



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

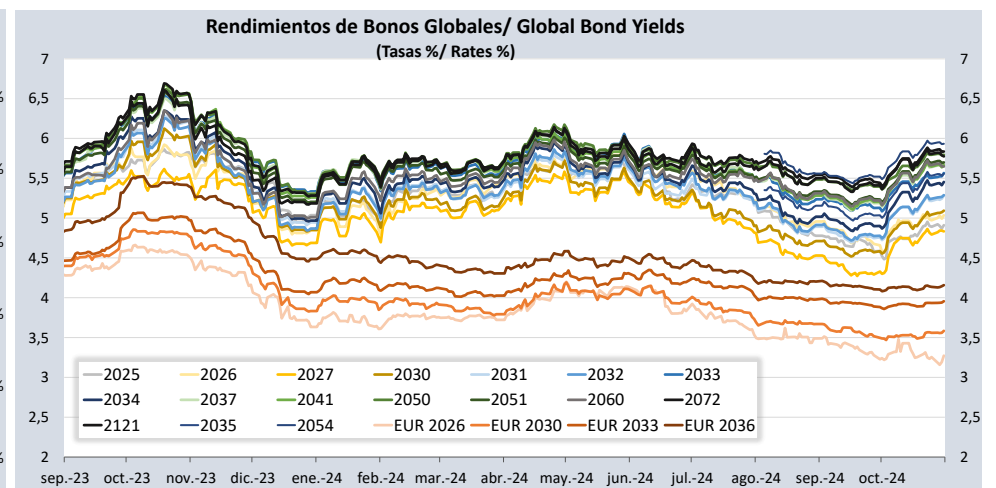
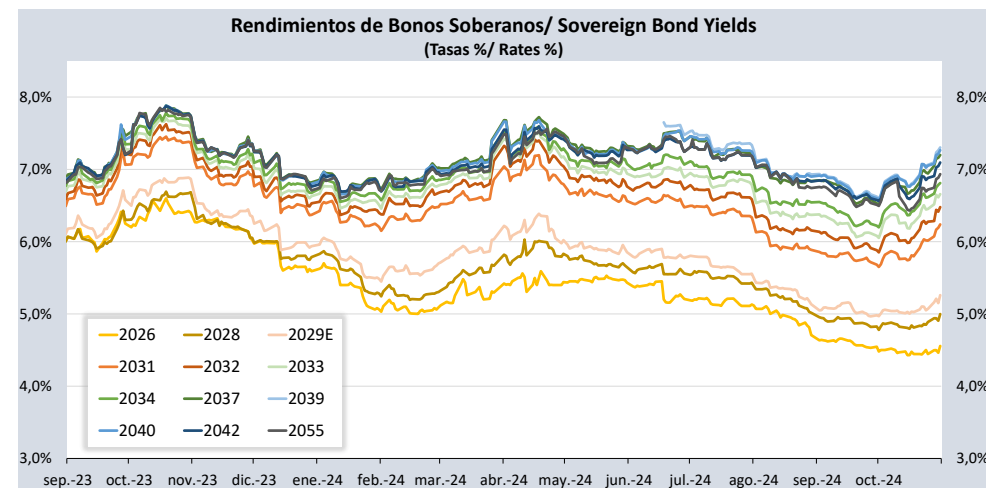
31/10/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price			Rendimiento / Yield				Nº 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	1,78	3 937	8,200	-	-	-	106,1459	-	-	-	4,5558	-	25-Oct-24	8	1,69	1,62	1,78
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,38	7 225	6,350	104,26	104,54	104,64	104,5654	5,08	5,00	4,97	4,9975	8	31-Oct-24	16	3,44	3,31	3,78
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,29	13 176	5,940	102,33	102,52	102,63	102,5249	5,31	5,26	5,23	5,2597	14	31-Oct-24	36	3,86	3,67	4,28
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	1,51	19 573	6,950	103,73	104,11	103,95	103,9106	6,27	6,20	6,23	6,2382	64	31-Oct-24	215	5,55	5,22	6,78
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,34	21 442	6,150	97,73	98,37	98,05	98,0578	6,54	6,43	6,48	6,4781	13	31-Oct-24	37	6,29	5,91	7,78
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	1,59	17 855	7,300	104,00	104,73	104,16	104,2905	6,70	6,59	6,68	6,6568	26	31-Oct-24	277	6,68	6,27	8,78
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,17	16 960	5,400	88,53	90,28	90,08	90,1377	7,07	6,79	6,82	6,8096	25	31-Oct-24	78	7,61	7,12	9,78
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	1,50	20 481	6,900	97,68	98,24	97,84	97,6859	7,20	7,13	7,18	7,1991	15	31-Oct-24	57	8,64	8,06	12,78
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,52	15 436	7,600	102,87	103,59	102,87	102,8456	7,30	7,22	7,30	7,3022	33	31-Oct-24	546	9,13	8,50	14,78
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,16	12 442	5,350	82,23	82,85	82,33	82,3562	7,28	7,21	7,27	7,2651	33	31-Oct-24	175	10,29	9,59	15,78
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	1,49	5 033	6,850	-	-	-	97,7480	-	-	-	7,0945	-	14-Oct-24	2	10,30	9,62	17,28
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	1,46	3 462	6,714	-	-	-	97,4018	-	-	-	6,9345	-	14-Oct-24	6	13,11	12,26	30,28
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,63	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,9351	-	-	-	2,6757	-	18-Ago-23	20	4,98	4,85	5,28
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,85	911	7,39% + VAC	-	-	-	129,8067	-	-	-	3,8234	-	30-Oct-24	2	7,76	7,48	10,25
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,68	228	3,14%+VAC	-	-	-	88,0875	-	-	-	4,1873	-	10-Ago-23	50	12,10	11,61	15,28
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,83	649	3,83% + VAC	-	-	-	98,6791	-	-	-	3,9013	-	11-Oct-24	52	15,00	14,44	21,78
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,71	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	91,0228	-	-	-	3,7558	-	18-Oct-24	5	18,65	17,97	29,28

