



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

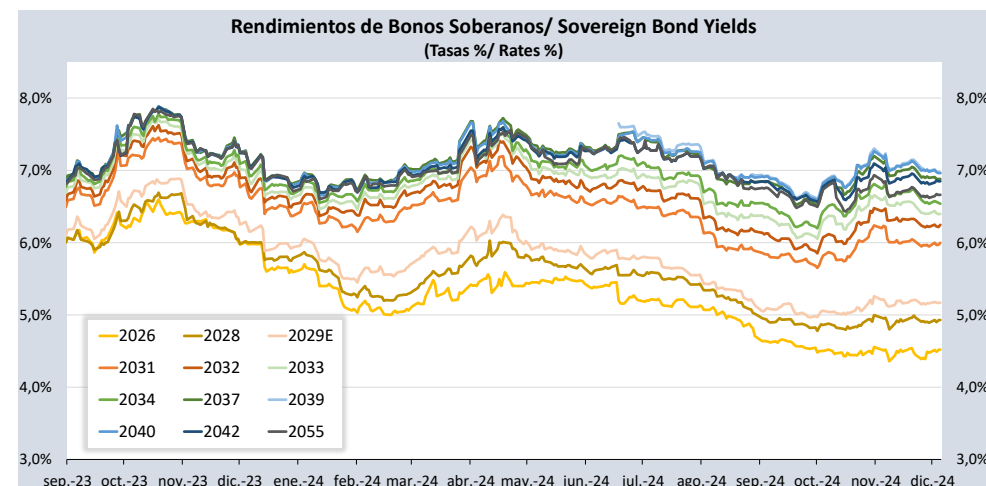
05/12/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

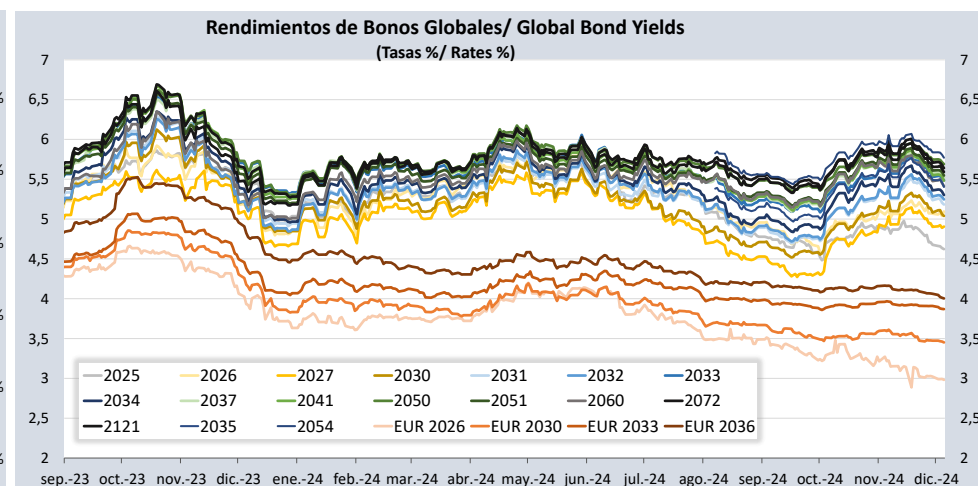
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	2,56	3 937	8,200	-	-	-	105,8938	-	-	-	4,5200	-	3-Dic-24	0	1,60	1,53	1,69
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,98	7 225	6,350	104,51	104,78	104,68	104,6939	4,98	4,90	4,93	4,9300	1	5-Dic-24	3	3,34	3,31	3,69
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,86	13 176	5,940	-	-	-	102,8141	-	-	-	5,1700	-	4-Dic-24	2	3,77	3,58	4,19
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,17	19 573	6,950	105,11	105,36	105,17	105,1981	6,01	5,97	6,00	5,9965	10	5-Dic-24	19	5,46	5,15	6,69
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,92	21 588	6,150	99,36	99,78	99,42	99,4464	6,26	6,19	6,25	6,2455	37	5-Dic-24	102	6,21	5,84	7,69
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,28	17 855	7,300	105,76	105,96	105,96	105,9829	6,43	6,40	6,40	6,3980	5	5-Dic-24	10	6,61	6,21	8,69
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,69	16 960	5,400	91,72	92,19	91,99	91,9752	6,58	6,51	6,54	6,5400	5	5-Dic-24	19	7,54	7,08	9,69
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,16	20 481	6,900	100,29	100,54	100,29	100,2864	6,88	6,85	6,88	6,8800	1	5-Dic-24	20	8,60	8,05	12,69
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,24	15 811	7,600	105,73	106,20	105,97	105,9677	6,99	6,94	6,96	6,9600	3	5-Dic-24	13	9,12	8,53	14,69
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,67	12 442	5,350	84,59	84,92	84,92	84,8582	7,00	6,96	6,96	6,9660	4	5-Dic-24	10	10,29	9,62	15,69
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,14	5 033	6,850	-	-	-	100,1342	-	-	-	6,8493	-	3-Dic-24	20	10,29	9,63	17,19
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,10	3 462	6,714	-	-	-	100,8104	-	-	-	6,6615	-	6-Nov-24	1	13,28	12,45	30,19
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,90	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3181	-	-	-	2,5940	-	18-Ago-23	20	4,89	4,76	5,19
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,55	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,7787	-	-	-	3,6010	-	30-Oct-24	2	7,69	7,42	10,16
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,98	228	3,14%+VAC	-	-	-	91,1118	-	-	-	3,9040	-	10-Ago-23	50	12,07	11,61	15,19
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,20	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,2585	-	-	-	3,6578	-	11-Oct-24	52	15,05	14,52	21,69
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,02	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	95,9345	-	-	-	3,4690	-	18-Oct-24	5	18,87	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).

