Dirección de Planificación Financiera y Estrategia
Dirección General de Tesoro Público
Ministerio de Economia y Finanzas

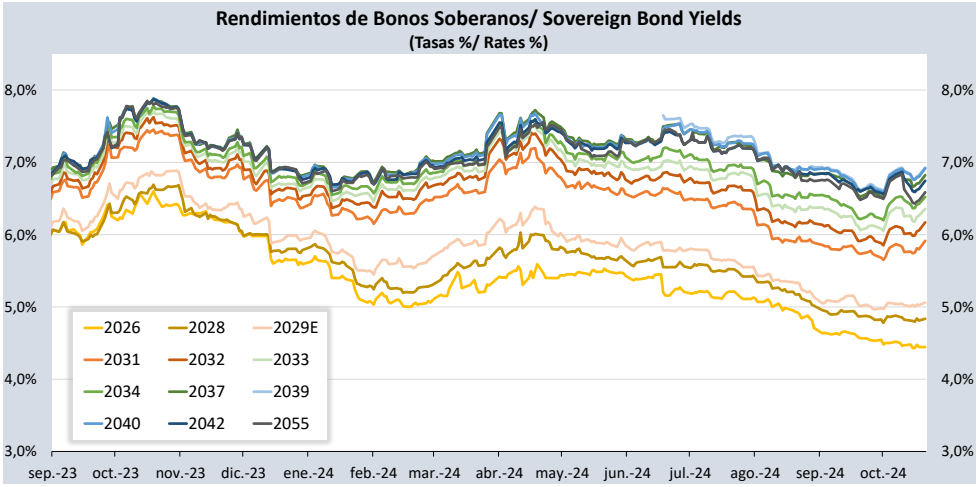
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

