



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

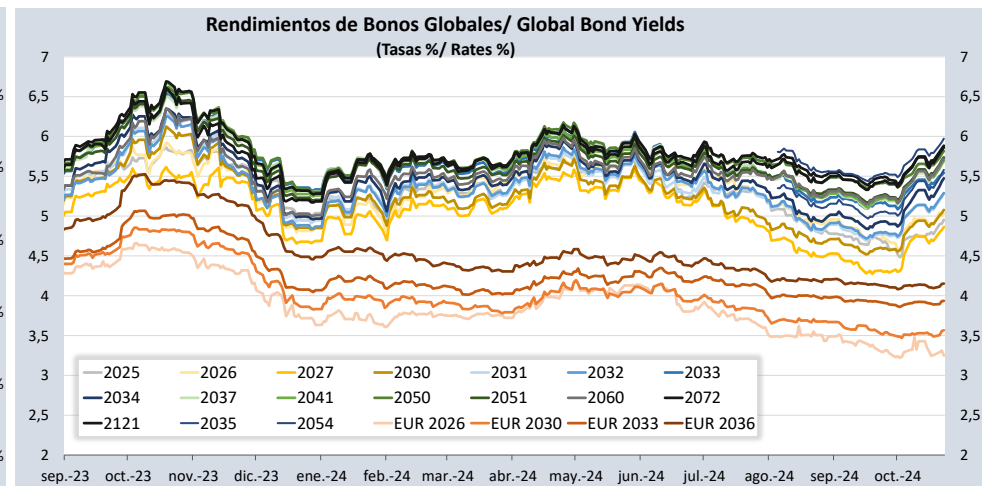
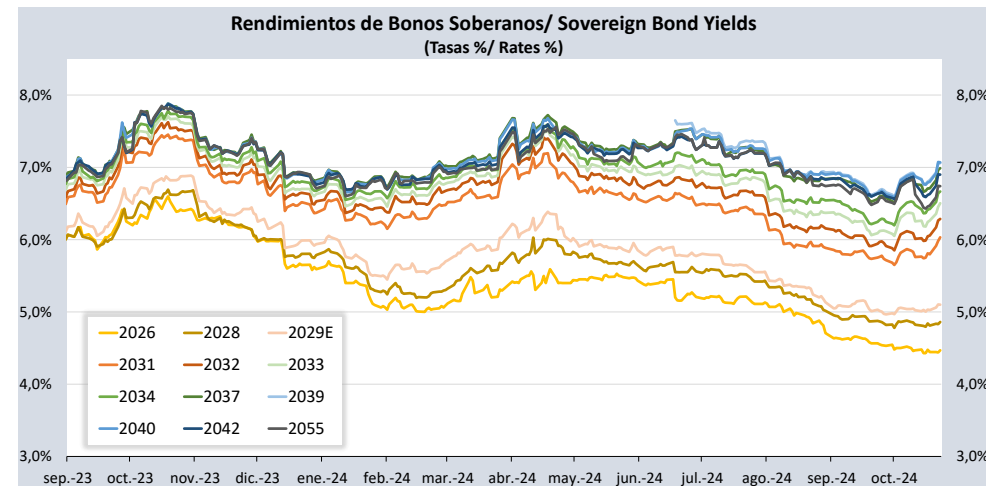
23/10/2024

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	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,60	3 937	8,200	-	-	-	106,3724	-	-	-	4,4683	-	15-Oct-24	10	1,72	1,64	1,81
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,24	7 225	6,350	104,78	105,20	105,05	105,0696	4,94	4,82	4,86	4,8600	1	23-Oct-24	1	3,46	3,31	3,81
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,16	13 176	5,940	102,95	103,15	103,14	103,1493	5,15	5,10	5,10	5,1000	1	23-Oct-24	1	3,89	3,70	4,31
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,36	19 573	6,950	105,13	105,36	105,01	105,0713	6,02	5,98	6,04	6,0312	15	23-Oct-24	94	5,58	5,26	6,81
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,20	21 442	6,150	99,23	99,77	99,29	99,1864	6,28	6,19	6,27	6,2869	9	23-Oct-24	122	6,32	5,95	7,81
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,43	17 855	7,300	105,24	105,99	105,27	105,3253	6,52	6,41	6,51	6,5032	12	23-Oct-24	212	6,72	6,31	8,81
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,06	16 960	5,400	91,07	91,70	91,05	91,0639	6,67	6,57	6,67	6,6659	44	23-Oct-24	274	7,64	7,17	9,81
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,35	20 481	6,900	99,54	100,45	99,29	99,3891	6,97	6,86	7,00	6,9883	17	23-Oct-24	54	8,70	8,13	12,81
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,35	15 436	7,600	104,82	105,79	104,87	105,0622	7,09	6,98	7,08	7,0588	13	23-Oct-24	307	9,21	8,61	14,81
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,05	12 442	5,350	83,93	84,76	83,93	83,9277	7,07	6,97	7,07	7,0700	1	23-Oct-24	12	10,37	9,69	15,81
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,34	5 033	6,850	-	-	-	99,6349	-	-	-	6,8994	-	14-Oct-24	2	10,39	9,72	17,31
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,31	3 462	6,714	-	-	-	99,8140	-	-	-	6,7394	-	14-Oct-24	6	13,32	12,48	30,31
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,57	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,8022	-	-	-	2,5020	-	18-Ago-23	20	5,01	4,88	5,31
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,69	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,3453	-	-	-	3,6737	-	10-Jun-22	10	7,80	7,53	10,28
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,61	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,3066	-	-	-	3,9743	-	10-Ago-23	50	12,17	11,70	15,31
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,75	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,4533	-	-	-	3,7118	-	11-Oct-24	52	15,14	14,60	21,81
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,64	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	94,2173	-	-	-	3,5664	-	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).

