



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

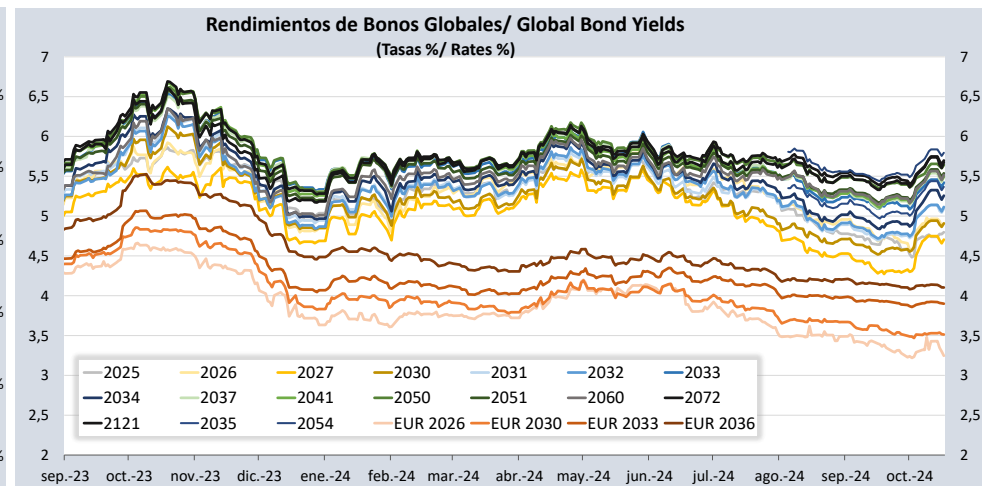
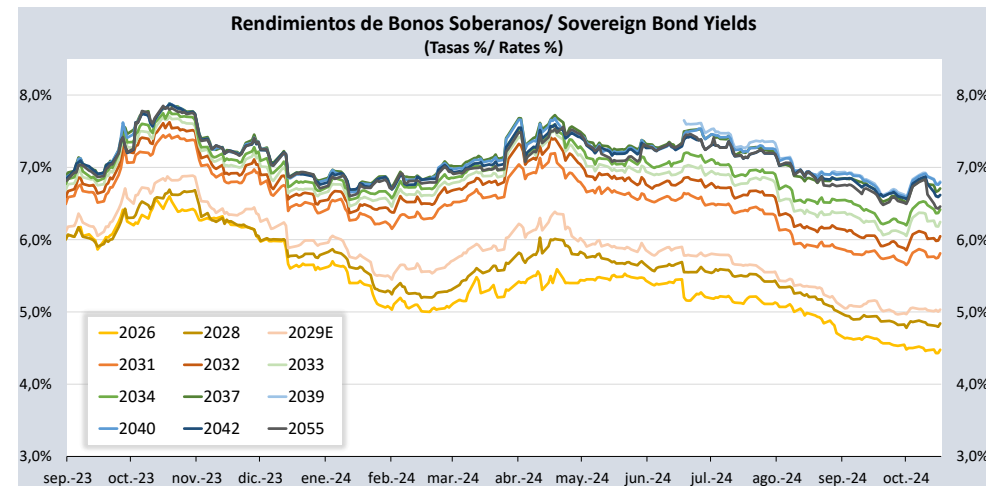
17/10/2024

