



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

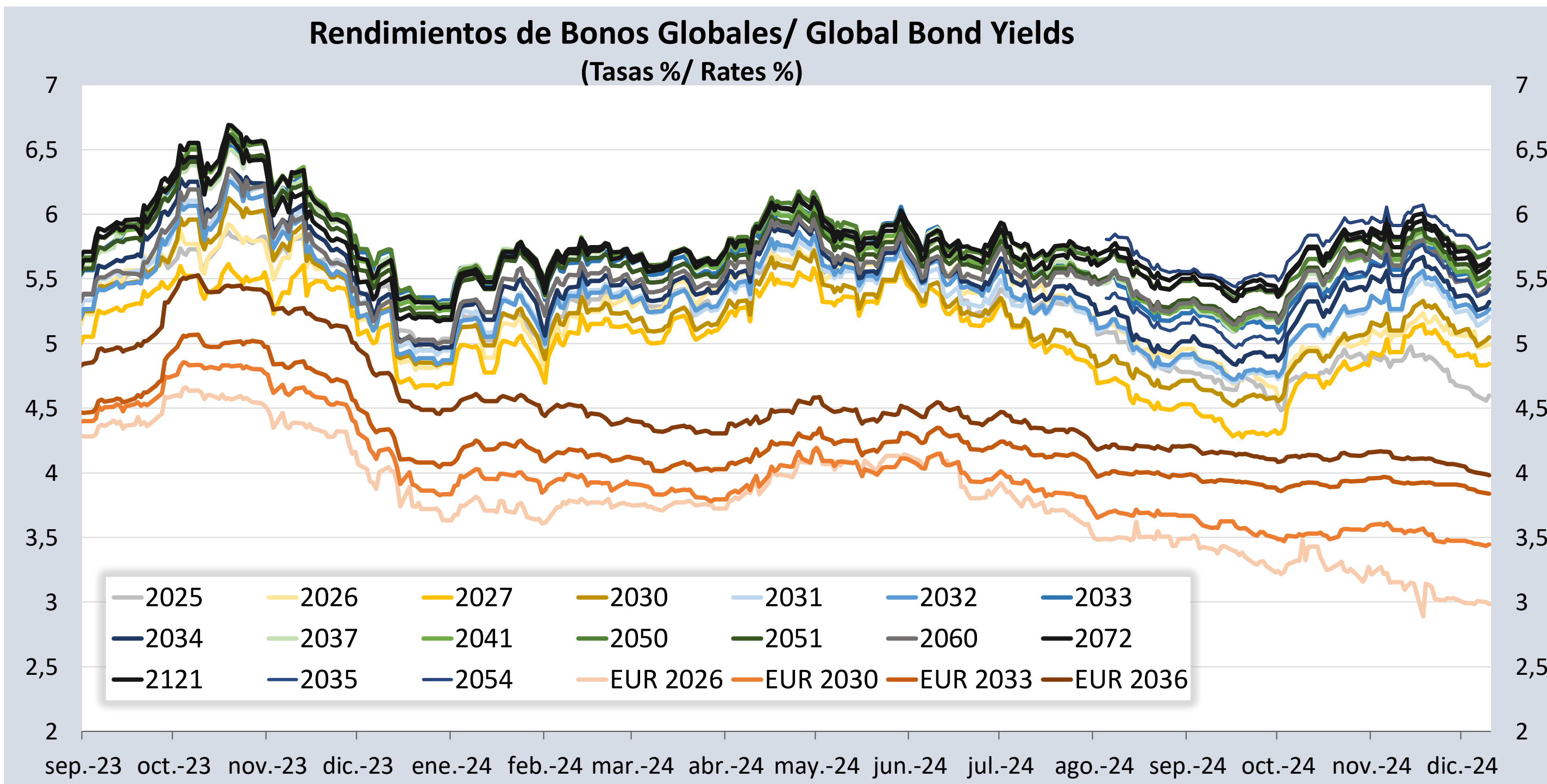
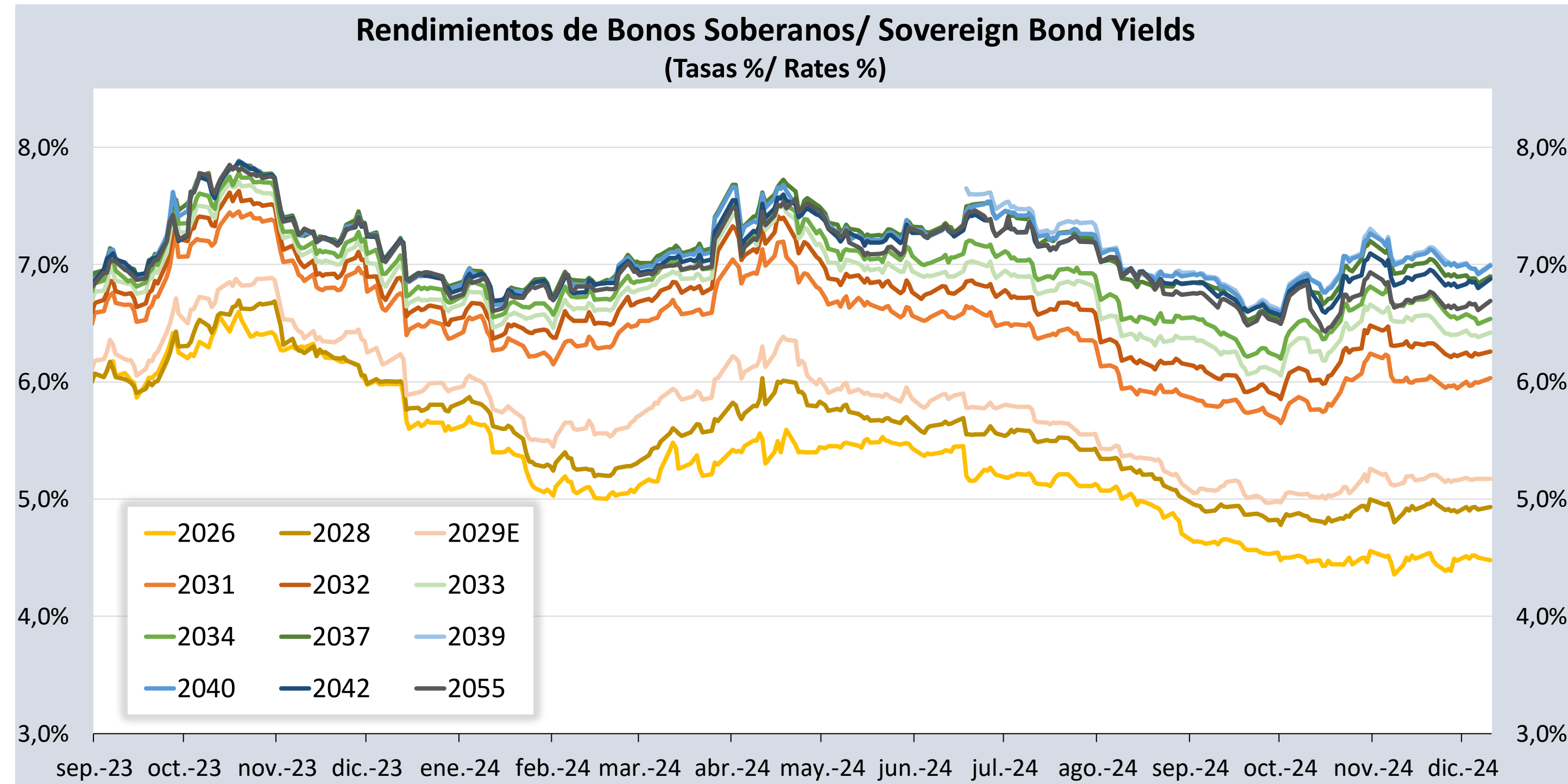
10/12/2024

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	2,67	3 937	8,200	-	-	-	105,9148	-	-	-	4,4800	-	3-Dic-24	0	1,58	1,51	1,68
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,07	7 225	6,350	104,60	104,70	104,67	104,6789	4,95	4,92	4,93	4,9300	2	10-Dic-24	4	3,33	3,31	3,68
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,94	13 176	5,940	102,63	102,95	102,80	102,8067	5,22	5,13	5,17	5,1700	1	10-Dic-24	3	3,75	3,57	4,18
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,27	19 573	6,950	104,80	105,22	105,00	105,0057	6,07	5,99	6,03	6,0300	6	10-Dic-24	12	5,45	5,14	6,68
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,01	21 588	6,150	99,25	99,42	99,36	99,3660	6,28	6,25	6,26	6,2594	15	10-Dic-24	33	6,19	5,83	7,68
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,38	17 855	7,300	105,56	106,03	105,83	105,8294	6,46	6,39	6,42	6,4200	4	10-Dic-24	8	6,59	6,19	8,68
