



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

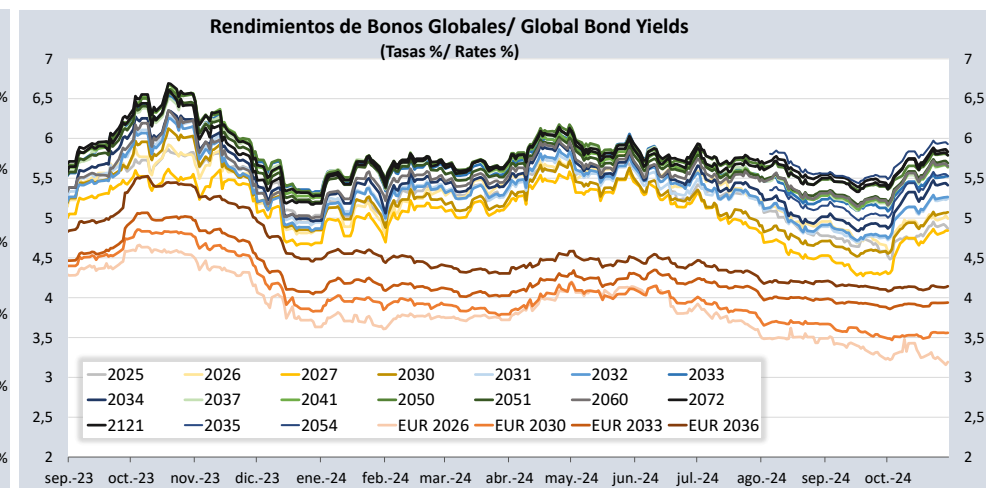
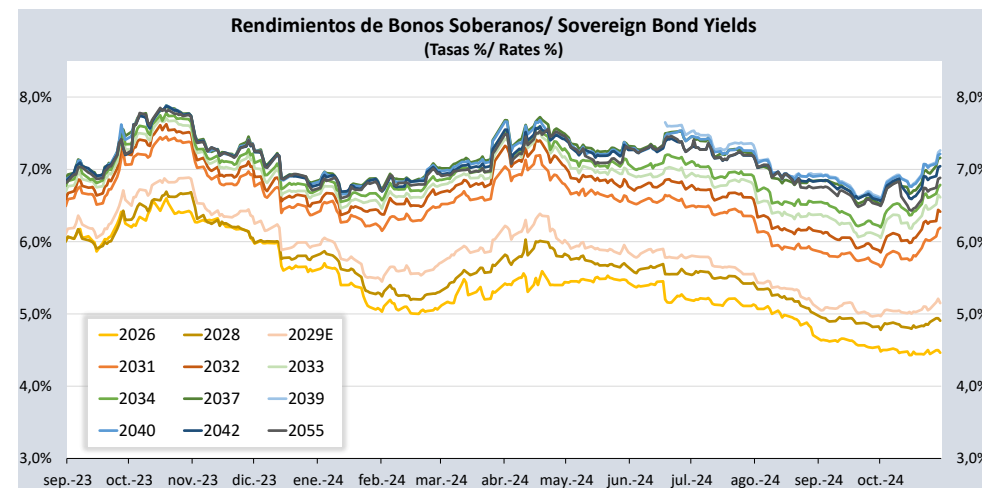
30/10/2024

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	1,76	3 937	8,200	-	-	-	106,3170	-	-	-	4,4633	-	25-Oct-24	8	1,70	1,62	1,79
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,36	7 225	6,350	104,54	104,75	104,72	104,8900	5,00	4,94	4,95	4,9050	4	30-Oct-24	8	3,44	3,31	3,79
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,28	13 176	5,940	102,63	102,97	102,63	102,9455	5,23	5,14	5,23	5,1500	2	30-Oct-24	3	3,87	3,68	4,29
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,49	19 573	6,950	104,12	104,36	104,06	104,1683	6,20	6,16	6,21	6,1917	14	30-Oct-24	36	5,55	5,23	6,79
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,32	21 442	6,150	97,99	98,52	98,28	98,4358	6,49	6,40	6,44	6,4138	12	30-Oct-24	74	6,30	5,92	7,79
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,57	17 855	7,300	104,27	104,80	104,40	104,5853	6,66	6,58	6,64	6,6126	4	30-Oct-24	170	6,69	6,27	8,79
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,16	16 960	5,400	90,15	90,28	90,21	90,2972	6,81	6,79	6,80	6,7848	13	30-Oct-24	142	7,61	7,13	9,79
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,48	20 481	6,900	97,76	98,36	97,92	97,9962	7,19	7,12	7,17	7,1603	23	30-Oct-24	427	8,65	8,07	12,79
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,50	15 436	7,600	103,04	103,41	103,13	103,2113	7,28	7,24	7,27	7,2615	17	30-Oct-24	218	9,14	8,52	14,79
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,15	12 442	5,350	82,49	82,65	82,56	82,7662	7,25	7,23	7,24	7,2139	13	30-Oct-24	340	10,31	9,62	15,79
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,47	5 033	6,850	-	-	-	98,2381	-	-	-	7,0433	-	14-Oct-24	2	10,32	9,64	17,29
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,44	3 462	6,714	-	-	-	98,0255	-	-	-	6,8833	-	14-Oct-24	6	13,16	12,32	30,29
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,62	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3408	-	-	-	2,6508	-	18-Ago-23	20	4,99	4,86	5,29
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,83	911	7,39% + VAC	-	130,50	130,01	130,0437	-	3,75	3,80	3,8000	2	30-Oct-24	2	7,77	7,48	10,26
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,67	228	3,14%+VAC	-	-	-	88,5461	-	-	-	4,1539	-	10-Ago-23	50	12,11	11,63	15,29
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,82	649	3,83% + VAC	-	-	-	99,3952	-	-	-	3,8687	-	11-Oct-24	52	15,04	14,48	21,79
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,70	1 133	3,26%+VAC	-	-	-	91,8451	-	-	-	3,7232	-	18-Oct-24	5	18,70	18,04	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).

