



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

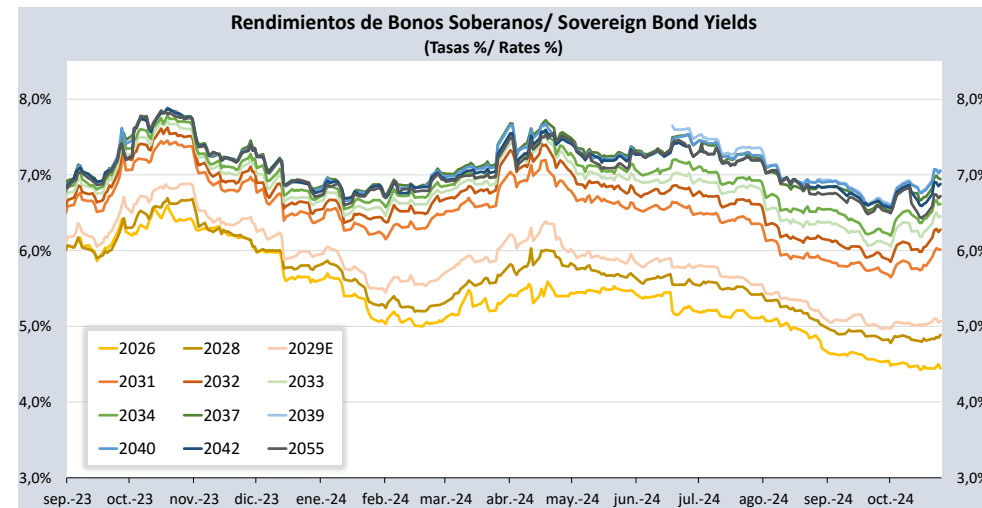
25/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

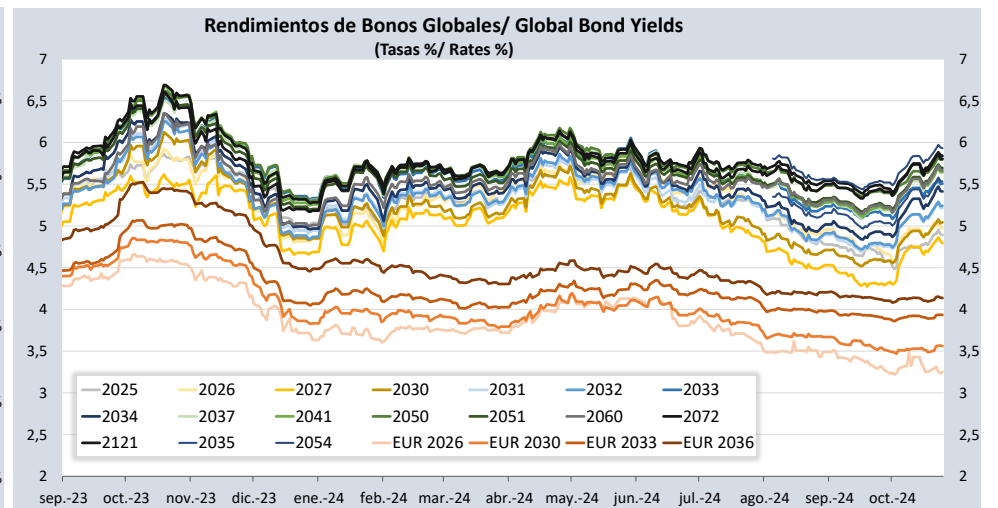
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price			Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones SI. / 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	1,65	3 937	8,200	-	-	-	106,3953	-	-	-	4,4450	-	25-Oct-24	8	1,71	1,64	1,80
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,28	7 225	6,350	104,70	105,01	104,91	104,9696	4,96	4,87	4,90	4,8867	3	25-Oct-24	6	3,45	3,31	3,80
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,19	13 176	5,940	102,96	103,25	103,25	103,2615	5,15	5,07	5,07	5,0700	1	25-Oct-24	2	3,88	3,69	4,30
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,40	19 573	6,950	104,90	105,18	105,07	105,1679	6,06	6,01	6,03	6,0134	23	25-Oct-24	44	5,58	5,26	6,80
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,24	21 442	6,150	99,11	99,29	99,29	99,2497	6,30	6,27	6,27	6,2764	20	25-Oct-24	135	6,32	5,95	7,80
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,47	17 855	7,300	105,34	106,15	105,54	105,6677	6,50	6,38	6,47	6,4521	7	25-Oct-24	60	6,72	6,31	8,80
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,09	16 960	5,400	91,25	91,31	91,31	91,4063	6,64	6,63	6,63	6,6147	56	25-Oct-24	216	7,64	7,17	9,80
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,39	20 481	6,900	99,54	100,03	99,54	99,7573	6,97	6,91	6,97	6,9435	12	25-Oct-24	166	8,70	8,14	12,80
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,39	15 436	7,600	104,82	105,51	104,96	105,0366	7,09	7,01	7,07	7,0615	31	25-Oct-24	255	9,21	8,60	14,80
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,08	12 442	5,350	83,86	84,85	84,19	84,0875	7,08	6,96	7,04	7,0510	29	25-Oct-24	116	10,38	9,69	15,80
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,38	5 033	6,850	-	-	-	99,8219	-	-	-	6,8804	-	14-Oct-24	2	10,39	9,73	17,30
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,35	3 462	6,714	-	-	-	100,0545	-	-	-	6,7204	-	14-Oct-24	6	13,33	12,50	30,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,58	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,9225	-	-	-	2,4776	-	18-Ago-23	20	5,00	4,88	5,30
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,73	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,8203	-	-	-	3,6250	-	10-Jun-22	10	7,80	7,53	10,27
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,63	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,3933	-	-	-	3,9664	-	10-Ago-23	50	12,17	11,70	15,30
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,77	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,7281	-	-	-	3,6934	-	11-Oct-24	52	15,14	14,60	21,80
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,66	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	94,5368	-	-	-	3,5480	-	18-Oct-24	5	18,89	18,25	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).