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).

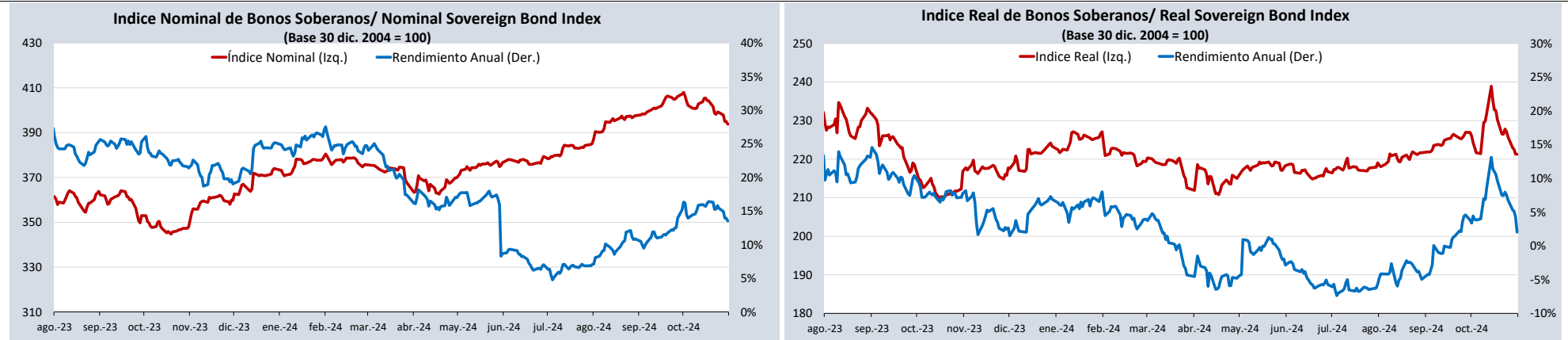
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6990	-0,04	-0,05	-0,50	4,9110	4	1	70	0,70	0,69	0,73
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,8870	-0,04	-0,02	-0,48	5,0350	4	5	42	1,21	1,18	1,25
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,3670	-0,09	-0,04	-0,61	3,2730	8	4	51	1,23	1,21	1,27
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1500	0,02	-0,03	-0,40	4,8330	-1	2	15	2,67	2,60	2,86
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,0950	-0,09	-0,26	-0,53	5,0930	2	6	12	5,16	5,03	5,72
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,7760	-0,12	-0,09	-0,75	3,5840	2	2	16	4,77	4,69	5,33
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,8740	-0,18	-0,29	-0,77	5,2830	4	7	16	5,67	5,52	6,32
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,6980	-0,12	-0,25	-0,51	5,2880	2	5	9	7,37	7,18	8,20
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,4130	-0,33	-0,52	-0,93	5,5650	4	6	12	6,51	6,33	9,19
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,0710	-0,08	-0,09	-0,92	3,9560	2	2	15	7,89	7,74	8,48
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,4180	-0,26	-0,21	-0,59	5,4540	4	4	9	7,89	7,68	9,34
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,5810	-0,20	-0,15	-0,52	5,5570	3	2	7	7,91	7,69	10,42
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4200	-0,10	-0,10	-0,80	4,1580	1	2	10	10,48	10,26	12,22
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,6580	-0,21	-0,41	-0,91	5,6790	2	4	10	8,75	8,50	12,55
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,0140	-0,20	-0,08	-0,69	5,6620	2	1	8	12,03	11,70	16,60
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,7250	-0,09	0,00	-0,82	5,7950	1	0	6	13,48	13,10	26,43
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,8580	-0,10	0,02	-0,72	5,6990	1	0	7	15,34	14,91	26,74
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,1860	-0,05	0,11	-0,62	5,9330	0	-1	4	14,15	13,74	30,20
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,0220	0,04	0,20	-0,80	5,6480	0	-2	8	17,87	17,38	36,61
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,2100	-0,05	0,15	-0,68	5,8360	0	-1	6	17,40	16,90	47,89
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,1000	0,12	0,29	-0,68	5,7750	-1	-3	7	17,74	17,24	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	394	-1	-5	13,52	-40	-228	2,70	4,87	8,70	13,12	13,55	12,02	9,84	12,91	10,34	6,61	3,18	2,18
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	221	0	-6	2,04	-220	-554	2,39				36,77		6,21		19,80		34,84	



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.