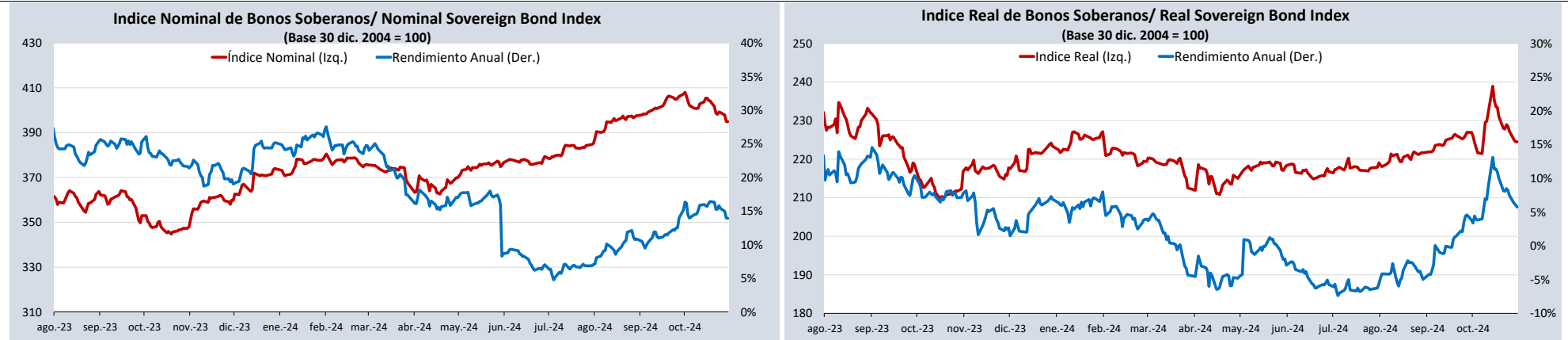
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,7360	0,02	0,02	-0,52	4,8680	-3	-9	72	0,71	0,69	0,73
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,9290	0,05	0,08	-0,52	4,9930	-4	-4	45	1,21	1,18	1,25
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,4580	-0,04	0,08	-0,47	3,1940	4	-6	39	1,23	1,21	1,27
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1270	0,00	0,07	-0,41	4,8420	0	-2	16	2,67	2,61	2,86
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,1820	-0,04	0,05	-0,56	5,0730	1	0	12	5,16	5,03	5,72
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,8920	-0,02	0,02	-0,63	3,5600	0	-1	13	4,77	4,69	5,33
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,0540	-0,08	0,20	-0,51	5,2450	2	-4	11	5,67	5,53	6,32
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8210	-0,02	0,18	-0,48	5,2650	0	-3	9	7,38	7,19	8,21
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,7450	0,01	0,12	-1,03	5,5240	0	-2	13	6,52	6,34	9,19
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,1550	-0,01	0,02	-0,84	3,9400	0	0	14	7,89	7,74	8,48
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,6820	0,17	0,42	-0,61	5,4120	-3	-6	9	7,89	7,69	9,34
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7780	0,16	0,39	-0,51	5,5310	-2	-5	7	7,91	7,70	10,43
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,5230	-0,07	0,10	-0,72	4,1440	1	-1	9	10,48	10,27	12,23
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8640	0,04	0,22	-0,94	5,6570	0	-2	10	8,75	8,51	12,55
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,2180	0,29	0,52	-0,70	5,6380	-3	-6	8	12,04	11,71	16,60
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,8100	0,23	0,36	-0,56	5,7890	-2	-3	4	13,49	13,11	26,43
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,9580	0,28	0,51	-0,75	5,6900	-3	-5	7	15,35	14,93	26,74
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,2390	0,32	0,61	-0,63	5,9290	-2	-4	5	14,15	13,75	30,21
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,9790	0,29	0,68	-0,70	5,6520	-3	-7	7	17,86	17,37	36,61
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,2560	0,34	0,57	-0,69	5,8320	-3	-5	6	17,41	16,92	47,90
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,9810	0,32	0,71	-0,68	5,7880	-3	-7	7	17,70	17,20	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	0	-3	13,93	-4	-137	2,71	4,88	8,73	13,05	13,60	12,05	9,80	12,95	10,37	6,48	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	-4	5,76	-31	-274	3,46				53,10		8,99		18,78		15,67	



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.