



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

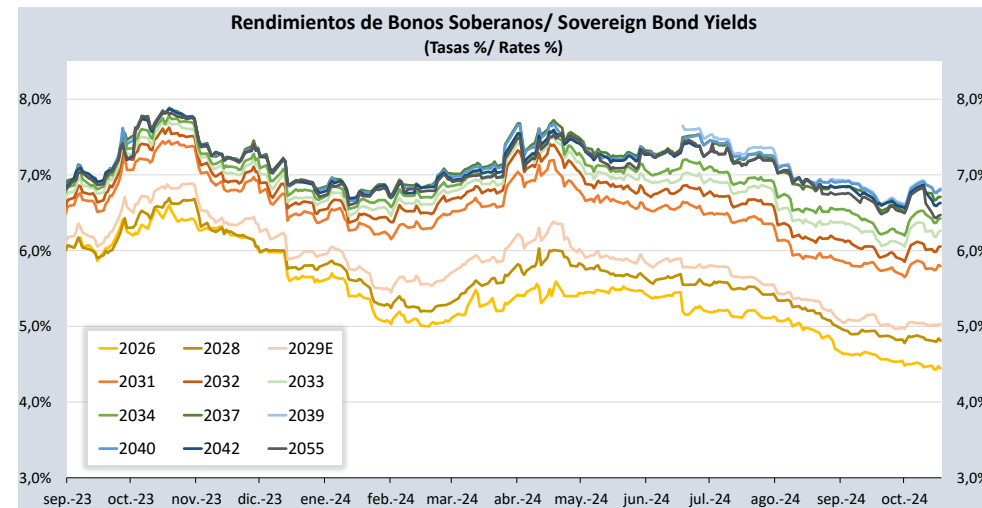
18/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

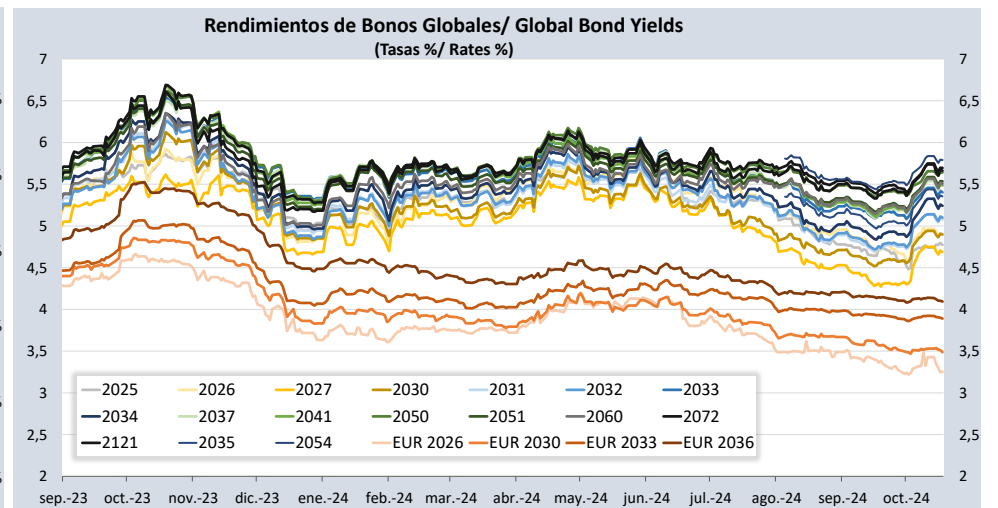
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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	1,49	3 937	8,200	-	-	-	106,4599	-	-	-	4,4450	-	15-Oct-24	10	1,73	1,66	1,82
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,16	7 225	6,350	105,16	105,28	105,21	105,2620	4,84	4,80	4,82	4,8100	2	18-Oct-24	4	3,47	3,31	3,82
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,08	13 176	5,940	-	-	-	103,4486	-	-	-	5,0250	-	17-Oct-24	7	3,90	3,71	4,32
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,27	19 573	6,950	106,09	106,32	106,21	106,4065	5,85	5,81	5,83	5,7966	17	18-Oct-24	232	5,60	5,30	6,82
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,12	21 442	6,150	100,37	100,80	100,43	100,5833	6,09	6,02	6,08	6,0552	20	18-Oct-24	99	6,35	5,99	7,82
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,33	17 855	7,300	106,77	107,39	106,84	106,9623	6,29	6,20	6,28	6,2637	20	18-Oct-24	191	6,75	6,35	8,82
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,98	16 860	5,400	92,37	92,84	92,57	92,6737	6,47	6,40	6,44	6,4237	29	18-Oct-24	125	7,68	7,22	9,82
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,26	20 481	6,900	101,28	101,87	101,54	101,7137	6,76	6,69	6,73	6,7091	14	18-Oct-24	30	8,77	8,22	12,82
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,25	15 436	7,600	107,02	107,49	107,02	107,2821	6,85	6,80	6,85	6,8225	30	18-Oct-24	184	9,29	8,70	14,82
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,97	12 142	5,350	85,85	86,45	86,02	86,1717	6,84	6,77	6,82	6,8016	16	18-Oct-24	80	10,47	9,81	15,82
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,25	5 033	6,850	-	-	-	102,3217	-	-	-	6,6310	-	14-Oct-24	2	10,51	9,85	17,32
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,22	3 462	6,714	-	-	-	103,2981	-	-	-	6,4710	-	14-Oct-24	6	13,60	12,77	30,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,53	77	2,89%+VAC	-	-	-	102,4863	-	-	-	2,3669	-	18-Ago-23	20	5,02	4,91	5,32
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,59	911	7,39% + VAC	-	-	-	133,8243	-	-	-	3,4327	-	10-Jun-22	10	7,84	7,58	10,29
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,57	228	3,14%+VAC	-	-	-	92,9584	-	-	-	3,7291	-	10-Ago-23	50	12,24	11,80	15,32
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,70	649	3,83% + VAC	-	-	-	105,4429	-	-	-	3,4512	-	11-Oct-24	52	15,30	14,79	21,82
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,59	1 133	3,26%+VAC	-	-	97,15	97,1543	-	-	3,40	3,4000	-	18-Oct-24	5	19,08	18,45	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).

