



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

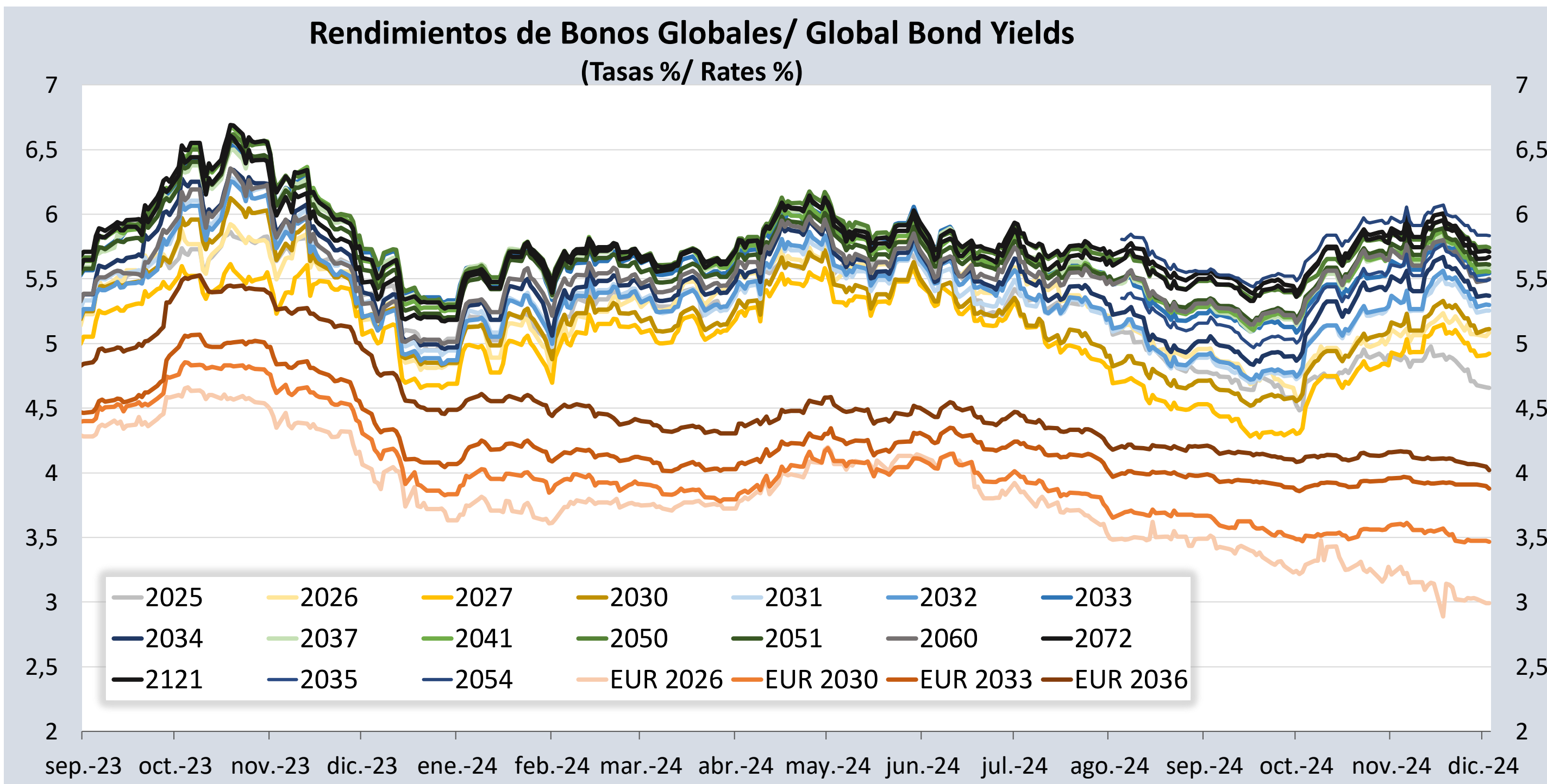
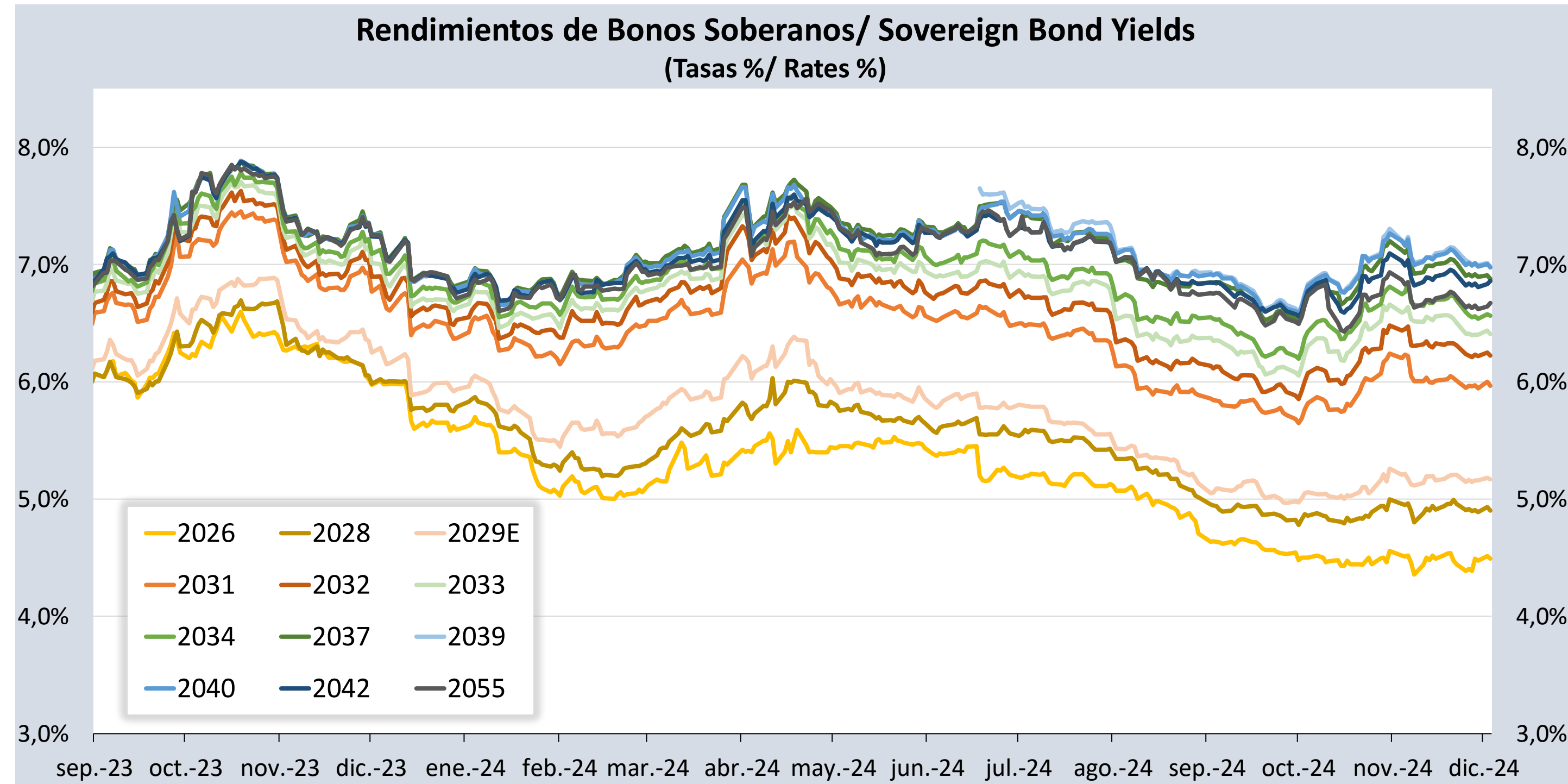
03/12/2024

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
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,52	3 937	8,200	-	-	-	105,9616	-	-	-	4,4900	-	3-Dic-24	0	1,60	1,53	1,69
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,95	7 225	6,350	104,69	104,72	104,72	104,8019	4,93	4,92	4,92	4,9000	2	3-Dic-24	3	3,35	3,31	3,69
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,82	13 176	5,940	102,72	103,00	102,85	102,8189	5,20	5,12	5,16	5,1695	14	3-Dic-24	57	3,77	3,59	4,19
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,13	19 573	6,950	105,07	105,57	105,34	105,3630	6,02	5,93	5,97	5,9673	14	3-Dic-24	28	5,47	5,16	6,69
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,89	21 588	6,150	99,45	100,13	99,60	99,5827	6,25	6,13	6,22	6,2224	19	3-Dic-24	211	6,21	5,85	7,69
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,24	17 855	7,300	105,63	106,15	105,97	105,9409	6,45	6,37	6,40	6,4046	14	3-Dic-24	150	6,61	6,21	8,69