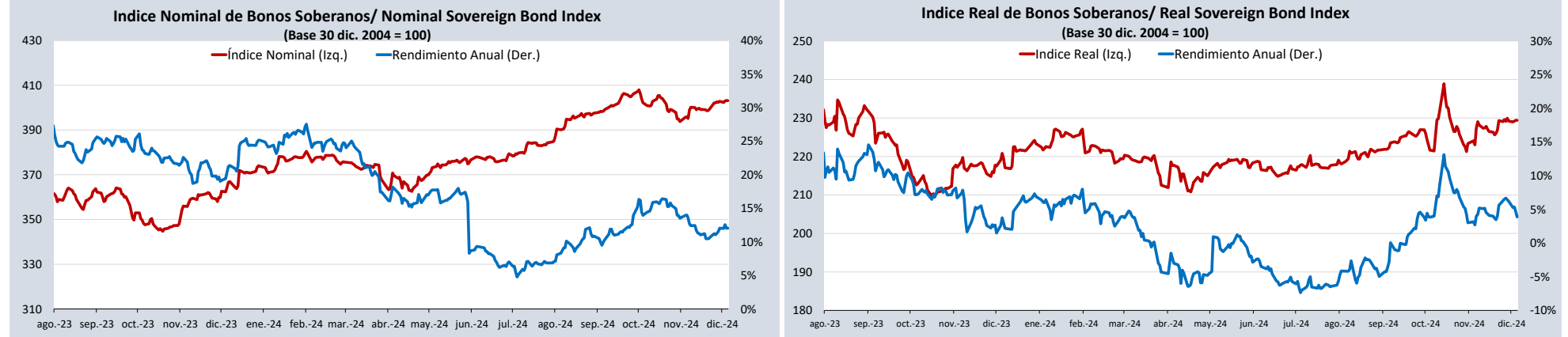


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,6540	0,00	0,01	-0,37	4,6220	-1	-9	59	0,61	0,60	0,63	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,0630	-0,05	0,02	-0,47	5,0960	6	2	44	1,12	1,09	1,15	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7380	0,01	0,06	-0,64	2,9820	-1	-5	58	1,13	1,12	1,17	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,0300	-0,04	0,12	-0,50	4,9050	2	-4	20	2,57	2,51	2,76	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,5020	0,10	0,47	-0,53	5,0400	-2	-10	12	5,07	4,94	5,62	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,3910	0,04	0,11	-0,81	3,4520	-1	-2	17	4,68	4,60	5,23	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,5280	0,12	0,55	-0,53	5,1830	-2	-11	11	5,58	5,44	6,22	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,1460	0,18	0,59	-0,54	5,2470	-3	-10	10	7,37	7,18	8,11	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,8320	0,17	0,70	-1,02	5,4890	-2	-9	13	6,65	6,48	9,09	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,7820	0,03	0,28	-0,80	3,8700	0	-4	13	7,80	7,65	8,38	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,5370	0,29	0,78	-0,58	5,3020	-4	-12	9	7,80	7,60	9,24	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,7730	0,45	1,05	-0,52	5,4030	-6	-14	7	7,83	7,62	10,33	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,7990	0,08	0,53	-0,72	4,0040	-1	-6	9	10,53	10,32	12,13	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,0570	0,25	0,87	-0,95	5,5230	-3	-10	10	8,68	8,45	12,45	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,7100	0,49	1,13	-0,69	5,4820	-5	-12	8	11,99	11,67	16,50	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,1170	0,32	1,15	-0,46	5,6900	-2	-9	4	13,86	13,47	26,33	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,5590	0,48	1,20	-0,74	5,5460	-4	-11	7	15,38	14,97	26,64	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,4570	0,53	1,46	-0,63	5,7710	-4	-10	4	14,22	13,82	30,11	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,4660	0,41	1,17	-0,72	5,4140	-4	-11	7	18,60	18,11	36,51	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,4760	0,50	1,41	-0,76	5,6390	-4	-12	7	17,73	17,25	47,80	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,9750	0,41	1,15	-0,68	5,5910	-4	-11	6	18,22	17,72	98,05	

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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	403	0	1	12,04	0	52	2,64	4,77	8,53	13,00	13,54	11,96	9,83	12,98	10,68	6,66	3,19
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	229	0	-1	3,88	-82	-255	2,32		36,15			6,20		19,84		35,49	



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.