



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

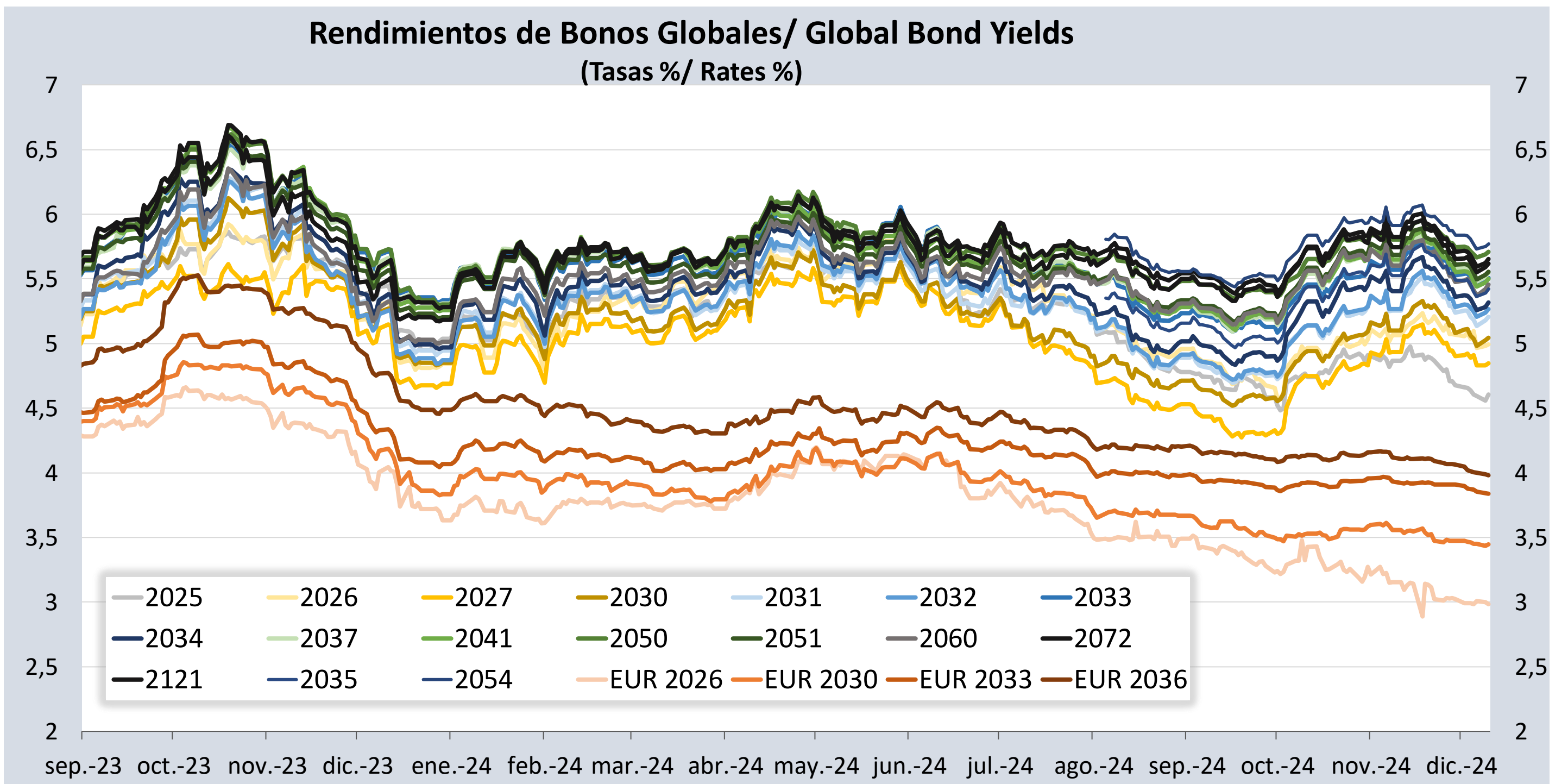
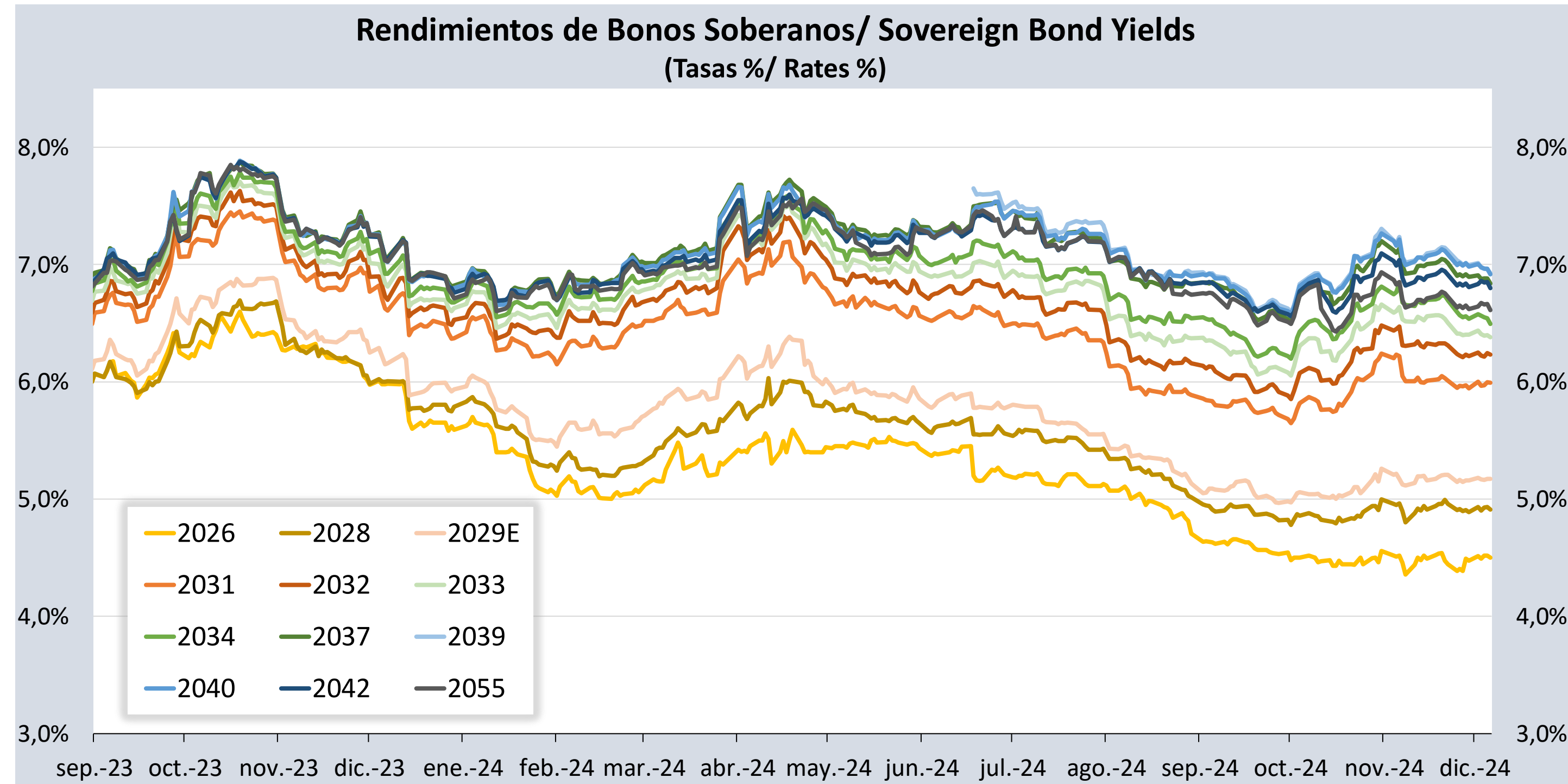
06/12/2024

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	2,58	3 937	8,200	-	-	-	105,9179	-	-	-	4,5000	-	3-Dic-24	0	1,59	1,52	1,69
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,00	7 225	6,350	104,61	104,86	104,67	104,7588	4,95	4,88	4,93	4,9100	6	6-Dic-24	12	3,34	3,31	3,69
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,87	13 176	5,940	102,67	102,90	102,84	102,8032	5,21	5,15	5,16	5,1725	4	6-Dic-24	8	3,76	3,58	4,19
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,19	19 573	6,950	104,89	105,39	105,11	105,2143	6,05	5,96	6,01	5,9933	15	6-Dic-24	30	5,46	5,15	6,69
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,94	21 588	6,150	99,22	99,48	99,48	99,5267	6,29	6,24	6,24	6,2320	42	6-Dic-24	246	6,20	5,84	7,69
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,30	17 855	7,300	105,69	105,96	105,96	106,1068	6,44	6,40	6,40	6,3794	8	6-Dic-24	66	6,61	6,21	8,69
