



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

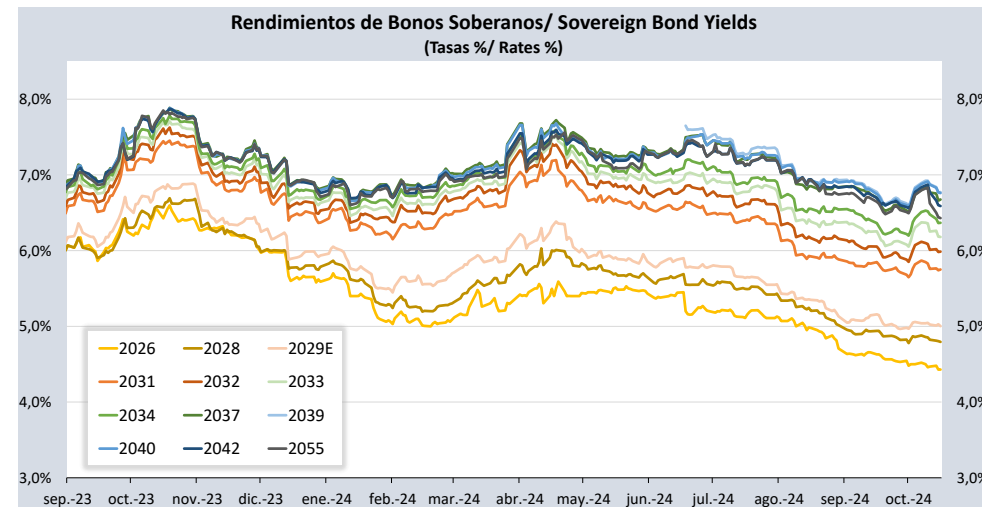
16/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

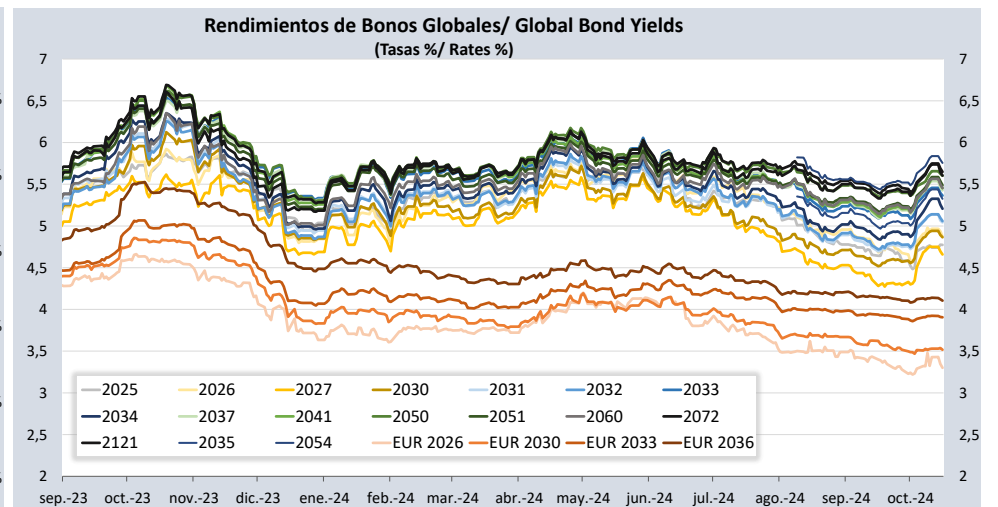
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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	1,45	3 937	8,200	-	-	-	106,5053	-	-	-	4,4300	-	15-Oct-24	10	1,74	1,66	1,83
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,12	7 225	6,350	105,22	105,36	105,25	105,3242	4,82	4,78	4,81	4,7943	13	16-Oct-24	24	3,48	3,32	3,83
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,05	13 176	5,940	103,44	103,54	103,50	103,5379	5,03	5,00	5,01	5,0030	18	16-Oct-24	74	3,91	3,72	4,33
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,23	19 573	6,950	106,55	106,62	106,61	106,6764	5,77	5,76	5,76	5,7501	17	16-Oct-24	181	5,61	5,31	6,83
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,09	21 442	6,150	100,86	100,98	100,92	100,9996	6,01	5,99	6,00	5,9871	34	16-Oct-24	164	6,36	6,00	7,83
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,29	17 855	7,300	107,33	107,54	107,47	107,5409	6,21	6,18	6,19	6,1804	22	16-Oct-24	161	6,76	6,37	8,83
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,95	16 860	5,400	93,04	93,11	93,04	93,0532	6,37	6,36	6,37	6,3673	42	16-Oct-24	266	7,69	7,23	9,83
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,22	20 481	6,900	101,85	102,00	101,96	102,0024	6,69	6,68	6,68	6,6751	52	16-Oct-24	339	8,78	8,23	12,83
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,21	15 436	7,600	107,73	107,94	107,73	107,7526	6,78	6,75	6,78	6,7734	86	16-Oct-24	416	9,31	8,72	14,83
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,94	12 142	5,350	86,40	86,79	86,62	86,5272	6,78	6,73	6,75	6,7598	28	16-Oct-24	165	10,49	9,83	15,83
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,21	5 033	6,850	-	-	-	102,7499	-	-	-	6,5892	-	14-Oct-24	2	10,53	9,88	17,33
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,19	3 462	6,714	-	-	-	103,8587	-	-	-	6,4292	-	14-Oct-24	6	13,65	12,82	30,33
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,51	77	2,89%+VAC	-	-	-	102,6451	-	-	-	2,3360	-	18-Ago-23	20	7,86	7,60	5,33
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,55	911	7,39% + VAC	-	-	-	134,3685	-	-	-	3,3813	-	10-Jun-22	10	12,26	11,82	10,29
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,55	228	3,14%+VAC	-	-	-	93,4460	-	-	-	3,6849	-	10-Ago-23	50	15,34	14,83	15,33
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,68	424	3,83% + VAC	-	-	-	106,0854	-	-	-	3,4105	-	11-Oct-24	52	19,24	18,63	21,83
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,58	383	3,26%+VAC	-	-	-	99,6249	-	-	-	3,2653	-	11-Oct-24	243	0,00	0,00	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).