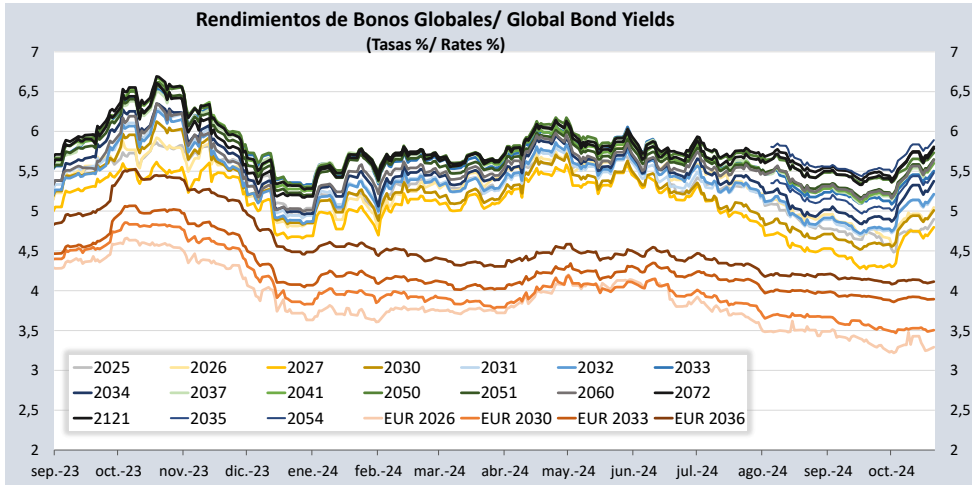
21/10/2024

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
						Postura / Position				Postura / Position									
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)	Millones S/. / Millions PEN		Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado / Weighted average (%)		Día / Date	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,56	3 937	8,200	-	-	-	106,4322	-	-	-	4,4450	-	15-Oct-24	10	1,72	1,65	1,82
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,21	7 225	6,350	103,54	105,35	105,14	**105,1579**	5,30	4,78	4,84	**4,8367**	**3**	21-Oct-24	6	3,47	3,31	3,82
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,13	13 176	5,940	102,38	103,34	103,34	**103,3074**	5,30	5,05	5,05	**5,0600**	**4**	21-Oct-24	8	3,89	3,70	4,32
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,32	19 573	6,950	105,24	106,66	105,64	**105,7296**	6,00	5,75	5,93	**5,9148**	**15**	21-Oct-24	46	5,59	5,28	6,82
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,17	21 442	6,150	99,47	99,89	99,59	**99,8882**	6,24	6,17	6,22	**6,1699**	**45**	21-Oct-24	174	6,34	5,97	7,82
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,39	17 855	7,300	105,21	107,18	105,82	**106,3133**	6,52	6,23	6,43	**6,3578**	**15**	21-Oct-24	160	6,74	6,33	8,82
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,03	16 860	5,400	91,30	92,24	91,57	**92,0232**	6,63	6,49	6,59	**6,5211**	**13**	21-Oct-24	45	7,66	7,20	9,82
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,31	20 481	6,900	99,70	101,54	100,20	**100,7561**	6,95	6,73	6,89	**6,8230**	**13**	21-Oct-24	205	8,74	8,18	12,82
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,31	15 436	7,600	105,14	105,98	105,79	**106,2869**	7,05	6,96	6,98	**6,9275**	**16**	21-Oct-24	151	9,26	8,66	14,82
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,02	12 142	5,350	84,09	85,51	85,01	**85,2020**	7,05	6,88	6,94	**6,9165**	**17**	21-Oct-24	64	10,43	9,75	15,82
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,30	5 033	6,850	-	-	-	101,1586	-	-	-	6,7459	-	14-Oct-24	2	10,46	9,80	17,32
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,28	3 462	6,714	-	-	-	101,7826	-	-	-	6,5859	-	14-Oct-24	6	13,48	12,64	30,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,55	77	2,89%+VAC	-	-	-	102,0710	-	-	-	2,4487	-	18-Ago-23	20	5,01	4,89	5,32
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,65	911	7,39% + VAC	-	-	-	132,6522	-	-	-	3,5454	-	10-Jun-22	10	7,82	7,55	10,29
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,60	228	3,14%+VAC	-	-	-	91,6239	-	-	-	3,8514	-	10-Ago-23	50	12,20	11,75	15,32
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,73	649	3,83% + VAC	-	-	-	103,4728	-	-	-	3,5782	-	11-Oct-24	52	15,22	14,69	21,82
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,62	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	96,5642	-	-	-	3,4329	-	18-Oct-24	5	19,03	18,40	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.

