



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

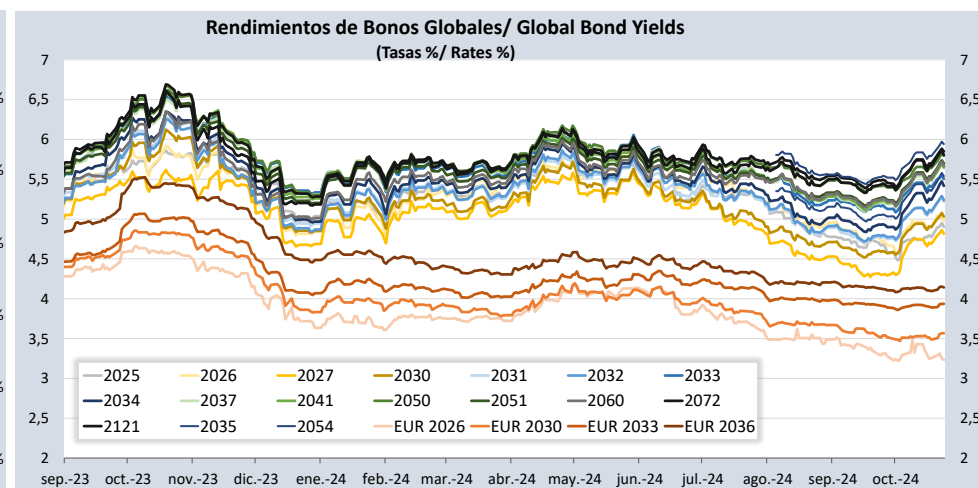
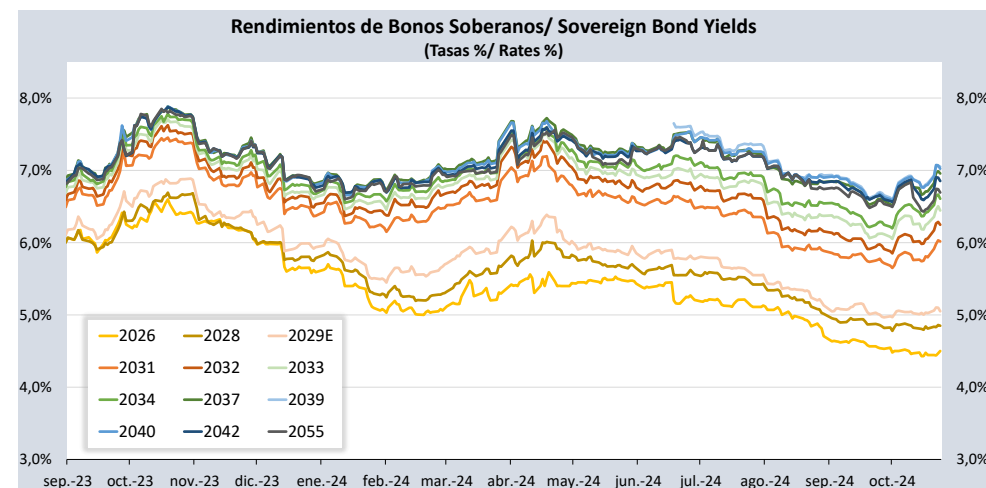
24/10/2024

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	1,63	3 937	8,200	-	-	106,29	106,3071	-	-	4,49	4,5000	6	24-Oct-24	362	1,71	1,64	1,80
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,26	7 225	6,350	104,84	105,09	105,09	105,1014	4,92	4,85	4,85	4,8500	1	24-Oct-24	5	3,46	3,31	3,80
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,18	13 176	5,940	102,99	103,29	103,33	103,3405	5,14	5,06	5,05	5,0500	1	24-Oct-24	2	3,88	3,70	4,30
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,38	19 573	6,950	105,07	105,21	105,18	105,1527	6,03	6,01	6,01	6,0164	37	24-Oct-24	84	5,58	5,26	6,80
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,22	21 442	6,150	99,35	99,65	99,41	99,4259	6,26	6,21	6,25	6,2469	30	24-Oct-24	139	6,32	5,95	7,80
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,45	17 855	7,300	105,41	105,85	105,68	105,7251	6,49	6,43	6,45	6,4438	15	24-Oct-24	87	6,72	6,31	8,80
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,07	16 960	5,400	91,35	91,48	91,44	91,4569	6,63	6,61	6,61	6,6068	61	24-Oct-24	320	7,65	7,17	9,80
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,37	20 481	6,900	99,54	100,20	99,70	99,6494	6,97	6,89	6,95	6,9566	35	24-Oct-24	168	8,70	8,14	12,80
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,37	15 436	7,600	105,05	105,79	105,14	105,1294	7,06	6,98	7,05	7,0515	38	24-Oct-24	418	9,21	8,61	14,80
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,06	12 442	5,350	84,10	84,39	84,43	84,3183	7,05	7,02	7,01	7,0229	8	24-Oct-24	156	10,39	9,71	15,80
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,36	5 033	6,850	-	-	-	100,0989	-	-	-	6,8523	-	14-Oct-24	2	10,41	9,74	17,30
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,33	3 462	6,714	-	-	-	100,4115	-	-	-	6,6923	-	14-Oct-24	6	13,36	12,53	30,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,57	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,9760	-	-	-	2,4671	-	18-Ago-23	20	5,00	4,88	5,30
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,71	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,8724	-	-	-	3,6205	-	10-Jun-22	10	7,81	7,53	10,27
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,62	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,5893	-	-	-	3,9479	-	10-Ago-23	50	12,17	11,71	15,30
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,76	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,1379	-	-	-	3,6661	-	11-Oct-24	52	15,16	14,63	21,80
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,65	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	95,0123	-	-	-	3,5207	-	18-Oct-24	5	18,93	18,28	29,30

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).

