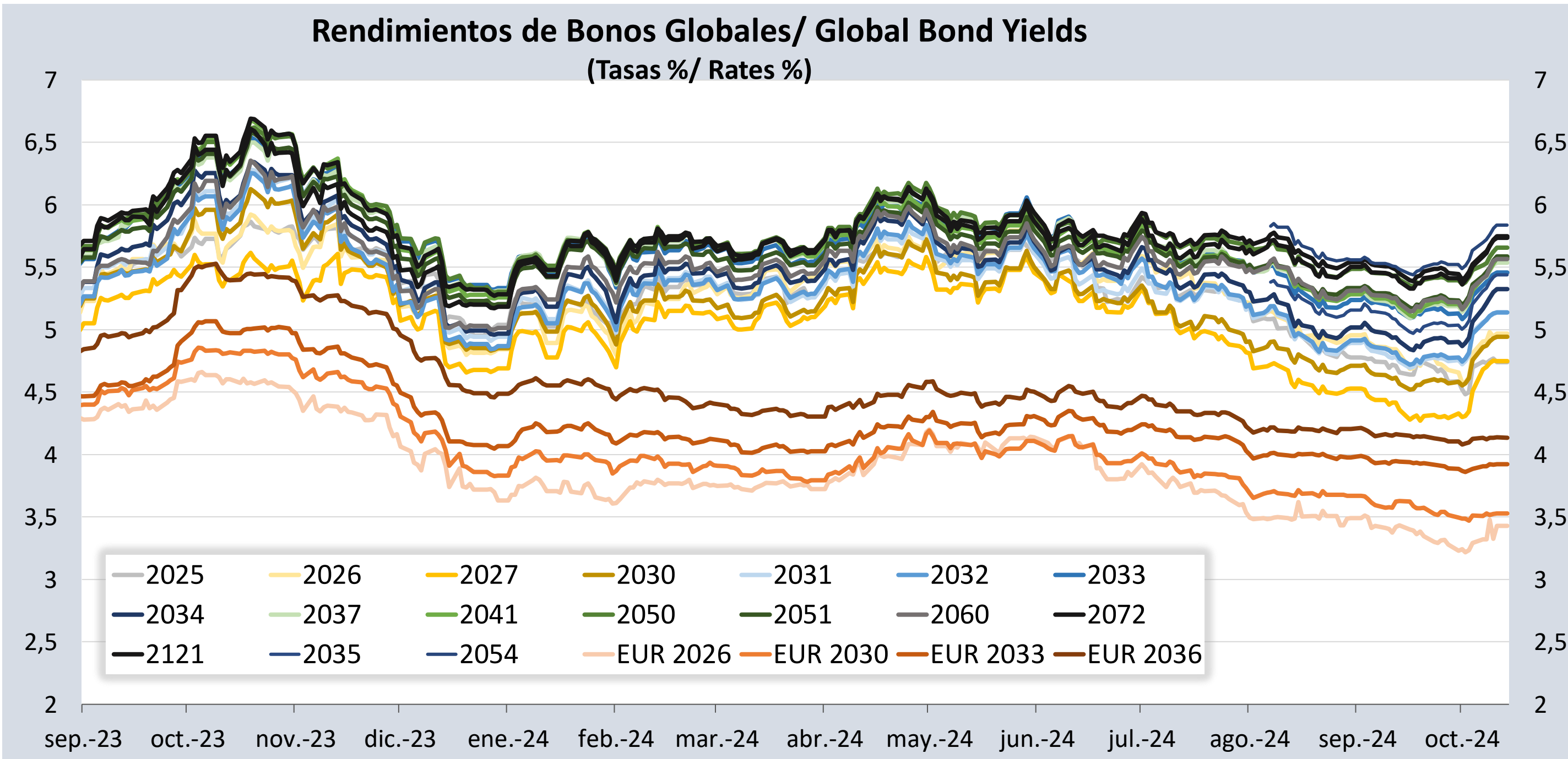
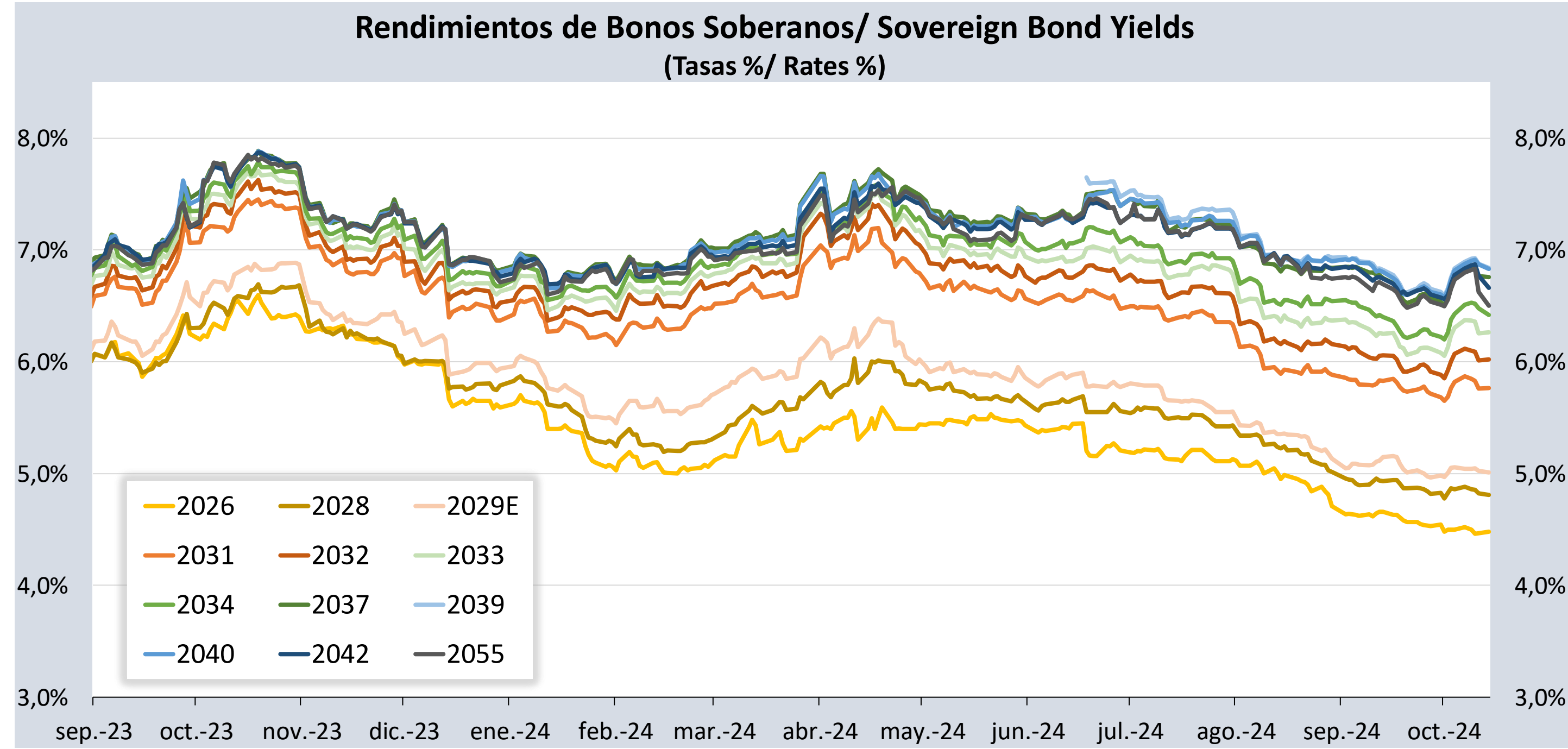
14/10/2024

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
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,40	3 937	8,200	106,3886	106,50	106,41	106,4340	4,49	4,43	4,48	4,4800	2	14-Oct-24	32	1,74	1,67	1,84
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,09	7 225	6,350	105,14	105,34	105,27	105,2754	4,85	4,79	4,81	4,8100	1	14-Oct-24	1	3,49	3,33	3,84
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,02	13 176	5,940	103,39	103,63	103,51	103,5146	5,04	4,98	5,01	5,0100	1	14-Oct-24	1	3,91	3,72	4,34
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,19	19 573	6,950	106,59	106,73	106,62	106,5971	5,77	5,74	5,76	5,7647	15	14-Oct-24	30	5,62	5,31	6,84
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,05	21 442	6,150	100,66	101,04	100,80	100,8048	6,04	5,98	6,02	6,0190	23	14-Oct-24	95	6,36	6,00	7,84
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,25	17 855	7,300	106,90	107,40	107,13	106,9796	6,27	6,20	6,24	6,2621	22	14-Oct-24	101	6,76	6,36	8,84
