



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

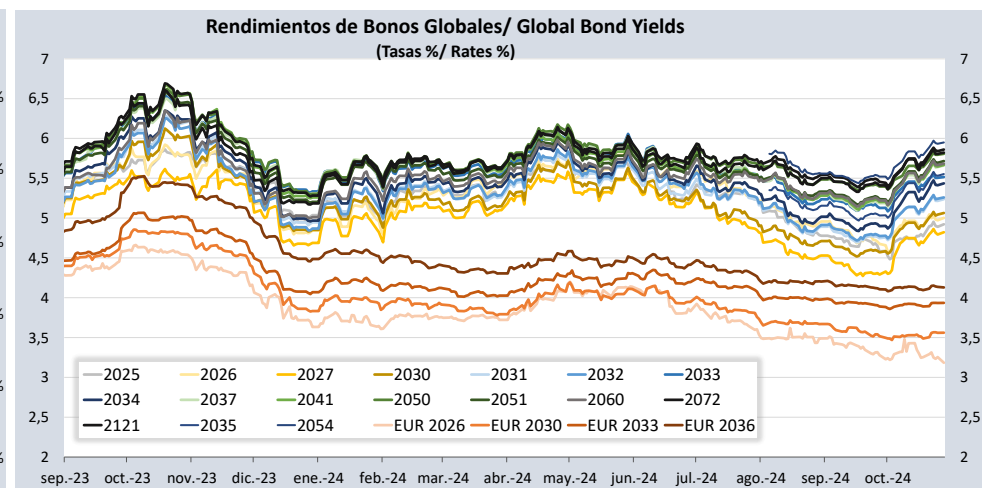
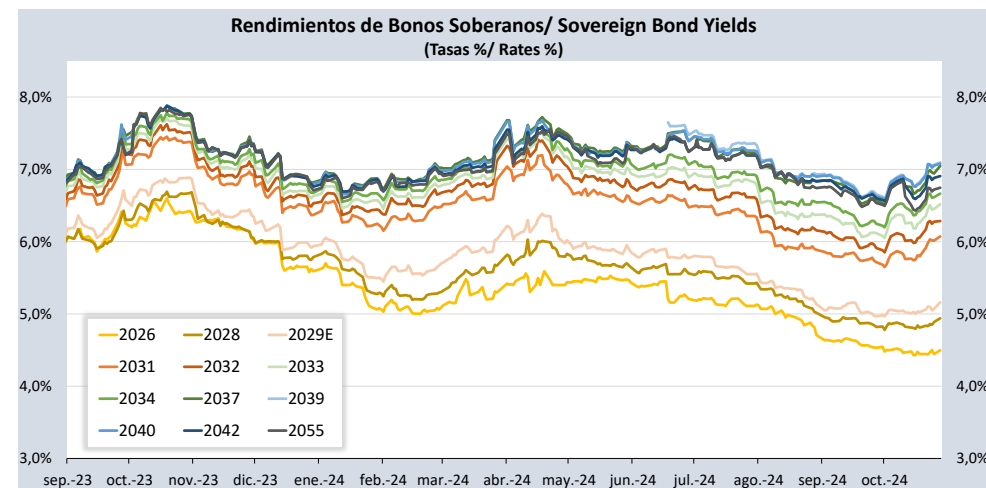
28/10/2024

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
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,72	3 937	8,200	-	-	-	106,2748	-	-	-	4,4977	-	25-Oct-24	8	1,70	1,63	1,80
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,33	7 225	6,350	104,38	104,91	104,73	104,7763	5,05	4,90	4,95	4,9394	10	28-Oct-24	19	3,45	3,31	3,80
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,24	13 176	5,940	102,71	102,98	102,87	102,9027	5,21	5,14	5,17	5,1620	7	28-Oct-24	14	3,87	3,68	4,30
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,45	19 573	6,950	104,56	105,23	104,68	104,8362	6,12	6,00	6,10	6,0719	17	28-Oct-24	37	5,57	5,25	6,80
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,29	21 442	6,150	98,75	99,02	98,99	99,1981	6,36	6,32	6,32	6,2852	28	28-Oct-24	50	6,31	5,94	7,80
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,53	17 855	7,300	104,80	105,61	105,20	105,2268	6,58	6,46	6,52	6,5170	11	28-Oct-24	160	6,70	6,29	8,80
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,13	16 960	5,400	90,95	91,38	90,85	91,0837	6,69	6,62	6,70	6,6643	40	28-Oct-24	109	7,63	7,15	9,80
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,44	20 481	6,900	98,73	99,25	98,81	98,9004	7,07	7,01	7,06	7,0483	13	28-Oct-24	92	8,67	8,10	12,80
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,46	15 436	7,600	103,77	104,96	104,50	104,7105	7,20	7,07	7,12	7,0968	15	28-Oct-24	56	9,19	8,58	14,80
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,12	12 442	5,350	83,20	84,19	83,53	83,8806	7,16	7,04	7,12	7,0767	7	28-Oct-24	14	10,36	9,67	15,80
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,43	5 033	6,850	-	-	-	99,5697	-	-	-	6,9061	-	14-Oct-24	2	10,38	9,71	17,30
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,40	3 462	6,714	-	-	-	99,7300	-	-	-	6,7461	-	14-Oct-24	6	13,30	12,46	30,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,60	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,4626	-	-	-	2,5694	-	18-Ago-23	20	4,99	4,87	5,30
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,79	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,0768	-	-	-	3,6972	-	10-Jun-22	10	7,79	7,51	10,27
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,66	228	3,14%+VAC	-	-	-	89,9175	-	-	-	4,0116	-	10-Ago-23	50	12,15	11,68	15,30
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,80	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,1242	-	-	-	3,7339	-	11-Oct-24	52	15,11	14,57	21,80
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,68	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	93,8381	-	-	-	3,5885	-	18-Oct-24	5	18,84	18,19	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).

