



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

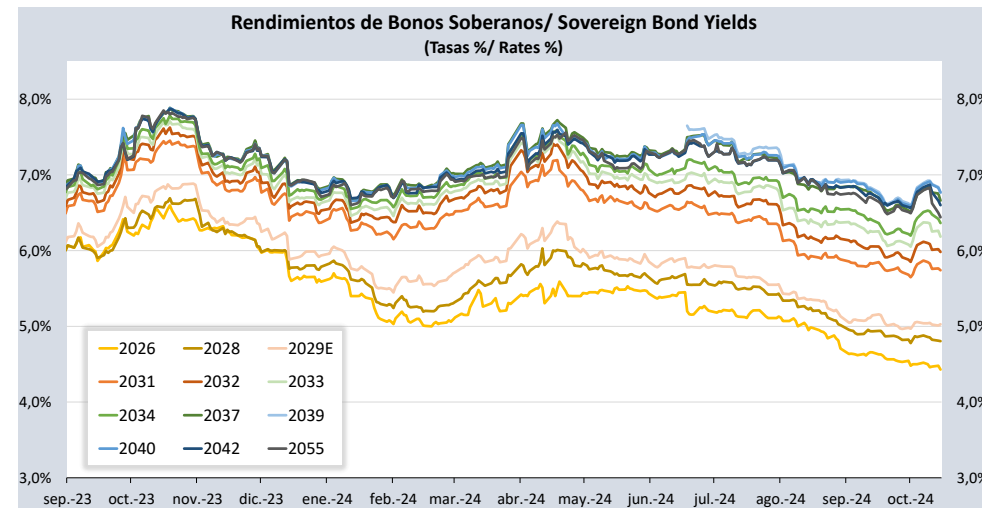
15/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

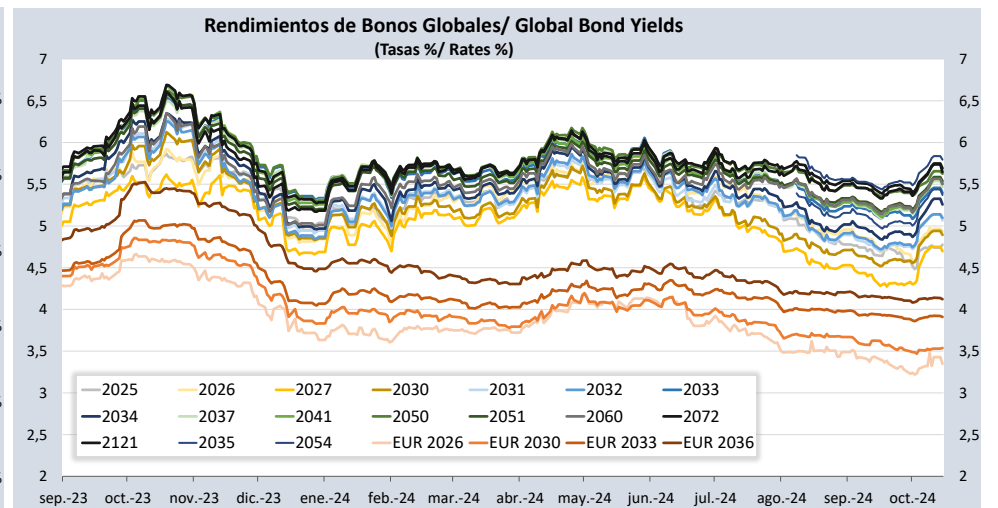
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,43	3 937	8,200	106,3795	106,49	106,49	106,5146	4,49	4,43	4,43	4,4300	1	15-Oct-24	10	1,74	1,66	1,83
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,10	7 225	6,350	105,23	105,33	105,30	105,2887	4,82	4,79	4,80	4,8053	4	15-Oct-24	8	3,48	3,32	3,83
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,03	13 176	5,940	103,41	103,55	103,51	103,4454	5,04	5,00	5,01	5,0273	11	15-Oct-24	349	3,91	3,72	4,33
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,21	19 573	6,950	106,59	106,90	106,67	106,7313	5,77	5,71	5,75	5,7409	35	15-Oct-24	270	5,62	5,31	6,83
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,07	21 442	6,150	100,80	101,23	100,98	101,0305	6,02	5,95	5,99	5,9821	57	15-Oct-24	403	6,36	6,00	7,83
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,27	17 855	7,300	107,33	107,57	107,44	107,5107	6,21	6,18	6,20	6,1850	34	15-Oct-24	220	6,77	6,37	8,83
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,94	16 860	5,400	92,92	93,38	93,11	93,0749	6,39	6,32	6,36	6,3639	37	15-Oct-24	151	7,70	7,24	9,83
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,20	20 481	6,900	101,81	102,30	102,22	102,1268	6,70	6,64	6,65	6,6605	49	15-Oct-24	632	8,79	8,24	12,83
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,19	15 436	7,600	107,74	107,93	107,78	107,8713	6,78	6,76	6,77	6,7611	49	15-Oct-24	472	9,32	8,73	14,83
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,93	12 142	5,350	86,36	86,70	86,61	86,4245	6,78	6,74	6,75	6,7716	25	15-Oct-24	236	10,49	9,82	15,83
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,19	5 033	6,850	-	-	-	102,6290	-	-	-	6,6010	-	14-Oct-24	2	10,53	9,87	17,33
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,17	3 462	6,714	-	-	-	103,7001	-	-	-	6,4410	-	14-Oct-24	6	13,64	12,81	30,33
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,50	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,0791	-	-	-	2,8503	-	18-Ago-23	20	5,02	4,89	5,33
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,53	911	7,39% + VAC	-	-	-	137,0020	-	-	-	3,1303	-	10-Jun-22	10	7,89	7,65	10,30
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,55	228	3,14%+VAC	-	-	-	98,6723	-	-	-	3,2302	-	10-Ago-23	50	12,37	11,98	15,33
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,67	424	3,83% + VAC	-	-	-	108,0250	-	-	-	3,2894	-	11-Oct-24	52	15,40	14,91	21,83
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,57	383	3,26%+VAC	-	-	-	98,4862	-	-	-	3,3268	-	11-Oct-24	243	19,16	18,55	29,33