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,76	17 260	5,400	91,56	92,19	91,92	92,0074	6,61	6,51	6,55	6,5365	24	10-Dic-24	404	7,52	7,06	9,68
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,25	20 481	6,900	99,59	100,37	100,12	100,1228	6,97	6,87	6,90	6,9000	2	10-Dic-24	40	8,58	8,03	12,68
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,34	15 811	7,600	105,13	105,87	105,69	105,5942	7,05	6,97	6,99	7,0001	3	10-Dic-24	25	9,10	8,50	14,68
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,74	12 442	5,350	-	-	-	84,6672	-	-	-	6,9900	-	10-Dic-24	1	10,27	9,60	15,68
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,23	5 033	6,850	-	-	-	99,8807	-	-	-	6,8752	-	3-Dic-24	20	10,27	9,61	17,18
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,19	3 462	6,714	-	-	-	100,4805	-	-	-	6,6874	-	6-Nov-24	1	13,24	12,41	30,18
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,94	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2953	-	-	-	2,5981	-	18-Ago-23	20	4,87	4,75	5,18
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,65	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,8330	-	-	-	3,5921	-	30-Oct-24	2	7,68	7,41	10,14
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,02	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,8823	-	-	-	3,9261	-	10-Ago-23	50	12,05	11,59	15,18
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,25	649	3,83% + VAC	-	-	-	102,0168	-	-	-	3,6739	-	11-Oct-24	52	15,03	14,49	21,68
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,07	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	95,6521	-	-	-	3,4851	-	18-Oct-24	5	18,83	18,20	29,18

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).

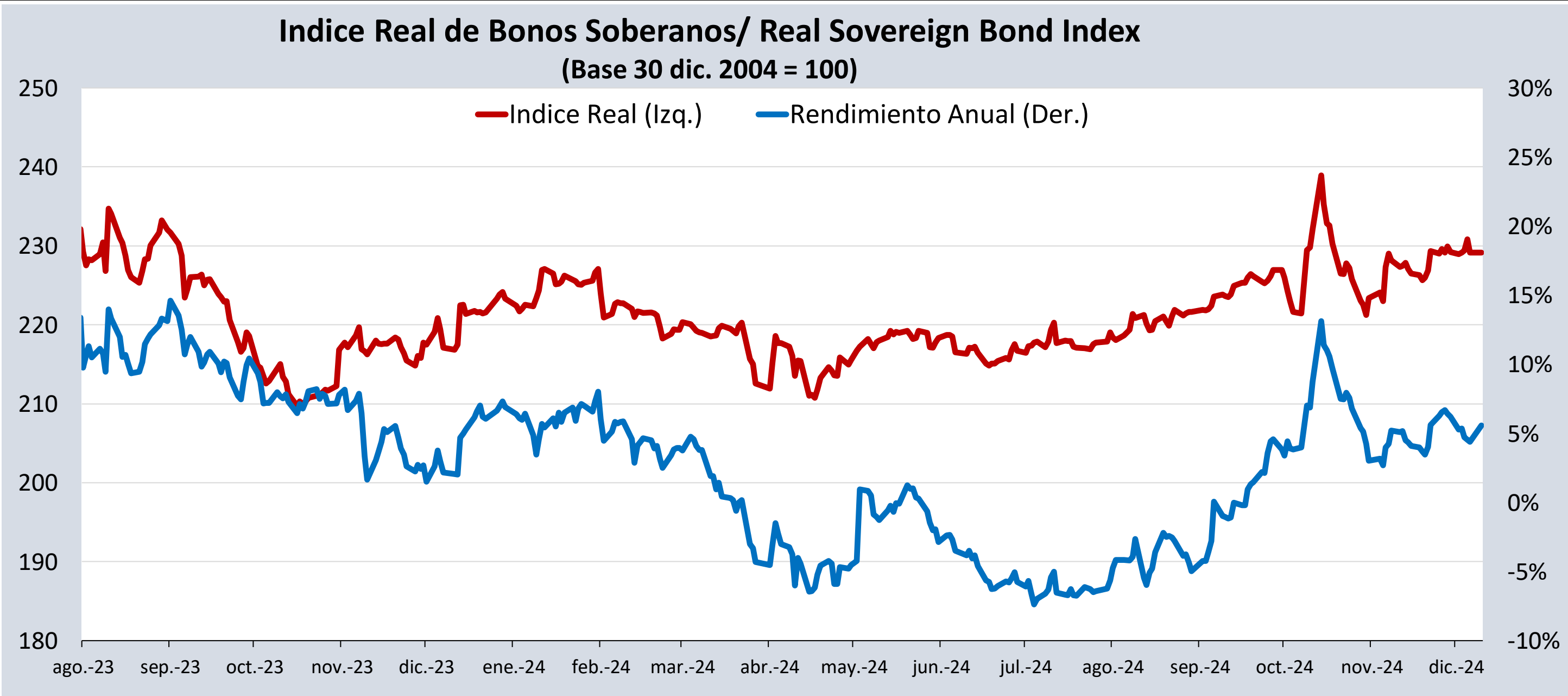
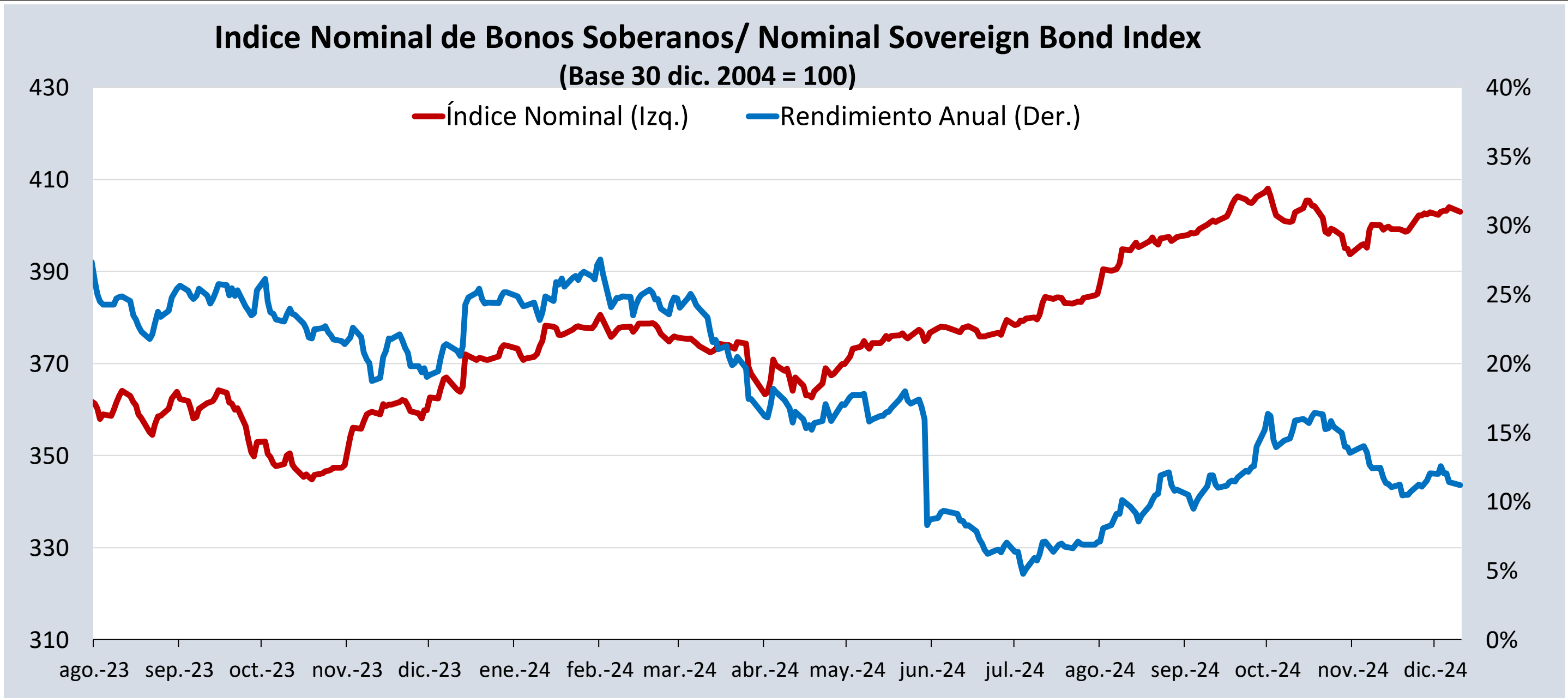
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6330	-0,03	-0,01	-0,35	4,5970	4	-6	57	0,60	0,58	0,62
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,2060	-0,01	0,15	-0,47	4,9930	1	-9	45	1,10	1,07	1,14
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7380	0,02	0,01	-0,64	2,9840	-2	-1	58	1,12	1,10	1,16
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1890	-0,04	0,21	-0,44	4,8450	1	-8	18	2,56	2,50	2,74
