



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

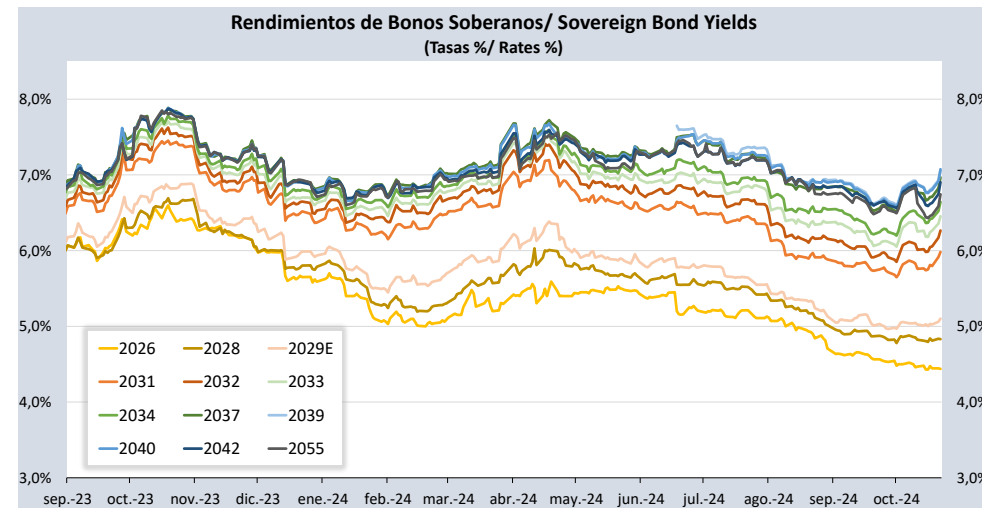
22/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

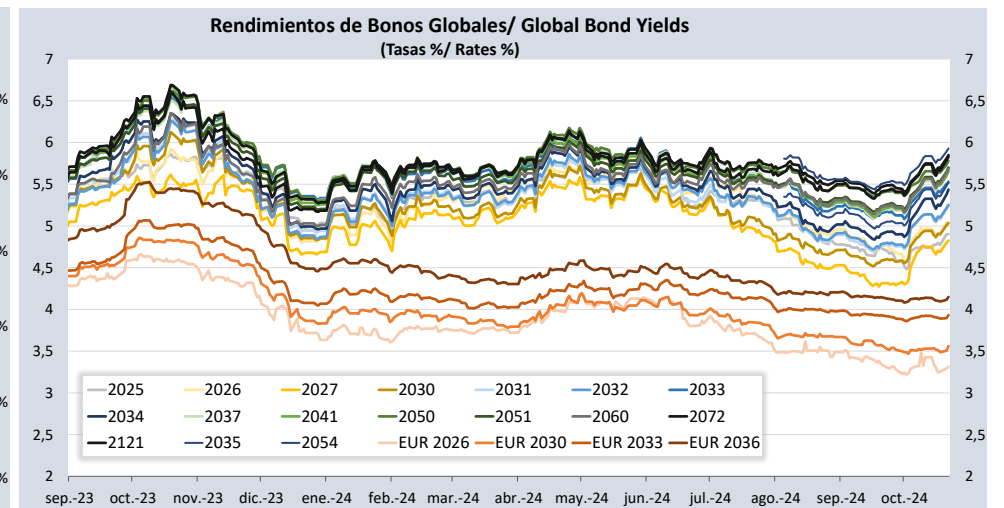
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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	1,58	3 937	8,200	-	-	-	106,4349	-	-	-	4,4383	-	15-Oct-24	10	1,72	1,65	1,81
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,23	7 225	6,350	104,78	105,20	105,17	105,1782	4,94	4,82	4,83	4,8300	1	22-Oct-24	2	3,46	3,31	3,81
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,15	13 176	5,940	102,95	103,15	103,11	103,1414	5,15	5,10	5,11	5,1025	7	22-Oct-24	8	3,89	3,70	4,31
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,34	19 573	6,950	105,13	105,36	105,24	105,3474	6,02	5,98	6,00	5,9823	20	22-Oct-24	47	5,59	5,27	6,81
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,19	21 442	6,150	99,23	99,77	99,29	99,3123	6,28	6,19	6,27	6,2658	20	22-Oct-24	97	6,33	5,95	7,81
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,41	17 855	7,300	105,24	105,99	105,34	105,6586	6,52	6,41	6,50	6,4540	5	22-Oct-24	7	6,72	6,32	8,81
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,04	16 960	5,400	91,07	91,70	91,24	91,2108	6,67	6,57	6,64	6,6434	16	22-Oct-24	91	7,65	7,17	9,81
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,33	20 481	6,900	99,54	100,45	99,70	99,5653	6,97	6,86	6,95	6,9668	10	22-Oct-24	139	8,71	8,14	12,81
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,33	15 436	7,600	104,82	105,79	105,10	105,0985	7,09	6,98	7,06	7,0549	19	22-Oct-24	197	9,22	8,61	14,81
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,03	12 442	5,350	83,93	84,76	84,26	83,8916	7,07	6,97	7,03	7,0742	10	22-Oct-24	192	10,38	9,69	15,81
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,32	5 033	6,850	-	-	-	99,5936	-	-	-	6,9036	-	14-Oct-24	2	10,39	9,72	17,31
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,30	3 462	6,714	-	-	-	99,7610	-	-	-	6,7436	-	14-Oct-24	6	13,32	12,48	30,31
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,56	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,8906	-	-	-	2,4845	-	18-Ago-23	20	5,01	4,89	5,31
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,67	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,5686	-	-	-	3,6521	-	10-Jun-22	10	7,81	7,53	10,28
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,61	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,3031	-	-	-	3,9745	-	10-Ago-23	50	12,17	11,71	15,31
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,74	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,3922	-	-	-	3,7159	-	11-Oct-24	52	15,14	14,60	21,81
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,63	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	94,1461	-	-	-	3,5705	-	18-Oct-24	5	18,88	18,23	29,31