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,92	16 860	5,400	92,60	92,93	92,76	92,6961	6,44	6,39	6,41	6,4195	21	14-Oct-24	48	7,69	7,23	9,84
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,18	20 481	6,900	101,24	101,75	101,54	101,3319	6,77	6,71	6,73	6,7544	40	14-Oct-24	225	8,77	8,22	12,84
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,17	15 436	7,600	106,83	111,32	107,21	107,1244	6,87	6,41	6,83	6,8393	52	14-Oct-24	168	9,30	8,70	14,84
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,92	12 142	5,350	85,80	86,16	85,93	85,9187	6,85	6,80	6,83	6,8306	38	14-Oct-24	156	10,47	9,80	15,84
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,17	5 033	6,850	101,6731	104,19	102,84	102,0268	6,70	6,45	6,58	6,6600	2	14-Oct-24	2	10,51	9,85	17,34
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,15	3 462	6,714	100,9527	104,25	102,91	102,9123	6,65	6,40	6,50	6,5000	2	14-Oct-24	6	13,58	12,75	30,34
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,49	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,0068	-	-	-	2,8650	-	18-Ago-23	20	5,03	4,89	5,34
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,51	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,4888	-	-	-	3,9687	-	10-Jun-22	10	7,79	7,50	10,31
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,54	228	3,14%+VAC	-	-	-	96,2899	-	-	-	3,4336	-	10-Ago-23	50	12,32	11,91	15,34
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,66	424	3,83% + VAC	-	-	-	104,6872	-	-	-	3,4997	-	11-Oct-24	52	15,29	14,77	21,84
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,56	383	3,26%+VAC	-	-	-	99,0051	-	-	-	3,2987	-	11-Oct-24	243	19,20	18,58	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).

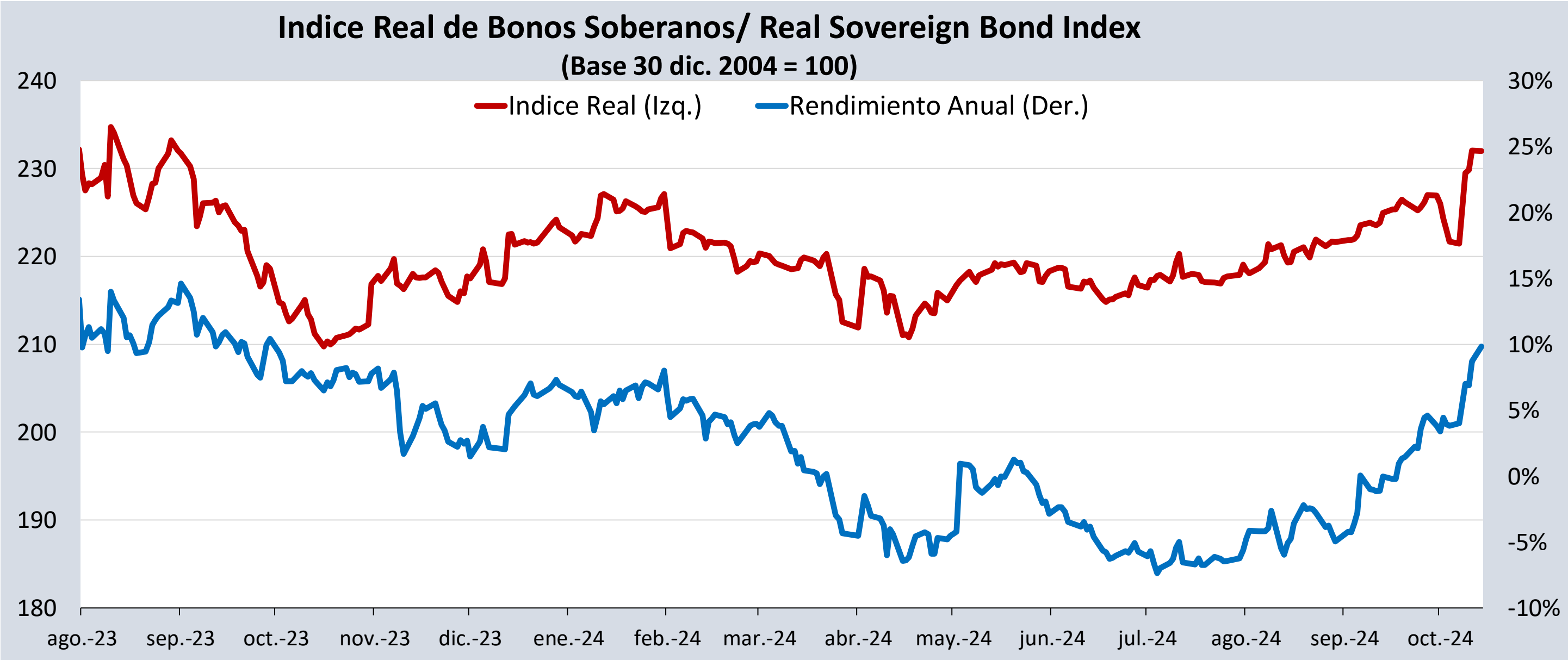
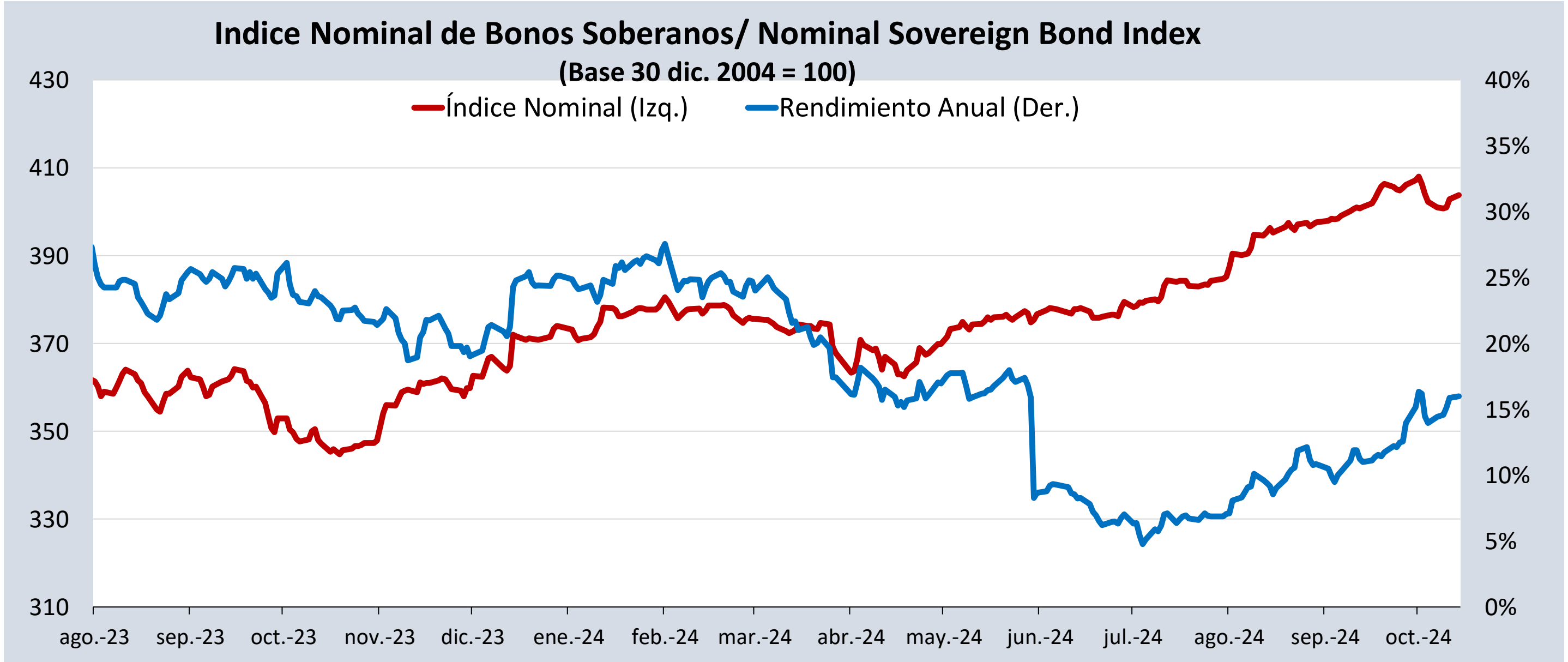
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,9320	0,00	-0,05	-0,43	4,7400	0	0	56	0,75	0,73	0,78
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8610	0,00	-0,03	-0,47	4,9660	0	6	40	1,26	1,23	1,29
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,1470	0,00	-0,12	-0,47	3,4300	0	11	38	1,27	1,25	1,31
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,3450	0,00	-0,16	-0,47	4,7490	0	7	18	2,71	2,65	2,90
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,7150	0,00	-0,35	-0,54	4,9420	0	8	12	5,21	5,08	5,76