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,66	16 960	5,400	91,74	92,00	91,84	91,8186	6,58	6,54	6,56	6,5631	16	3-Dic-24	126	7,54	7,08	9,69
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,12	20 481	6,900	99,96	100,33	100,29	100,3034	6,92	6,88	6,88	6,8779	18	3-Dic-24	144	8,61	8,05	12,69
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,20	15 811	7,600	105,46	105,87	105,87	105,8332	7,02	6,97	6,97	6,9745	11	3-Dic-24	65	9,12	8,53	14,69
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,64	12 442	5,350	84,45	85,41	84,83	84,7659	7,02	6,90	6,97	6,9767	5	3-Dic-24	15	10,29	9,62	15,69
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,10	5 033	6,850	-	-	100,18	100,0285	-	-	6,85	6,8600	2	3-Dic-24	20	10,29	9,63	17,19
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,06	3 462	6,714	-	-	-	100,6731	-	-	-	6,6722	-	6-Nov-24	1	13,27	12,44	30,19
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,89	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3763	-	-	-	2,5823	-	18-Ago-23	20	4,89	4,77	5,19
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,51	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,6080	-	-	-	3,6195	-	30-Oct-24	2	7,69	7,43	10,16
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,96	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,9789	-	-	-	3,9162	-	10-Ago-23	50	12,07	11,61	15,19
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,18	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,1041	-	-	-	3,6681	-	11-Oct-24	52	15,05	14,52	21,69
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,00	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	95,7520	-	-	-	3,4793	-	18-Oct-24	5	18,86	18,23	29,19

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).

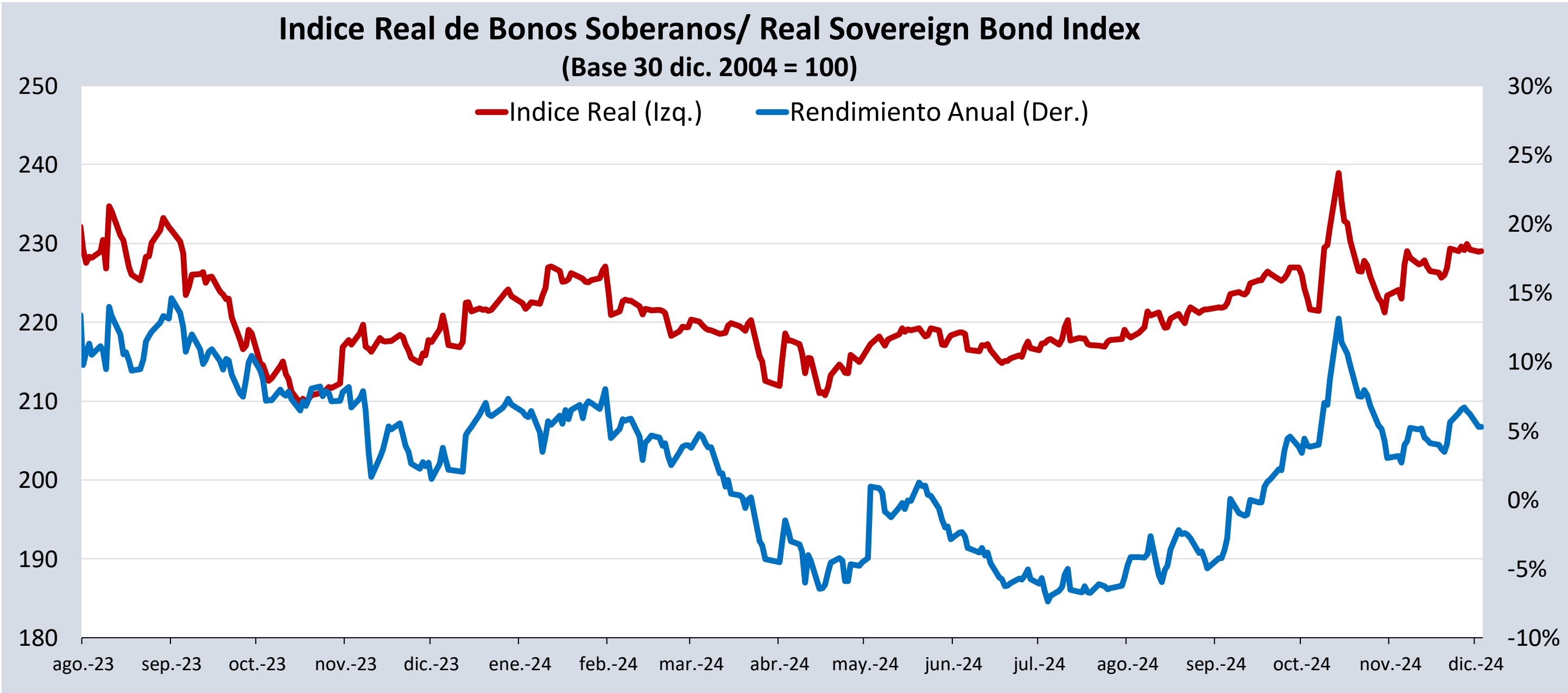
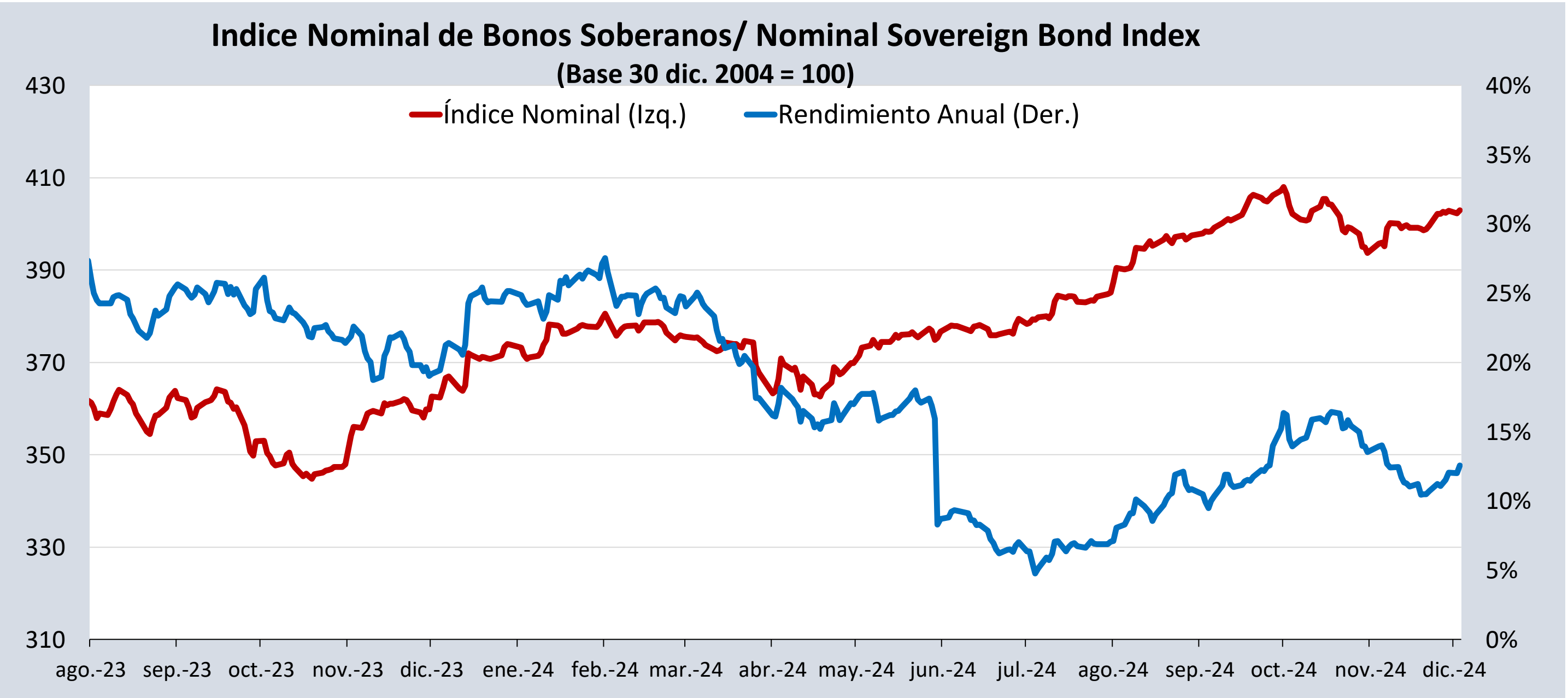
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6460	0,00	0,04	-0,36	4,6570	0	-14	58	0,62	0,60	0,64
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,0590	-0,02	0,11	-0,47	5,0860	3	-6	44	1,12	1,09	1,16
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7250	0,00	0,05	-0,64	2,9910	0	-4	57	1,14	1,12	1,18
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	97,9810	-0,03	0,22	-0,50	4,9230	1	-8	20	2,58	2,52	2,76