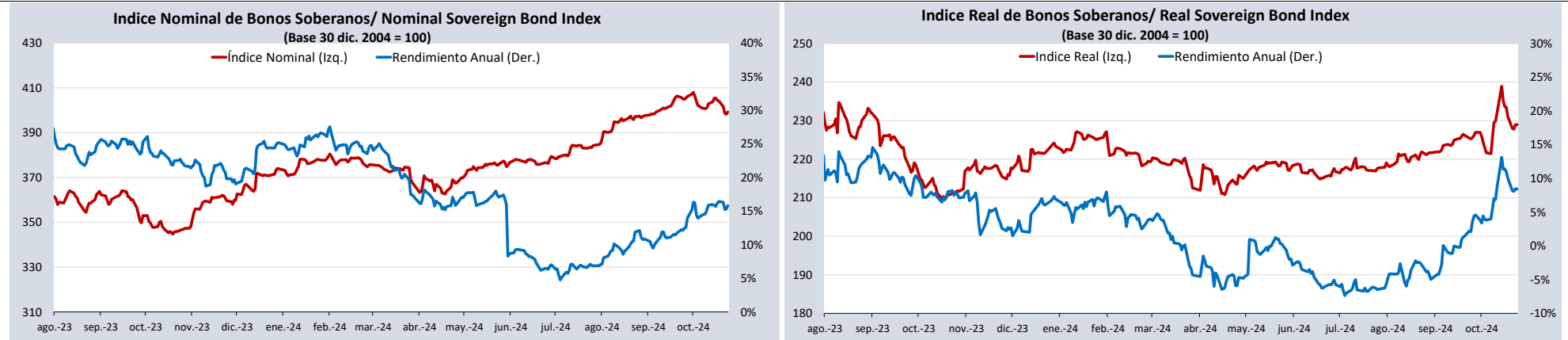
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,7440	0,03	-0,12	-0,45	4,9020	-5	11	61	0,72	0,71	0,75
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9080	0,06	-0,04	-0,48	4,9820	-5	7	41	1,23	1,20	1,27
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,4060	0,03	0,03	-0,48	3,2330	-2	-1	40	1,25	1,23	1,29
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1820	0,12	-0,28	-0,46	4,8170	-5	11	18	2,69	2,62	2,88
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,3520	0,22	-0,53	-0,51	5,0310	-5	12	11	5,18	5,05	5,74
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,8670	0,00	-0,26	-0,63	3,5660	0	5	13	4,79	4,71	5,34
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,1630	0,31	-0,58	-0,50	5,2170	-6	12	10	5,69	5,55	6,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,9440	0,30	-0,66	-0,53	5,2380	-5	12	9	7,40	7,21	8,22
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,9330	0,31	-0,72	-1,05	5,5040	-4	8	13	6,54	6,36	9,21
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1600	0,02	-0,18	-0,92	3,9360	0	4	15	7,91	7,76	8,50
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,6330	0,37	-1,01	-0,55	5,4170	-6	16	9	7,91	7,70	9,36
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7290	0,34	-1,32	-0,50	5,5380	-4	17	7	7,93	7,72	10,44
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5240	0,10	-0,29	-0,82	4,1420	-1	4	10	10,50	10,29	12,24
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,0670	0,42	-1,32	-0,93	5,6350	-5	14	10	8,77	8,53	12,57
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,0940	0,39	-1,39	-0,74	5,6510	-4	16	8	12,05	11,72	16,62
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,7200	0,27	-2,07	-0,50	5,7950	-2	16	4	13,50	13,12	26,45
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,8400	0,39	-1,76	-0,73	5,7000	-4	16	7	15,36	14,93	26,76
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,0740	0,44	-2,04	-0,55	5,9410	-3	15	4	14,16	13,75	30,22
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,8230	0,52	-1,50	-0,64	5,6680	-5	15	7	17,85	17,36	36,63
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,0630	0,38	-1,70	-0,65	5,8500	-3	15	6	17,39	16,89	47,91
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,8080	0,54	-1,30	-0,70	5,8050	-6	13	7	17,66	17,17	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	1	-5	15,81	52	-35	2,67	4,83	8,66	13,01	13,57	12,04	9,81	13,01	10,44	6,52	3,21	2,22
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	229	0	-5	8,41	-9	-258	3,41				52,76		9,02		18,92		15,90	



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.