



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

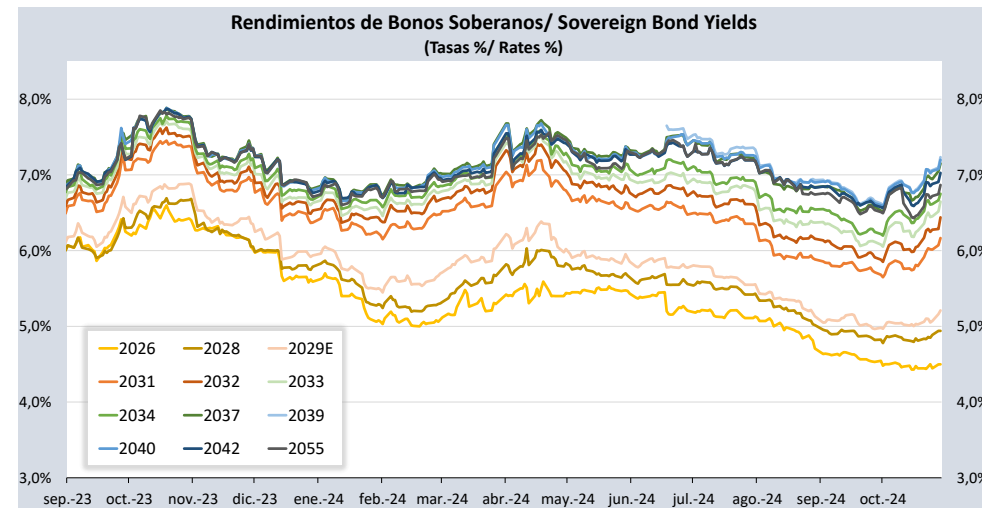
29/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

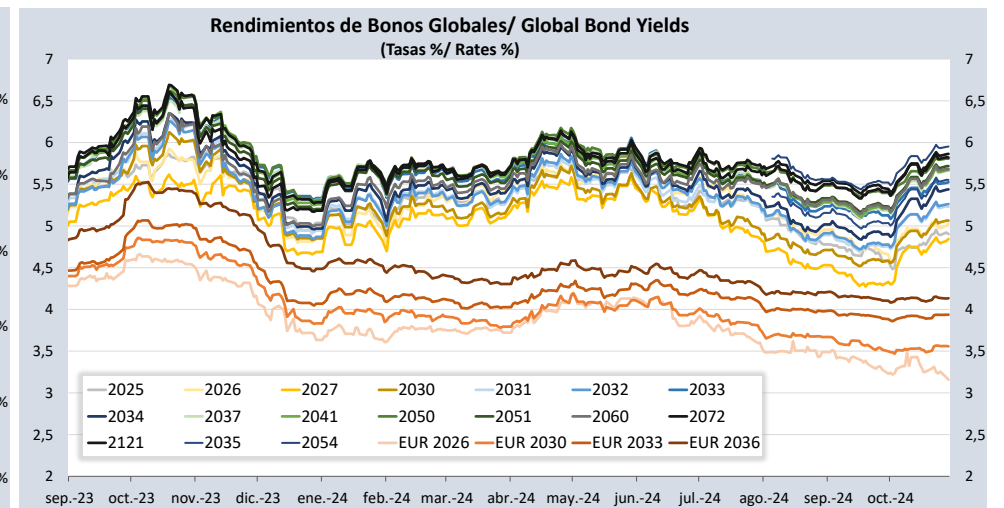
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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	Años / Years
					Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid			Venta / Ask									
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	1,74	3 937	8,200	-	-	-	106,2647	-	-	-	4,4983	-	25-Oct-24	8	1,70	1,63	1,79
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,35	7 225	6,350	104,48	104,67	104,75	104,7712	5,02	4,97	4,94	4,9400	1	29-Oct-24	2	3,44	3,31	3,79
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,26	13 176	5,940	102,48	102,75	102,71	102,7174	5,27	5,20	5,21	5,2100	1	29-Oct-24	2	3,87	3,68	4,29
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,47	19 573	6,950	104,12	104,56	104,28	104,3090	6,20	6,12	6,17	6,1665	8	29-Oct-24	18	5,56	5,24	6,79
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,30	21 442	6,150	98,20	98,41	98,28	98,2825	6,46	6,42	6,44	6,4397	34	29-Oct-24	313	6,30	5,92	7,79
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,55	17 855	7,300	104,53	104,75	104,66	104,3567	6,62	6,59	6,60	6,6471	23	29-Oct-24	102	6,69	6,27	8,79
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,14	16 960	5,400	90,21	90,47	90,40	90,5186	6,80	6,76	6,77	6,7506	12	29-Oct-24	55	7,62	7,14	9,79
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,46	20 481	6,900	98,08	98,48	98,16	98,0698	7,15	7,10	7,14	7,1511	10	29-Oct-24	91	8,65	8,07	12,79
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,48	15 436	7,600	103,31	103,73	103,50	103,4595	7,25	7,20	7,23	7,2340	37	29-Oct-24	314	9,15	8,53	14,79
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,13	12 442	5,350	82,73	83,13	82,89	82,8889	7,22	7,17	7,20	7,1985	11	29-Oct-24	120	10,32	9,63	15,79
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,45	5 033	6,850	-	-	-	98,3861	-	-	-	7,0279	-	14-Oct-24	2	10,33	9,65	17,29
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,42	3 462	6,714	-	-	-	98,2143	-	-	-	6,8679	-	14-Oct-24	6	13,18	12,33	30,29
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,61	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2170	-	-	-	2,6188	-	18-Ago-23	20	4,99	4,86	5,29
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,81	911	7,39% + VAC	-	-	-	130,3665	-	-	-	3,7680	-	10-Jun-22	10	7,78	7,49	10,26
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,67	228	3,14%+VAC	-	-	-	88,7617	-	-	-	4,1219	-	10-Ago-23	50	12,12	11,64	15,29
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,81	649	3,83% + VAC	-	-	-	99,6131	-	-	-	3,8367	-	11-Oct-24	52	15,05	14,49	21,79
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,69	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	92,0955	-	-	-	3,6912	-	18-Oct-24	5	18,72	18,06	29,29