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,4910	-0,10	0,33	-0,51	5,0470	2	-7	11	5,05	4,93	5,61
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,4190	-0,05	0,10	-0,84	3,4460	1	-2	18	4,66	4,59	5,21
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,4260	-0,14	0,25	-0,54	5,2090	3	-4	11	5,56	5,42	6,21
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,0750	-0,14	0,23	-0,53	5,2650	3	-3	9	7,35	7,17	8,09
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,6430	-0,25	0,22	-1,09	5,5090	3	-3	14	6,64	6,46	9,08
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	81,9980	0,02	0,29	-0,81	3,8380	0	-4	13	7,79	7,64	8,37
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,4380	-0,24	0,34	-0,58	5,3200	4	-5	9	7,79	7,59	9,23
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,6160	-0,24	0,54	-0,53	5,4240	3	-7	7	7,81	7,61	10,31
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,0060	0,07	0,36	-0,71	3,9800	-1	-4	9	10,51	10,31	12,11
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,8020	-0,32	0,36	-0,95	5,5490	3	-4	10	8,66	8,43	12,44
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,5560	-0,24	0,50	-0,72	5,5000	3	-5	8	11,97	11,65	16,49
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,8570	-0,26	0,45	-0,54	5,7100	2	-3	4	13,83	13,44	26,32
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,4560	-0,27	0,60	-0,71	5,5560	3	-5	7	15,36	14,94	26,63
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,4300	-0,33	0,88	-0,63	5,7730	2	-6	4	14,20	13,80	30,09
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,0440	-0,36	0,49	-0,75	5,4540	3	-5	7	18,52	18,02	36,50
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,2990	-0,35	0,64	-0,74	5,6540	3	-5	6	17,68	17,20	47,78
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,7030	-0,28	0,56	-0,69	5,6170	3	-5	7	18,12	17,63	98,04

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	403	-1	0	11,20	-21	-136	2,65	4,77	8,54	13,00	13,55	11,96	9,85	12,98	10,66	6,66	3,18	2,20
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	5,56	115	19	2,32				36,23		6,20		19,82		35,43	



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.