



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

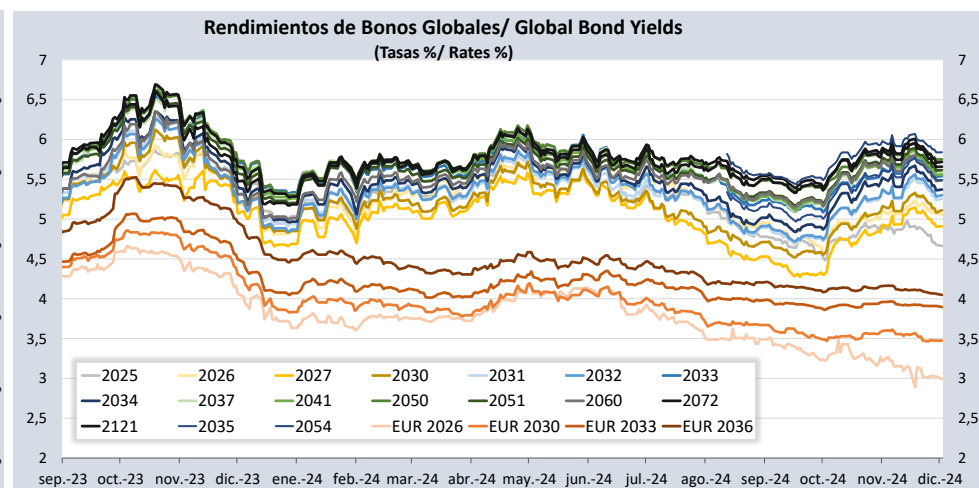
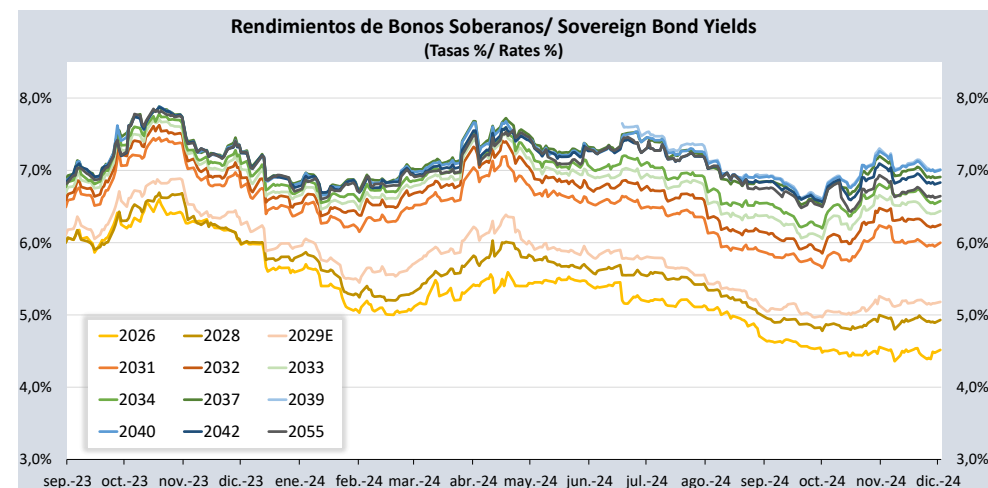
02/12/2024

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	2,50	3 937	8,200	-	-	-	105,9292	-	-	-	4,5149	-	28-Nov-24	12	1,60	1,54	1,70
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,93	7 225	6,350	104,59	104,76	104,69	104,7028	4,96	4,91	4,93	4,9300	2	2-Dic-24	4	3,35	3,31	3,70
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,81	13 176	5,940	102,65	102,85	102,81	102,7814	5,22	5,16	5,17	5,1799	33	2-Dic-24	103	3,77	3,59	4,20
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,12	19 573	6,950	105,01	105,40	105,34	105,1927	6,03	5,96	5,97	5,9983	16	2-Dic-24	38	5,47	5,16	6,70
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,87	21 588	6,150	99,48	99,74	99,54	99,4228	6,24	6,20	6,23	6,2493	33	2-Dic-24	109	6,21	5,85	7,70
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,22	17 855	7,300	105,68	105,97	105,84	105,7285	6,44	6,40	6,42	6,4364	9	2-Dic-24	66	6,61	6,21	8,70
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,64	16 960	5,400	91,62	91,84	91,78	91,7374	6,59	6,56	6,57	6,5751	21	2-Dic-24	100	7,54	7,08	9,70
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,10	20 481	6,900	100,12	100,45	100,25	100,0529	6,90	6,86	6,89	6,9083	22	2-Dic-24	217	8,60	8,05	12,70
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,18	15 811	7,600	105,41	106,06	105,78	105,4818	7,02	6,95	6,98	7,0124	35	2-Dic-24	187	9,12	8,52	14,70
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,63	12 442	5,350	84,38	85,08	84,66	84,5311	7,02	6,94	6,99	7,0048	18	2-Dic-24	257	10,28	9,61	15,70
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,08	5 033	6,850	-	-	-	100,3142	-	-	-	6,8310	-	14-Oct-24	2	10,31	9,65	17,20
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,04	3 462	6,714	-	-	-	101,0447	-	-	-	6,6432	-	6-Nov-24	1	13,30	12,48	30,20
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,88	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2589	-	-	-	2,6065	-	18-Ago-23	20	4,89	4,77	5,20
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,49	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,4099	-	-	-	3,6401	-	30-Oct-24	2	7,70	7,42	10,17
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,96	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,5708	-	-	-	3,9544	-	10-Ago-23	50	12,06	11,60	15,20
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,17	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,4363	-	-	-	3,6460	-	11-Oct-24	52	15,06	14,53	21,70
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,99	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	96,1425	-	-	-	3,4572	-	18-Oct-24	5	18,89	18,26	29,20

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).