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	1,47	3 937	8,200	-	-	-	106,4142	-	-	-	4,4757	-	15-Oct-24	10	1,73	1,66	1,82
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,14	7 225	6,350	105,11	105,28	105,14	105,1595	4,85	4,80	4,84	4,8400	2	17-Oct-24	4	3,48	3,32	3,82
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,07	13 176	5,940	103,36	103,50	103,44	103,4229	5,05	5,01	5,03	5,0321	3	17-Oct-24	7	3,90	3,72	4,32
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,25	19 573	6,950	106,27	106,52	106,27	106,3258	5,82	5,78	5,82	5,8111	31	17-Oct-24	138	5,61	5,30	6,82
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,10	21 442	6,150	100,43	100,92	100,61	100,6383	6,08	6,00	6,05	6,0462	23	17-Oct-24	242	6,35	5,99	7,82
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,31	17 855	7,300	106,91	106,98	106,98	107,0996	6,27	6,26	6,26	6,2440	56	17-Oct-24	539	6,76	6,36	8,82
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,97	16 860	5,400	92,46	92,84	92,64	92,7128	6,46	6,40	6,43	6,4177	29	17-Oct-24	166	7,69	7,22	9,82
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,24	20 481	6,900	101,12	101,96	101,62	101,7266	6,78	6,68	6,72	6,7076	34	17-Oct-24	515	8,77	8,22	12,82
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,23	15 436	7,600	107,16	107,64	107,21	107,4744	6,84	6,79	6,83	6,8024	21	17-Oct-24	151	9,30	8,71	14,82
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,96	12 142	5,350	86,11	86,36	86,19	86,2815	6,81	6,78	6,80	6,7886	15	17-Oct-24	255	10,48	9,81	15,82
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,23	5 033	6,850	-	-	-	102,4546	-	-	-	6,6180	-	14-Oct-24	2	10,51	9,86	17,32
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,20	3 462	6,714	-	-	-	103,4720	-	-	-	6,4580	-	14-Oct-24	6	13,61	12,79	30,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,52	77	2,89%+VAC	-	-	-	102,4379	-	-	-	2,3767	-	18-Ago-23	20	5,02	4,91	5,32
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,57	911	7,39% + VAC	-	-	-	133,8841	-	-	-	3,4276	-	10-Jun-22	10	7,85	7,59	10,29
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,56	228	3,14%+VAC	-	-	-	93,1353	-	-	-	3,7130	-	10-Ago-23	50	12,25	11,81	15,32
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,69	424	3,83% + VAC	-	-	-	105,6430	-	-	-	3,4385	-	11-Oct-24	52	15,31	14,80	21,82
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,59	383	3,26%+VAC	98,06	98,98	98,06	97,2603	3,35	3,30	3,35	3,3941	-	17-Oct-24	17	19,08	18,46	29,32

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	101,8680	-0,03	-0,07	-0,47	4,7970	2	3	63	0,74	0,73	0,77
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9490	-0,03	0,09	-0,48	4,9080	3	-3	40	1,25	1,22	1,29
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3790	0,07	0,10	-0,51	3,2470	-5	-8	42	1,27	1,25	1,31
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,4640	-0,12	0,14	-0,52	4,7050	5	-5	20	2,71	2,64	2,89
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,8850	-0,20	0,14	-0,57	4,9080	4	-2	12	5,20	5,08	5,76
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,1230	0,02	0,06	-0,71	3,5130	0	-1	15	4,81	4,73	5,36
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,7410	-0,24	0,20	-0,55	5,0930	5	-3	11	5,71	5,57	6,36
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,6070	-0,31	0,14	-0,54	5,1140	5	-2	9	7,42	7,23	8,24
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,6490	-0,46	0,13	-1,05	5,4200	6	-2	13	6,56	6,39	9,23
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,3440	0,05	0,16	-0,90	3,9000	-1	-2	15	7,93	7,78	8,52
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,6430	-0,33	0,32	-0,60	5,2570	5	-4	9	7,94	7,74	9,38
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,0520	-0,34	0,43	-0,51	5,3670	4	-5	7	7,97	7,76	10,46
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,8100	0,02	0,26	-0,80	4,1040	0	-3	10	10,52	10,31	12,26
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,3910	-0,65	0,21	-0,93	5,4950	7	-2	10	8,82	8,58	12,59
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,4850	-0,37	0,31	-0,72	5,4940	4	-3	8	12,12	11,79	16,64
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,7900	-0,53	-0,21	-0,39	5,6400	4	1	3	13,65	13,27	26,47
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,5960	-0,54	0,18	-0,74	5,5370	5	-2	7	15,52	15,11	26,78
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,1130	-0,57	0,26	-0,64	5,7950	4	-2	4	14,33	13,92	30,24
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,3210	-0,67	0,32	-0,67	5,5180	6	-3	7	18,12	17,64	36,65
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,7660	-0,58	0,23	-0,74	5,6980	5	-2	6	17,74	17,24	47,93
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,1040	-0,73	0,40	-0,74	5,6750	7	-4	7	18,08	17,58	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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	404	-1	3	16,16	47	103	2,64	4,77	8,55	12,98	13,55	12,02	9,81	13,10	10,52	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	234	0	4	11,08	-32	421	3,36				52,45		9,08		19,17		15,94