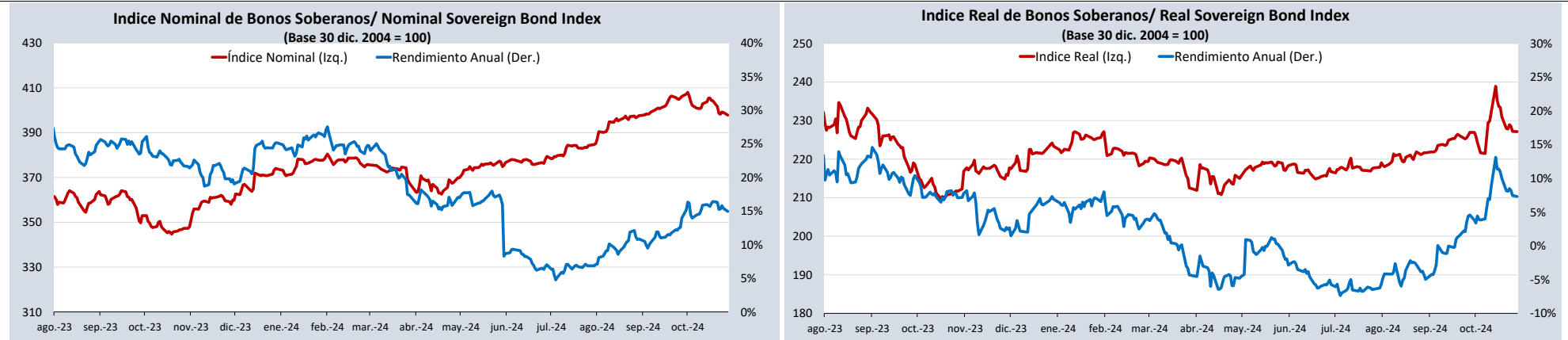
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,7040	-0,03	-0,06	-0,45	4,9220	3	2	62	0,71	0,70	0,74	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9110	-0,03	0,10	-0,49	5,0030	3	-4	42	1,22	1,19	1,26	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,4670	0,09	0,14	-0,42	3,1840	-7	-11	35	1,24	1,22	1,28	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1760	-0,07	-0,05	-0,43	4,8220	3	2	17	2,68	2,61	2,86	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,2180	-0,09	-0,22	-0,48	5,0640	2	5	11	5,17	5,04	5,73	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,8870	-0,01	-0,28	-0,60	3,5610	0	6	13	4,78	4,70	5,33	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,0840	-0,10	-0,12	-0,50	5,2380	2	3	10	5,68	5,53	6,33	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8490	-0,09	-0,22	-0,50	5,2590	2	5	9	7,38	7,19	8,21	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,8180	-0,08	-0,15	-1,02	5,5160	1	1	13	6,52	6,35	9,20	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1700	0,00	-0,22	-0,91	3,9360	0	4	15	7,90	7,75	8,49	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,5350	-0,13	-0,35	-0,56	5,4350	2	6	9	7,90	7,69	9,35	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,6080	-0,16	-0,56	-0,49	5,5530	2	7	6	7,92	7,70	10,43	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,6250	0,05	-0,11	-0,81	4,1300	-1	2	10	10,49	10,28	12,23	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8280	-0,20	-0,47	-0,90	5,6610	2	5	10	8,76	8,52	12,56	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,9550	-0,18	-0,59	-0,70	5,6680	2	7	8	12,03	11,70	16,61	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,5660	-0,16	-1,00	-0,52	5,8070	1	8	4	13,48	13,10	26,44	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,6740	-0,24	-0,73	-0,79	5,7160	2	7	7	15,33	14,91	26,75	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,9660	-0,22	-0,81	-0,59	5,9490	2	6	4	14,14	13,73	30,21	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,6620	-0,17	-0,43	-0,62	5,6840	2	4	6	17,81	17,32	36,62	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,9490	-0,22	-0,59	-0,69	5,8600	2	5	6	17,35	16,86	47,90	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,6410	-0,16	-0,35	-0,68	5,8230	2	4	7	17,60	17,10	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	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	398	-1	-4	14,95	-46	-135	2,68	4,84	8,66	13,03	13,60	12,03	9,81	12,97	10,44	6,51	3,21	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	227	0	-1	7,31	-15	-85	3,42				52,86		9,02		18,88		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.