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).

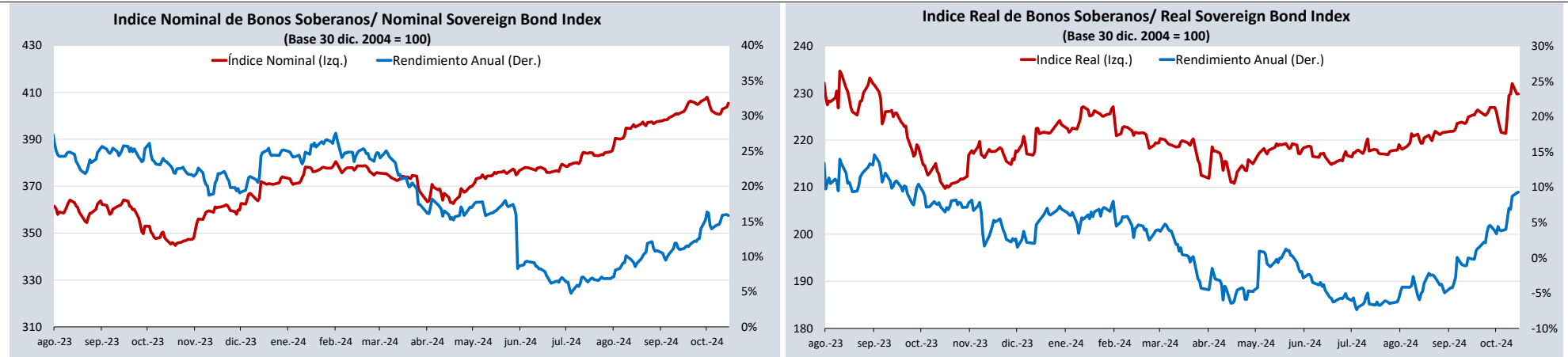


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,8980	-0,03	-0,08	-0,50	4,7760	4	5	67	0,75	0,73	0,78
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9010	0,04	0,01	-0,46	4,9380	-3	3	39	1,25	1,22	1,29
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,2510	0,10	-0,02	-0,41	3,3470	-8	3	33	1,27	1,25	1,31
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,4820	0,14	0,03	-0,46	4,6970	-5	-1	18	2,71	2,65	2,90
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,9430	0,23	-0,07	-0,53	4,8930	-5	2	11	5,21	5,08	5,76
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,0050	-0,04	-0,06	-0,57	3,5380	1	1	12	4,82	4,73	5,37
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,8650	0,36	0,09	-0,61	5,0660	-7	-1	12	5,72	5,58	6,36
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,7030	0,26	-0,06	-0,52	5,0960	-4	2	9	7,43	7,24	8,25
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,8500	0,49	-0,17	-0,95	5,3970	-6	2	12	6,57	6,40	9,23
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,2620	0,07	0,02	-0,90	3,9100	-1	0	14	7,94	7,78	8,53
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,6320	0,45	-0,27	-0,60	5,2570	-7	4	9	7,95	7,74	9,39
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,0260	0,54	-0,30	-0,50	5,3710	-7	4	6	7,97	7,76	10,47
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,6490	0,12	0,02	-0,80	4,1220	-1	0	10	10,53	10,31	12,27
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,6750	0,68	-0,40	-0,88	5,4650	-7	4	9	8,83	8,59	12,59
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,3610	0,59	-0,58	-0,70	5,5070	-7	7	8	12,12	11,80	16,64
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,9870	0,42	-1,29	-0,59	5,6260	-3	9	4	13,67	13,29	26,47
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,5810	0,52	-0,86	-0,76	5,5380	-5	8	7	15,53	15,11	26,78
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,1130	0,60	-1,09	-0,64	5,7950	-4	8	4	14,33	13,93	30,25
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,4960	0,66	-0,71	-0,66	5,5010	-6	7	6	18,16	17,67	36,66
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,8450	0,67	-0,74	-0,70	5,6910	-6	6	6	17,76	17,26	47,94
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,3980	0,92	-0,33	-0,63	5,6460	-9	3	6	18,18	17,68	98,19

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	405	2	4	15,82	-17	139	2,63	4,76	8,53	12,99	13,56	12,03	9,82	13,11	10,52	6,57	3,24	2,25
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-Feb-30				31-Ene-35		12-Feb-40		12-Feb-46		12-Feb-54	
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	230	0	8	9,30	10	530	3,21				52,45		9,40		19,16		15,78	



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.