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,0440	0,00	-0,11	-0,60	3,5300	0	2	12	4,82	4,73	5,37
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,5060	0,00	-0,36	-0,48	5,1380	0	8	10	5,72	5,58	6,37
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,4440	0,00	-0,47	-0,58	5,1400	0	9	10	7,43	7,24	8,25
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,3620	0,00	-0,88	-0,97	5,4570	0	10	12	6,57	6,39	9,24
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1900	0,03	-0,05	-0,89	3,9210	0	1	14	7,94	7,79	8,53
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,1800	0,00	-1,00	-0,57	5,3260	0	16	9	7,95	7,74	9,39
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,4890	0,00	-1,06	-0,51	5,4390	0	14	7	7,97	7,76	10,47
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5290	0,04	0,00	-0,72	4,1360	0	0	9	10,53	10,31	12,27
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,9970	0,00	-1,24	-0,94	5,5380	0	13	10	8,82	8,58	12,59
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,7720	0,00	-1,40	-0,72	5,5720	0	16	8	12,10	11,78	16,64
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,5680	0,00	-1,91	-0,44	5,6560	0	14	3	13,64	13,27	26,48
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,0590	0,00	-1,72	-0,72	5,5860	0	16	7	15,49	15,07	26,79
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,5110	0,00	-2,07	-0,64	5,8380	0	14	5	14,29	13,89	30,25
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,8410	0,00	-1,58	-0,61	5,5650	0	15	6	18,05	17,56	36,66
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1770	0,00	-1,72	-0,72	5,7490	0	15	6	17,63	17,14	47,94
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,4770	0,00	-1,53	-0,61	5,7370	0	15	6	17,90	17,40	98,19

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index																		
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	404	1	3	15,98	10	155	2,64	4,78	8,57	13,02	13,58	12,02	9,82	13,06	10,49	6,56	3,23	2,24
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	Diario / Daily	Semanal / Weekly	12-Feb-30				31-Ene-35		12-Feb-40		12-Feb-46		12-Feb-54	
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	232	0	11	9,85	113	584	3,34				51,25		9,56		19,33		16,52	



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.