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).

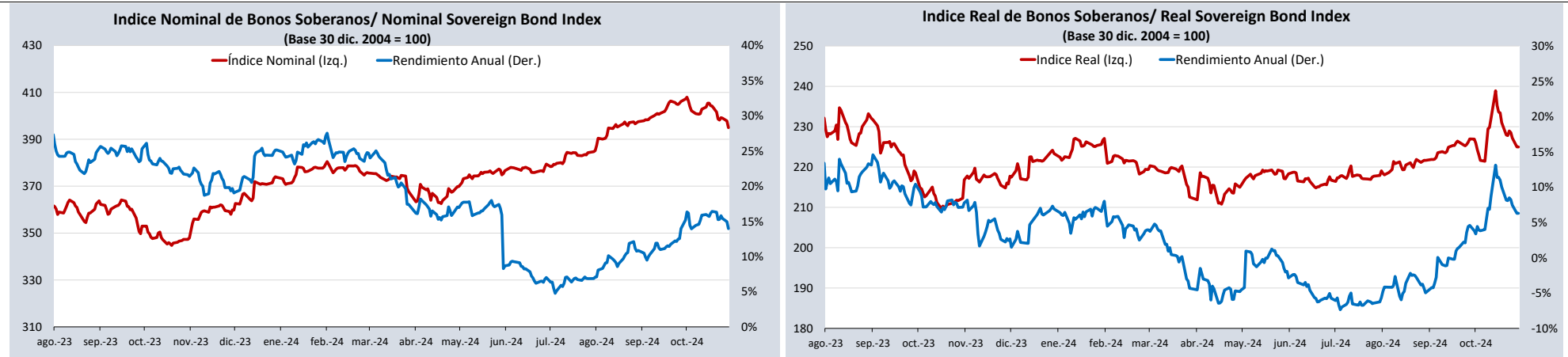


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,7120	0,01	-0,04	-0,44	4,9020	-2	0	62	0,71	0,69	0,74
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8840	-0,03	0,01	-0,49	5,0320	3	3	43	1,22	1,19	1,25
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,5000	0,03	0,20	-0,42	3,1580	-3	-16	35	1,23	1,21	1,27
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1220	-0,05	-0,03	-0,43	4,8430	2	2	17	2,67	2,61	2,86
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,2210	0,00	-0,09	-0,48	5,0650	0	3	11	5,17	5,04	5,72
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,9090	0,02	0,00	-0,60	3,5570	0	0	13	4,78	4,69	5,33
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,1320	0,05	0,09	-0,49	5,2290	-1	-1	10	5,68	5,53	6,33
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8370	-0,01	-0,01	-0,53	5,2620	0	1	9	7,38	7,19	8,21
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,7380	-0,08	-0,10	-1,02	5,5250	1	1	13	6,52	6,34	9,19
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1680	0,00	0,01	-0,90	3,9370	0	0	15	7,90	7,74	8,49
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,5160	-0,02	0,01	-0,57	5,4380	0	0	9	7,90	7,69	9,35
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,6180	0,01	-0,13	-0,48	5,5520	0	2	6	7,91	7,70	10,43
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5970	-0,03	0,15	-0,81	4,1340	0	-1	10	10,49	10,27	12,23
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8200	-0,01	-0,12	-0,90	5,6610	0	1	10	8,75	8,51	12,55
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,9290	-0,03	-0,08	-0,72	5,6710	0	1	8	12,03	11,70	16,60
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,5820	0,02	-0,29	-0,53	5,8060	0	2	4	13,48	13,10	26,43
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,6730	0,00	-0,15	-0,83	5,7170	0	2	8	15,33	14,90	26,74
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,9170	-0,05	-0,33	-0,58	5,9520	0	2	4	14,13	13,72	30,21
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,6850	0,02	0,03	-0,59	5,6820	0	0	6	17,81	17,32	36,62
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,9180	-0,03	-0,15	-0,70	5,8630	0	1	6	17,35	16,85	47,90
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,6660	0,02	0,07	-0,60	5,8200	0	-1	6	17,60	17,11	98,15

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	395	-3	-4	13,97	-99	-127	2,70	4,87	8,71	13,06	13,58	12,02	9,83	12,96	10,40	6,49	3,19	2,19
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	225	0	-3	6,30	-1	-180	3,45				53,10		8,99		18,78		15,68	



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.