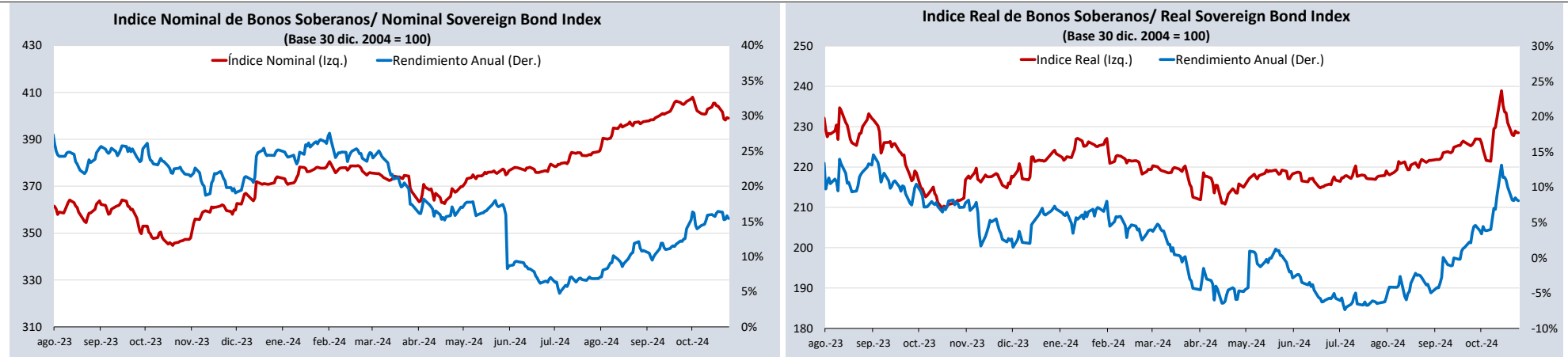


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,7330	-0,01	-0,13	-0,46	4,8910	-1	12	63	0,72	0,70	0,75
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9400	0,03	-0,04	-0,48	4,9720	-1	7	42	1,23	1,20	1,26
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3810	-0,03	0,01	-0,42	3,2550	2	0	35	1,24	1,22	1,28
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,2460	0,06	-0,27	-0,44	4,7940	-2	11	17	2,68	2,62	2,87
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,3060	-0,05	-0,64	-0,52	5,0440	1	15	11	5,18	5,05	5,73
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,8950	0,03	-0,36	-0,58	3,5600	-1	7	12	4,79	4,70	5,34
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,1890	0,03	-0,64	-0,50	5,2150	0	14	10	5,69	5,54	6,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,9350	-0,01	-0,77	-0,54	5,2430	0	14	10	7,39	7,20	8,22
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,9010	-0,03	-0,87	-1,02	5,5060	0	10	13	6,53	6,36	9,21
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1720	0,01	-0,24	-0,92	3,9340	0	4	15	7,91	7,76	8,50
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,6670	0,03	-1,09	-0,55	5,4130	0	17	9	7,91	7,70	9,36
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7710	0,04	-1,38	-0,50	5,5320	-1	18	7	7,93	7,71	10,44
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5780	0,05	-0,31	-0,81	4,1360	-1	4	10	10,50	10,28	12,24
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,0240	-0,04	-1,49	-0,94	5,6400	0	16	10	8,77	8,53	12,56
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,1390	0,05	-1,40	-0,72	5,6470	0	16	8	12,05	11,72	16,61
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,7240	0,00	-2,06	-0,57	5,7950	0	15	4	13,50	13,12	26,44
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,9110	0,07	-1,71	-0,72	5,6940	-1	16	7	15,36	14,94	26,76
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,1890	0,11	-1,99	-0,55	5,9330	-1	14	4	14,16	13,76	30,22
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,8340	0,01	-1,57	-0,60	5,6670	0	16	6	17,85	17,36	36,63
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,1680	0,11	-1,63	-0,68	5,8400	-1	15	6	17,41	16,91	47,91
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,7980	-0,01	-1,43	-0,70	5,8060	0	14	7	17,66	17,16	98,16

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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	399	0	-5	15,41	-39	-101	2,68	4,83	8,66	13,03	13,56	12,04	9,81	13,04	10,44	6,51	3,21
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	228	0	-3	8,08	-13	-194	3,42	52,84	9,01	18,88	15,85						



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.