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).

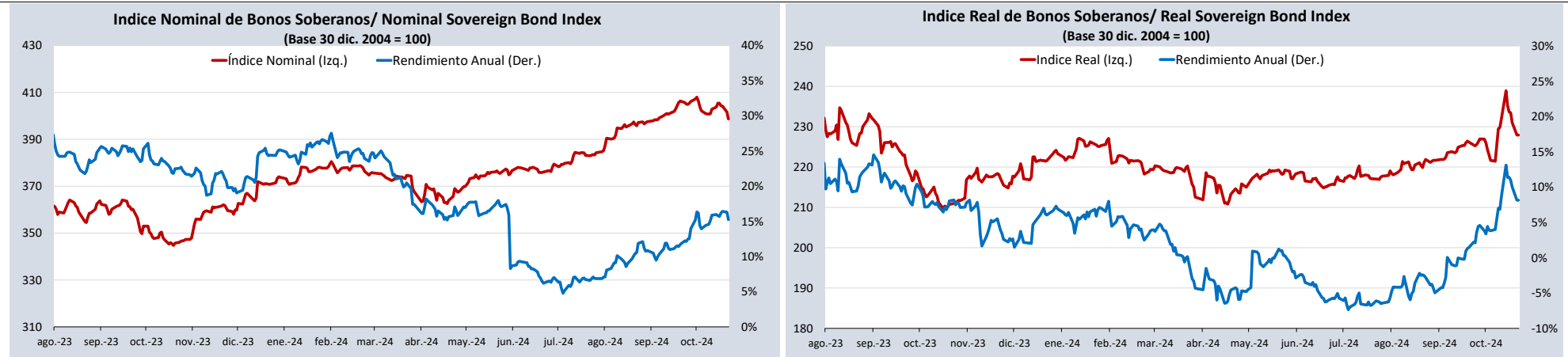


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,7560	-0,01	-0,14	-0,45	4,9040	0	13	61	0,73	0,71	0,76
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8760	0,06	-0,02	-0,49	4,9980	-5	6	42	1,23	1,20	1,27
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3030	-0,02	0,05	-0,46	3,3130	2	-3	38	1,25	1,23	1,29
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1570	-0,07	-0,33	-0,48	4,8250	3	13	19	2,69	2,63	2,88
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,3130	-0,13	-0,63	-0,43	5,0370	3	14	9	5,19	5,06	5,74
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,9080	-0,25	-0,10	-0,63	3,5580	5	2	13	4,80	4,71	5,35
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,0420	-0,16	-0,82	-0,47	5,2400	3	17	10	5,70	5,55	6,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8490	-0,22	-0,85	-0,49	5,2530	4	16	9	7,40	7,21	8,23
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,8390	-0,13	-1,01	-0,91	5,5170	2	12	11	6,54	6,36	9,21
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1600	-0,23	-0,10	-0,92	3,9320	4	2	15	7,92	7,76	8,51
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,5030	-0,38	-1,13	-0,57	5,4360	6	18	9	7,92	7,71	9,37
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7470	-0,42	-1,28	-0,55	5,5350	5	16	7	7,94	7,72	10,45
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4470	-0,28	-0,20	-0,81	4,1490	4	3	10	10,50	10,29	12,25
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,9400	-0,36	-1,74	-0,93	5,6490	4	18	10	8,78	8,54	12,57
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,0060	-0,54	-1,36	-0,74	5,6600	6	15	8	12,05	11,72	16,62
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,8750	-0,69	-2,11	-0,39	5,7830	5	16	3	13,51	13,13	26,45
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,8250	-0,58	-1,76	-0,75	5,7010	5	16	7	15,36	14,94	26,76
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,2420	-0,54	-1,87	-0,56	5,9290	4	13	4	14,18	13,77	30,23
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,6560	-0,44	-1,84	-0,61	5,6840	4	18	6	17,83	17,34	36,64
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,0720	-0,47	-1,77	-0,69	5,8490	4	16	6	17,39	16,90	47,92
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,5930	-0,40	-1,81	-0,67	5,8270	4	18	7	17,60	17,10	98,17

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	399	-3	-7	15,24	-107	-57	2,68	4,84	8,66	13,05	13,57	12,04	9,80	13,02	10,45	6,50	3,20	2,20
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	228	0	-7	8,16	-1	-322	3,43				52,86		9,03		18,86		15,82	



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.