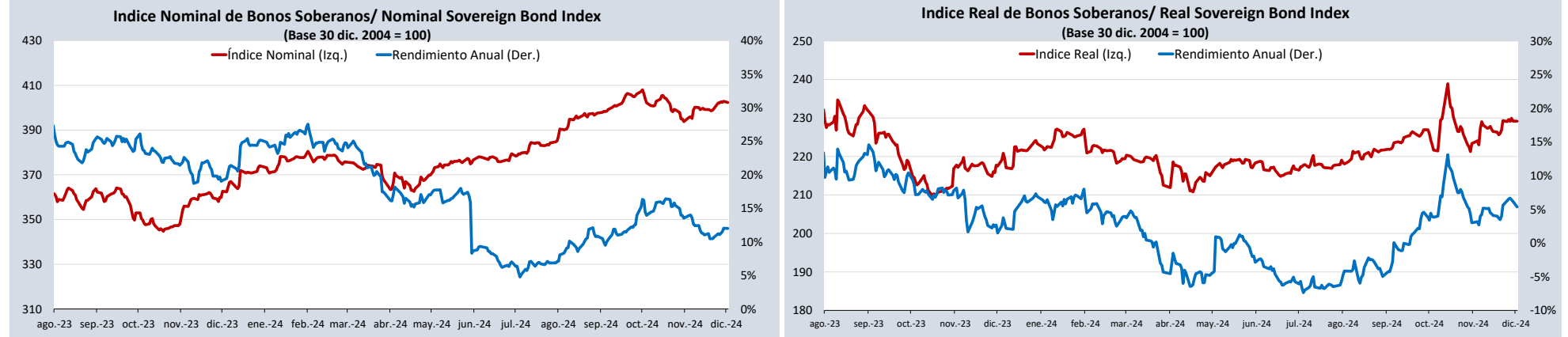
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6500	0,00	0,03	-0,38	4,6620	-2	-13	60	0,62	0,60	0,64	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,0830	0,02	0,10	-0,44	5,0570	-1	-4	42	1,12	1,10	1,16	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7250	0,04	0,03	-0,64	2,9910	-3	-2	57	1,14	1,12	1,18	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,0140	-0,01	0,24	-0,50	4,9090	1	-9	20	2,58	2,52	2,77	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,1710	-0,12	0,42	-0,54	5,1100	3	-9	12	5,07	4,95	5,63	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,2910	0,00	-0,05	-0,78	3,4740	0	1	16	4,69	4,61	5,24	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,1650	-0,08	0,53	-0,51	5,2560	2	-10	11	5,58	5,44	6,23	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8240	-0,09	0,61	-0,50	5,3010	2	-10	9	7,38	7,19	8,11	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,4370	-0,10	0,77	-1,05	5,5410	1	-10	13	6,66	6,48	9,10	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,5980	0,08	0,12	-0,89	3,8960	-1	-1	14	7,81	7,66	8,39	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,0770	-0,07	0,71	-0,58	5,3720	1	-11	9	7,81	7,60	9,25	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,1340	0,04	0,76	-0,52	5,4860	0	-10	7	7,83	7,62	10,33	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,4240	0,12	0,25	-0,70	4,0480	-1	-3	9	10,53	10,32	12,13	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,4550	-0,09	0,81	-1,00	5,5880	1	-9	11	8,68	8,44	12,46	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,0030	-0,08	0,97	-0,69	5,5600	1	-11	8	11,97	11,65	16,51	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,3220	-0,05	1,04	-0,37	5,7500	0	-8	3	13,82	13,43	26,34	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,8050	-0,06	0,99	-0,72	5,6150	1	-9	7	15,33	14,91	26,65	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,4940	-0,03	1,03	-0,64	5,8390	0	-7	5	14,16	13,76	30,11	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,6740	-0,13	1,06	-0,76	5,4890	1	-10	7	18,48	17,99	36,52	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,5690	-0,10	1,06	-0,75	5,7170	1	-9	7	17,57	17,08	47,81	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,2690	-0,05	1,00	-0,68	5,6590	0	-10	7	18,01	17,51	98,06	

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	402	-1	0	12,00	-4	78	2,65	4,78	8,54	13,02	13,56	11,95	9,82	12,97	10,65	6,65	3,20	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	229	0	0	5,37	-83	-92	2,32				36,06		6,17		19,88		35,58	



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.