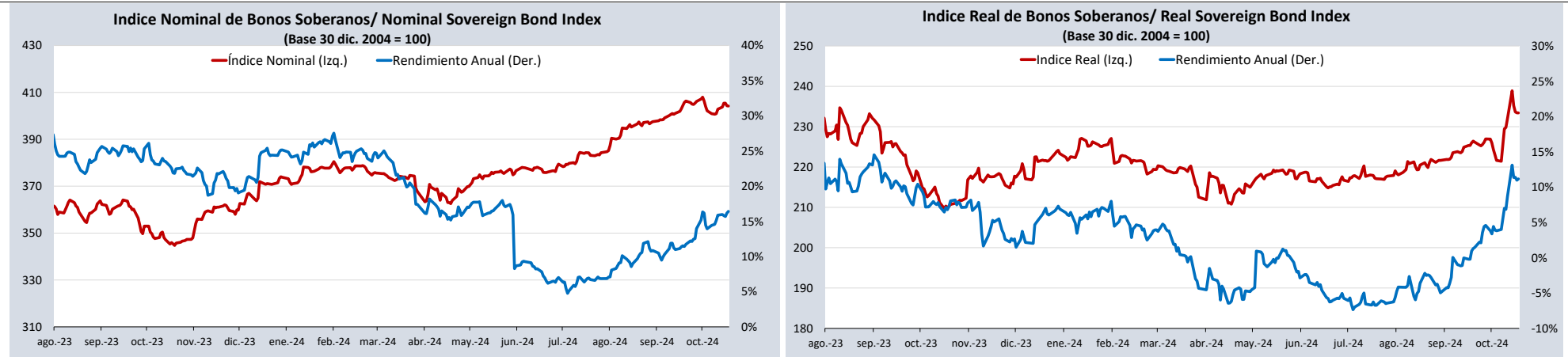


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,8660	0,00	-0,07	-0,47	4,7730	-2	3	64	0,74	0,72	0,77
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9770	0,03	0,12	-0,47	4,9010	-1	-7	40	1,25	1,22	1,28
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3720	-0,01	0,22	-0,44	3,2540	1	-17	36	1,26	1,24	1,30
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,5130	0,05	0,17	-0,52	4,6880	-2	-6	20	2,70	2,64	2,89
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,9410	0,06	0,23	-0,55	4,8980	-1	-4	12	5,20	5,07	5,75
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,2500	0,13	0,21	-0,63	3,4870	-3	-4	13	4,81	4,73	5,36
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,8320	0,09	0,33	-0,55	5,0770	-2	-6	11	5,71	5,57	6,36
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,7090	0,10	0,27	-0,57	5,1000	-1	-4	10	7,42	7,23	8,24
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,7670	0,12	0,41	-1,04	5,4030	-2	-5	13	6,56	6,39	9,23
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,4100	0,07	0,25	-0,94	3,8900	-1	-3	15	7,93	7,78	8,52
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,7530	0,11	0,57	-0,62	5,2410	-2	-9	9	7,94	7,74	9,38
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,1550	0,10	0,67	-0,52	5,3540	-1	-9	7	7,97	7,76	10,46
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,8840	0,07	0,40	-0,81	4,0950	-1	-4	10	10,52	10,31	12,26
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,5100	0,12	0,51	-0,88	5,4820	-1	-6	9	8,82	8,58	12,58
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,5350	0,05	0,76	-0,77	5,4890	0	-8	9	12,12	11,79	16,63
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,7800	-0,01	0,21	-0,61	5,6410	0	-1	4	13,65	13,27	26,46
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,6220	0,03	0,56	-0,76	5,5350	0	-5	7	15,52	15,10	26,78
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,1810	0,07	0,67	-0,62	5,7910	0	-5	4	14,33	13,93	30,24
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,4060	0,09	0,56	-0,68	5,5100	-1	-6	7	18,13	17,65	36,65
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,7970	0,03	0,62	-0,76	5,6950	0	-5	6	17,74	17,25	47,93
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,2280	0,12	0,75	-0,74	5,6630	-1	-7	7	18,12	17,62	98,18

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	404	0	1	16,42	26	54	2,64	4,78	8,56	12,99	13,55	12,01	9,81	13,10	10,50	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	233	0	1	11,17	18	246	3,37				52,48		9,07		19,15		15,94	



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.