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,1660	-0,01	0,41	-0,49	5,1120	0	-8	11	5,07	4,94	5,63
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,3220	0,03	0,07	-0,81	3,4670	-1	-2	17	4,68	4,60	5,23
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,1780	0,01	0,53	-0,47	5,2540	0	-10	10	5,58	5,44	6,23
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,8480	0,02	0,62	-0,45	5,2980	0	-10	8	7,37	7,18	8,11
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,4220	-0,02	0,76	-1,02	5,5420	0	-10	13	6,65	6,48	9,10
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,7120	0,11	0,23	-0,81	3,8780	-2	-3	13	7,80	7,66	8,39
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,0950	0,02	0,76	-0,58	5,3690	0	-12	9	7,81	7,60	9,25
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,0750	-0,06	0,81	-0,53	5,4940	1	-11	7	7,83	7,62	10,33
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,6470	0,22	0,41	-0,68	4,0210	-3	-5	8	10,53	10,32	12,13
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,4470	-0,01	0,78	-1,01	5,5890	0	-9	11	8,67	8,44	12,46
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,0530	0,05	1,00	-0,76	5,5540	-1	-11	9	11,97	11,65	16,51
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,4090	0,09	1,04	-0,62	5,7430	-1	-8	5	13,82	13,43	26,34
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,8570	0,05	1,06	-0,75	5,6100	0	-10	7	15,33	14,91	26,65
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,5480	0,05	1,10	-0,68	5,8350	0	-8	5	14,16	13,76	30,11
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,5580	-0,12	0,94	-0,75	5,5000	1	-9	7	18,46	17,97	36,52
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,6600	0,09	1,16	-0,77	5,7090	-1	-10	7	17,58	17,10	47,80
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,1480	-0,12	0,95	-0,66	5,6710	1	-9	7	17,97	17,47	98,06

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index																		
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	403	1	1	12,56	56	149	2,64	4,77	8,53	13,02	13,56	11,96	9,81	12,98	10,67	6,65	3,18	2,20
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	-1	5,28	0	-126	2,32				36,16		6,20		19,84		35,47	



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.