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,70	17 260	5,400	91,59	92,39	91,99	92,2771	6,60	6,48	6,54	6,4948	36	6-Dic-24	444	7,54	7,08	9,69
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,17	20 481	6,900	100,12	101,37	100,41	100,6386	6,90	6,75	6,87	6,8374	15	6-Dic-24	80	8,61	8,06	12,69
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,26	15 811	7,600	105,69	106,06	106,01	106,3053	6,99	6,95	6,96	6,9238	15	6-Dic-24	276	9,13	8,54	14,69
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,69	12 442	5,350	84,67	85,00	84,92	85,2807	6,99	6,95	6,96	6,9156	17	6-Dic-24	85	10,30	9,63	15,69
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,16	5 033	6,850	-	-	-	100,6327	-	-	-	6,7989	-	3-Dic-24	20	10,31	9,65	17,19
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,12	3 462	6,714	-	-	-	101,4596	-	-	-	6,6111	-	6-Nov-24	1	13,32	12,50	30,19
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,91	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3161	-	-	-	2,5943	-	18-Ago-23	20	4,88	4,76	5,19
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,57	911	7,39% + VAC	-	-	-	132,2064	-	-	-	3,5575	-	30-Oct-24	2	7,69	7,43	10,16
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,99	228	3,14%+VAC	-	-	-	91,5635	-	-	-	3,8620	-	10-Ago-23	50	12,07	11,62	15,19
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,21	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,9963	-	-	-	3,6089	-	11-Oct-24	52	15,07	14,55	21,69
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,03	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	96,8046	-	-	-	3,4201	-	18-Oct-24	5	18,92	18,29	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).

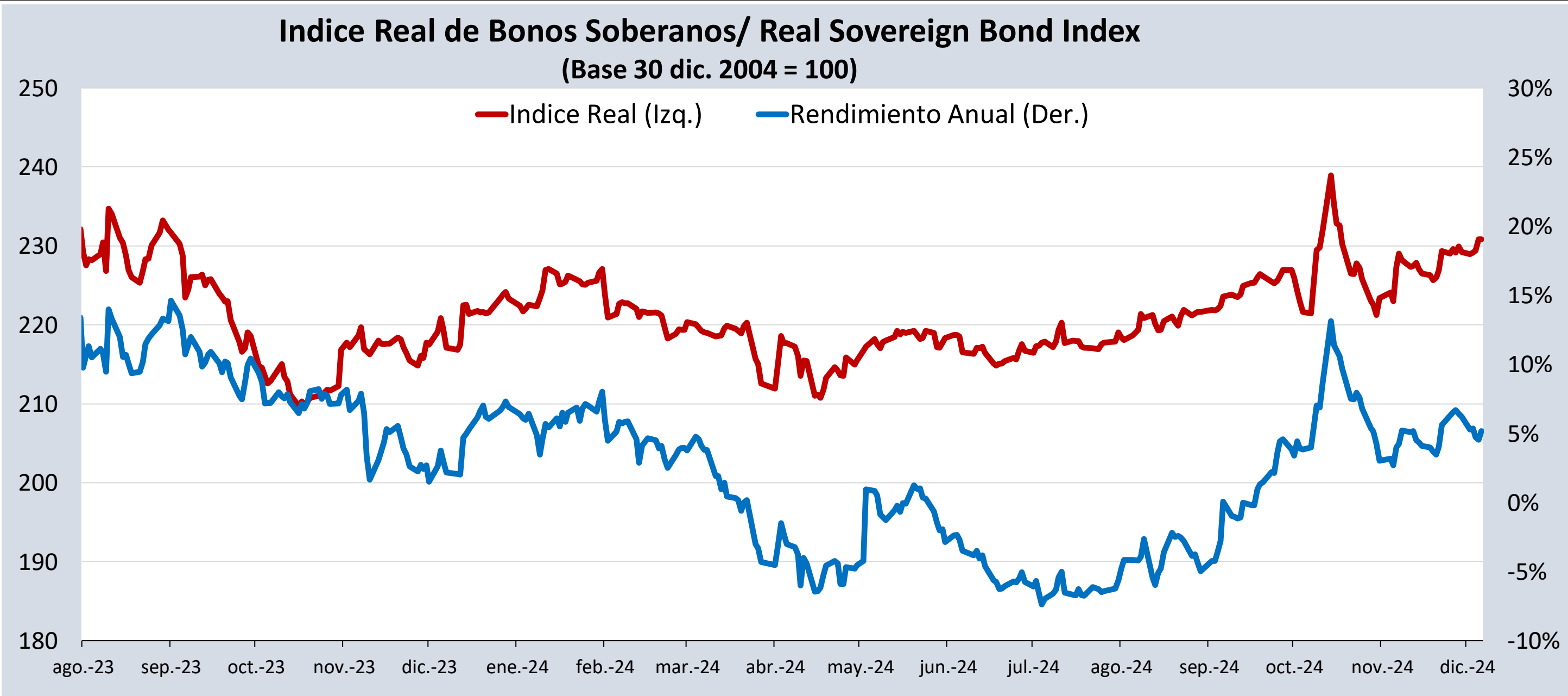
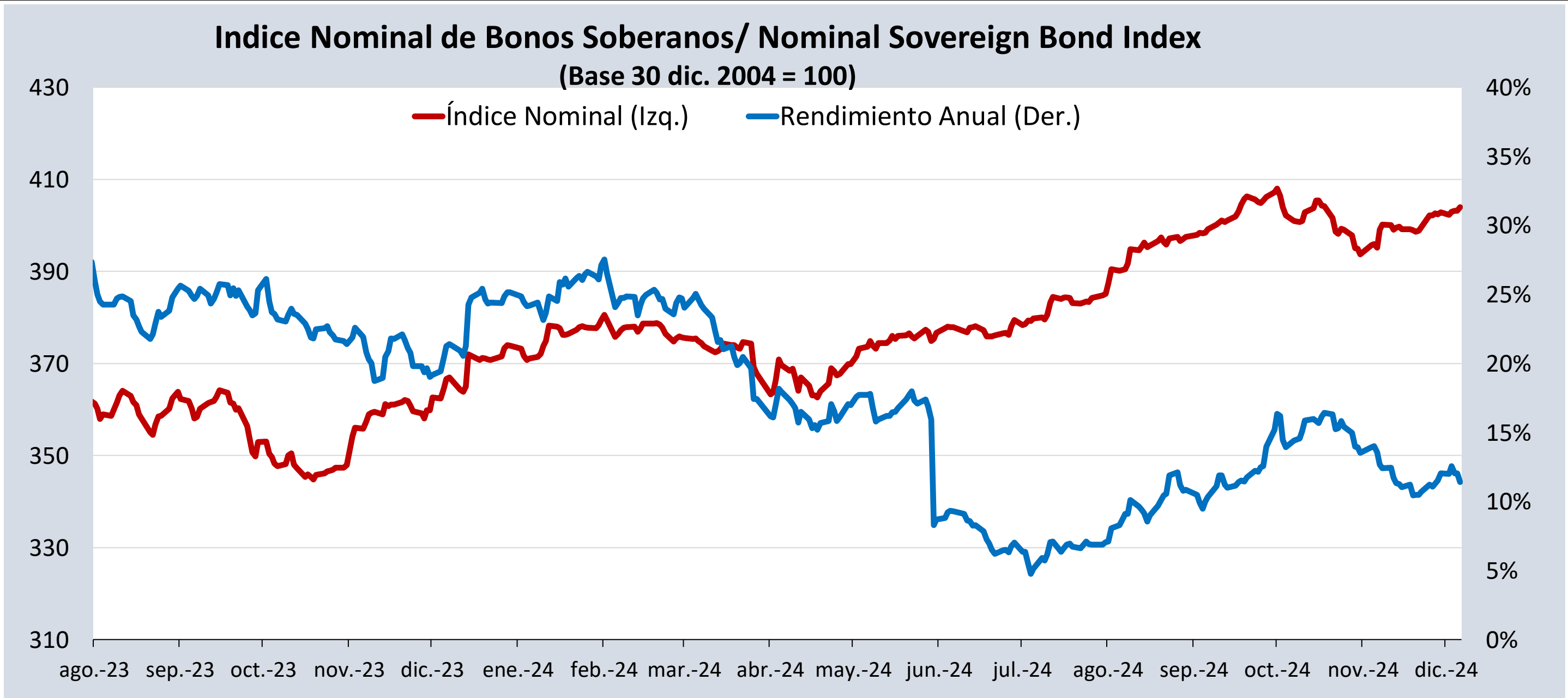
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6490	-0,01	0,00	-0,41	4,5950	-1	-8	67	0,61	0,59	0,63
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,2210	0,16	0,16	-0,48	4,9660	-13	-10	45	1,11	1,09	1,15
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7090	-0,03	0,02	-0,48	3,0090	3	-1	44	1,13	1,11	1,17
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,2140	0,20	0,19	-0,53	4,8330	-8	-7	21	2,57	2,51	2,76