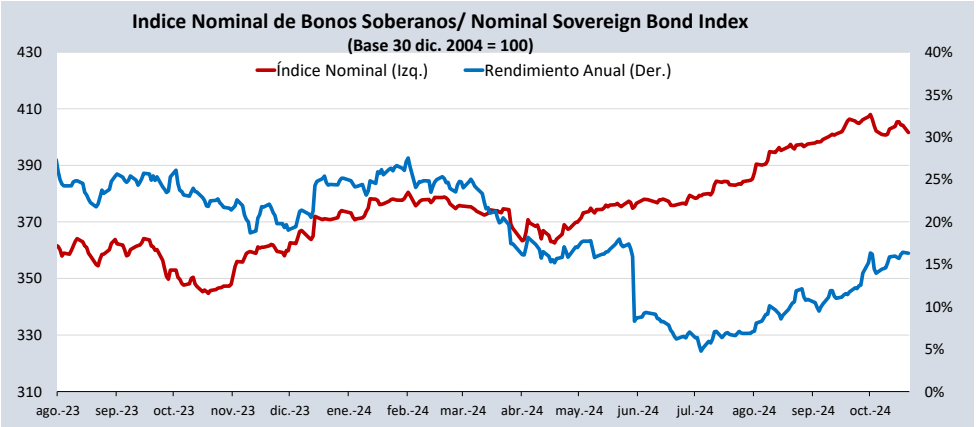
Bonos globales**** / Global bonds

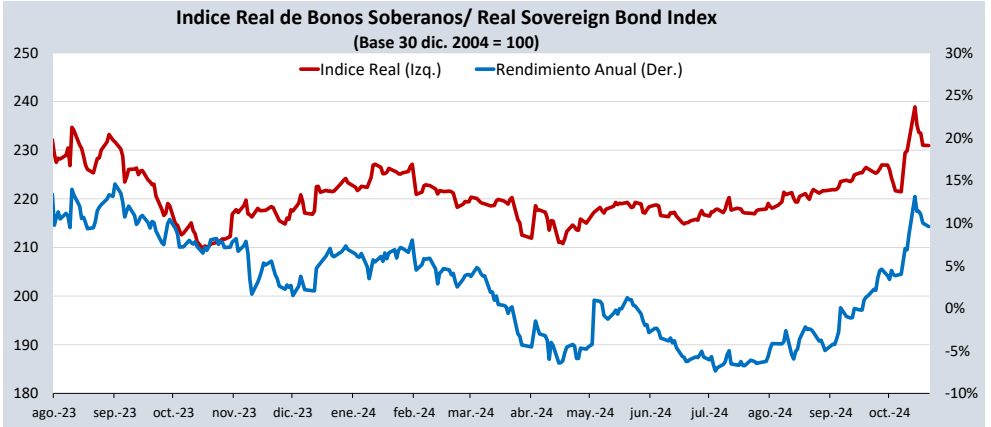
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra-venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra-venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	101,7660	-0,10	-0,17	-0,44	4,8990	13	16	60	0,73	0,71	0,76
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8130	-0,16	-0,05	-0,44	5,0460	15	8	38	1,24	1,21	1,28
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3270	-0,05	0,18	-0,55	3,2920	4	-14	45	1,25	1,23	1,29
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,2270	-0,29	-0,12	-0,46	4,7980	11	5	18	2,70	2,63	2,88
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,4390	-0,50	-0,28	-0,47	5,0090	11	7	10	5,19	5,06	5,74
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,1620	-0,09	0,12	-0,73	3,5050	2	-2	15	4,80	4,72	5,35
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,2020	-0,63	-0,30	-0,51	5,2060	13	7	11	5,70	5,55	6,35
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,0680	-0,64	-0,38	-0,51	5,2130	11	7	9	7,41	7,22	8,23
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,9660	-0,80	-0,40	-0,97	5,5020	10	4	12	6,54	6,37	9,22
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,3890	-0,02	0,20	-0,92	3,8950	0	-3	15	7,92	7,77	8,51
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,8850	-0,87	-0,30	-0,58	5,3760	14	5	9	7,92	7,71	9,37
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,1700	-0,98	-0,32	-0,54	5,4800	13	4	7	7,94	7,73	10,45
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,7320	-0,15	0,20	-0,78	4,1140	2	-2	10	10,51	10,30	12,25
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,2960	-1,21	-0,70	-0,91	5,6110	13	7	10	8,79	8,55	12,58
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,5480	-0,99	-0,22	-0,69	5,5990	11	3	8	12,08	11,75	16,63
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,5620	-1,22	-1,01	-0,31	5,7320	9	8	2	13,56	13,18	26,46
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,4020	-1,22	-0,66	-0,70	5,6470	11	6	6	15,41	14,99	26,77
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,7800	-1,40	-0,73	-0,63	5,8900	10	5	5	14,22	13,81	30,23
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,0940	-1,31	-0,75	-0,58	5,6400	13	7	6	17,91	17,42	36,64
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,5370	-1,26	-0,64	-0,71	5,8070	11	6	6	17,49	16,99	47,92
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,9930	-1,24	-0,48	-0,66	5,7860	12	5	7	17,73	17,23	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	402	-3	-2	16,31	-11	33	2,66	4,81	8,60	13,00	13,55	12,02	9,81	13,07	10,48	6,55	3,22	2,23

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	231	0	-8	9,59	-43	-353	3,39	52,58	9,04	18,99	16,01





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.