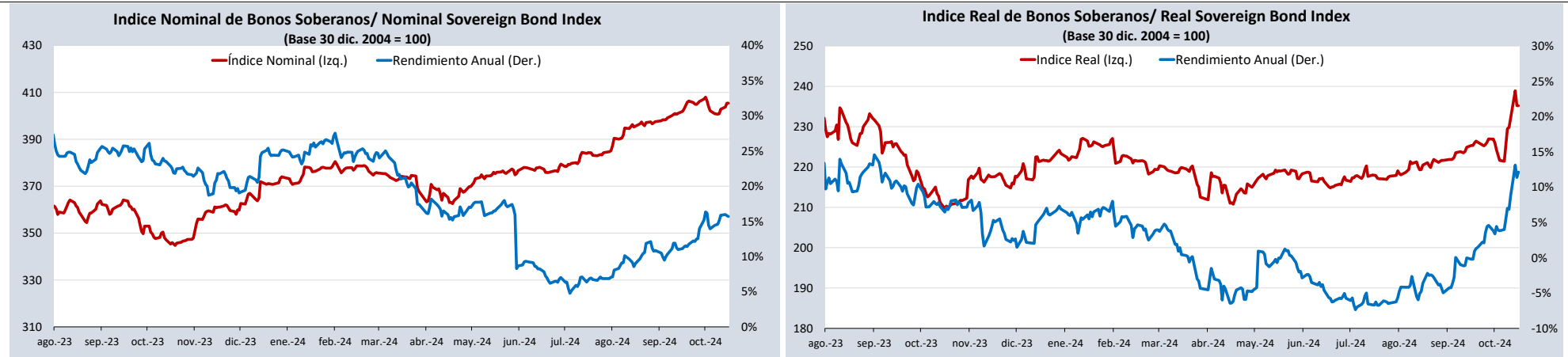


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,8930	0,00	-0,06	-0,46	4,7730	0	2	61	0,75	0,73	0,77
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9820	0,08	0,17	-0,47	4,8750	-6	-10	40	1,25	1,22	1,29
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3100	0,06	0,23	-0,47	3,3000	-5	-18	38	1,27	1,25	1,31
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,5850	0,10	0,20	-0,49	4,6580	-4	-7	19	2,71	2,65	2,90
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,0840	0,14	0,23	-0,54	4,8640	-3	-4	12	5,20	5,08	5,76
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,1060	0,10	-0,02	-0,60	3,5170	-2	0	12	4,81	4,73	5,37
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,9830	0,12	0,36	-0,52	5,0430	-2	-7	11	5,72	5,58	6,36
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,9170	0,21	0,32	-0,53	5,0590	-4	-5	9	7,42	7,24	8,24
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	124,1120	0,26	0,43	-0,98	5,3640	-3	-6	12	6,57	6,40	9,23
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,2900	0,03	0,13	-0,89	3,9060	0	-1	14	7,93	7,78	8,52
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,9710	0,34	0,36	-0,60	5,2060	-5	-5	9	7,95	7,75	9,38
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,3880	0,36	0,46	-0,52	5,3250	-5	-6	7	7,97	7,77	10,46
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,7870	0,14	0,25	-0,81	4,1050	-2	-3	10	10,53	10,31	12,26
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,0430	0,37	0,42	-0,93	5,4270	-4	-4	10	8,83	8,60	12,59
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,8510	0,49	0,25	-0,73	5,4530	-5	-3	8	12,13	11,81	16,64
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	100,3210	0,33	-0,28	-0,50	5,6010	-3	2	4	13,68	13,31	26,47
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,1390	0,56	0,09	-0,72	5,4880	-5	-1	6	15,57	15,15	26,78
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,6870	0,57	0,11	-0,64	5,7550	-4	-1	4	14,37	13,97	30,24
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,9910	0,49	0,41	-0,64	5,4540	-5	-4	6	18,23	17,75	36,65
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,3460	0,50	0,24	-0,72	5,6480	-4	-2	6	17,85	17,36	47,94
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,8380	0,44	0,71	-0,66	5,6040	-4	-7	6	18,31	17,81	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	0	5	15,69	-12	111	2,63	4,76	8,54	12,98	13,56	12,04	9,82	13,09	10,51	6,58	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	235	0	6	12,15	77	513	3,35				52,28		9,05		19,11		16,22	



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.