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,7770	0,27	0,48	-0,57	4,9810	-6	-10	13	5,06	4,94	5,62
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,3910	0,00	0,10	-0,62	3,4520	0	-2	13	4,68	4,60	5,23
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,7630	0,24	0,52	-0,58	5,1370	-5	-10	12	5,58	5,44	6,22
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,3810	0,23	0,46	-0,53	5,2080	-4	-8	10	7,37	7,18	8,10
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,1800	0,35	0,64	-1,11	5,4430	-5	-9	14	6,65	6,48	9,09
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,8790	0,10	0,36	-0,81	3,8560	-1	-5	13	7,80	7,65	8,38
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,8280	0,29	0,68	-0,61	5,2590	-4	-10	9	7,80	7,60	9,24
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,0660	0,29	0,97	-0,54	5,3650	-4	-13	7	7,83	7,63	10,32
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,8410	0,04	0,54	-0,72	4,0000	0	-6	9	10,52	10,32	12,12
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,4300	0,37	0,88	-0,97	5,4820	-4	-10	10	8,68	8,45	12,45
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,0900	0,38	1,01	-0,69	5,4410	-4	-11	8	12,00	11,68	16,50
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,4310	0,32	1,05	-0,41	5,6670	-2	-8	3	13,87	13,49	26,33
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,1180	0,56	1,25	-0,74	5,4960	-5	-11	7	15,42	15,01	26,64
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	102,0490	0,60	1,53	-0,59	5,7300	-4	-11	4	14,26	13,86	30,10
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,9400	0,47	1,14	-0,74	5,3700	-4	-11	7	18,67	18,18	36,51
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,9860	0,51	1,31	-0,78	5,5950	-4	-11	7	17,83	17,34	47,79
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	58,3860	0,41	1,06	-0,67	5,5520	-4	-10	6	18,34	17,85	98,05

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	404	1	1	11,41	-63	-63	2,64	4,76	8,52	12,98	13,52	11,95	9,84	13,00	10,70	6,68	3,19	2,21
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	231	0	2	5,18	66	-102	2,31				36,05		6,20		19,86		35,59	



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.