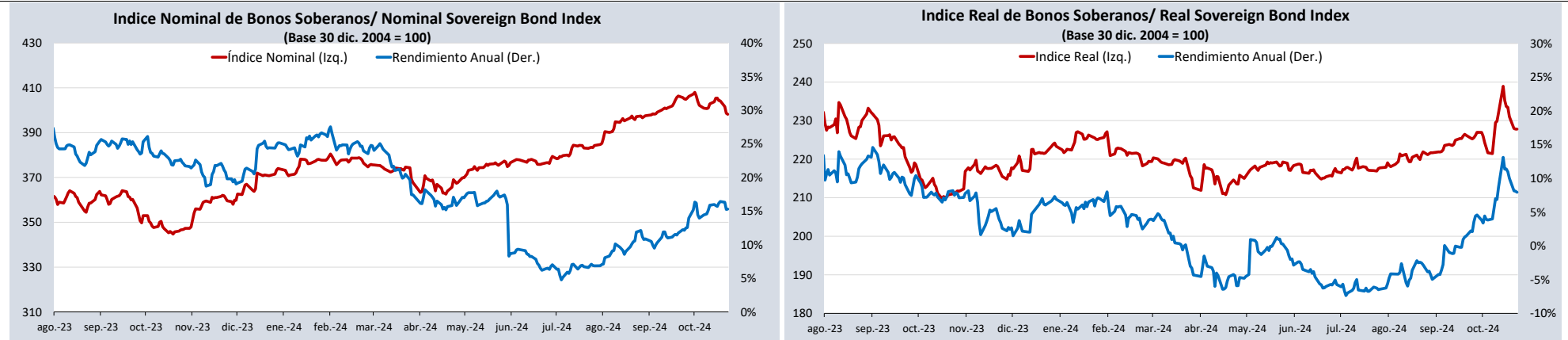
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,7130	-0,04	-0,18	-0,44	4,9540	5	18	60	0,73	0,71	0,75
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8460	-0,03	-0,14	-0,48	5,0300	3	16	41	1,23	1,20	1,27
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3810	0,08	0,07	-0,48	3,2500	-6	-5	40	1,25	1,23	1,29
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,0600	-0,10	-0,52	-0,46	4,8630	4	21	18	2,69	2,63	2,88
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,1320	-0,18	-0,95	-0,47	5,0780	4	21	10	5,18	5,05	5,74
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,8670	-0,04	-0,24	-0,63	3,5660	1	5	13	4,79	4,71	5,35
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,8500	-0,19	-1,13	-0,51	5,2810	4	24	10	5,69	5,55	6,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,6450	-0,20	-1,27	-0,52	5,2900	4	23	9	7,40	7,21	8,23
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,6270	-0,21	-1,49	-1,00	5,5430	3	18	12	6,53	6,36	9,21
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1390	-0,02	-0,15	-0,94	3,9360	0	3	15	7,91	7,76	8,50
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,2600	-0,24	-1,71	-0,55	5,4740	4	27	9	7,91	7,70	9,36
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,3930	-0,35	-2,00	-0,52	5,5810	5	26	7	7,93	7,71	10,44
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4220	-0,03	-0,37	-0,81	4,1530	0	5	10	10,50	10,29	12,24
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,6450	-0,30	-2,40	-0,93	5,6810	3	25	10	8,77	8,53	12,57
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,7020	-0,30	-2,15	-0,71	5,6950	4	24	8	12,04	11,71	16,62
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,4500	-0,42	-2,87	-0,50	5,8160	3	22	4	13,48	13,10	26,45
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,4460	-0,38	-2,69	-0,75	5,7370	4	25	7	15,33	14,90	26,76
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,6320	-0,61	-3,05	-0,57	5,9730	4	22	4	14,13	13,72	30,23
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,3030	-0,35	-2,69	-0,61	5,7200	4	27	6	17,77	17,27	36,63
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,6860	-0,39	-2,66	-0,70	5,8840	4	24	6	17,32	16,82	47,92
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,2690	-0,32	-2,57	-0,63	5,8610	3	26	7	17,50	17,00	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	398	0	-7	15,29	5	-40	2,68	4,84	8,67	13,04	13,57	12,02	9,79	13,01	10,46	6,51	3,20	2,21
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	-6	7,95	-15	-346	3,43				52,81		9,03		18,88		15,84	



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.