



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

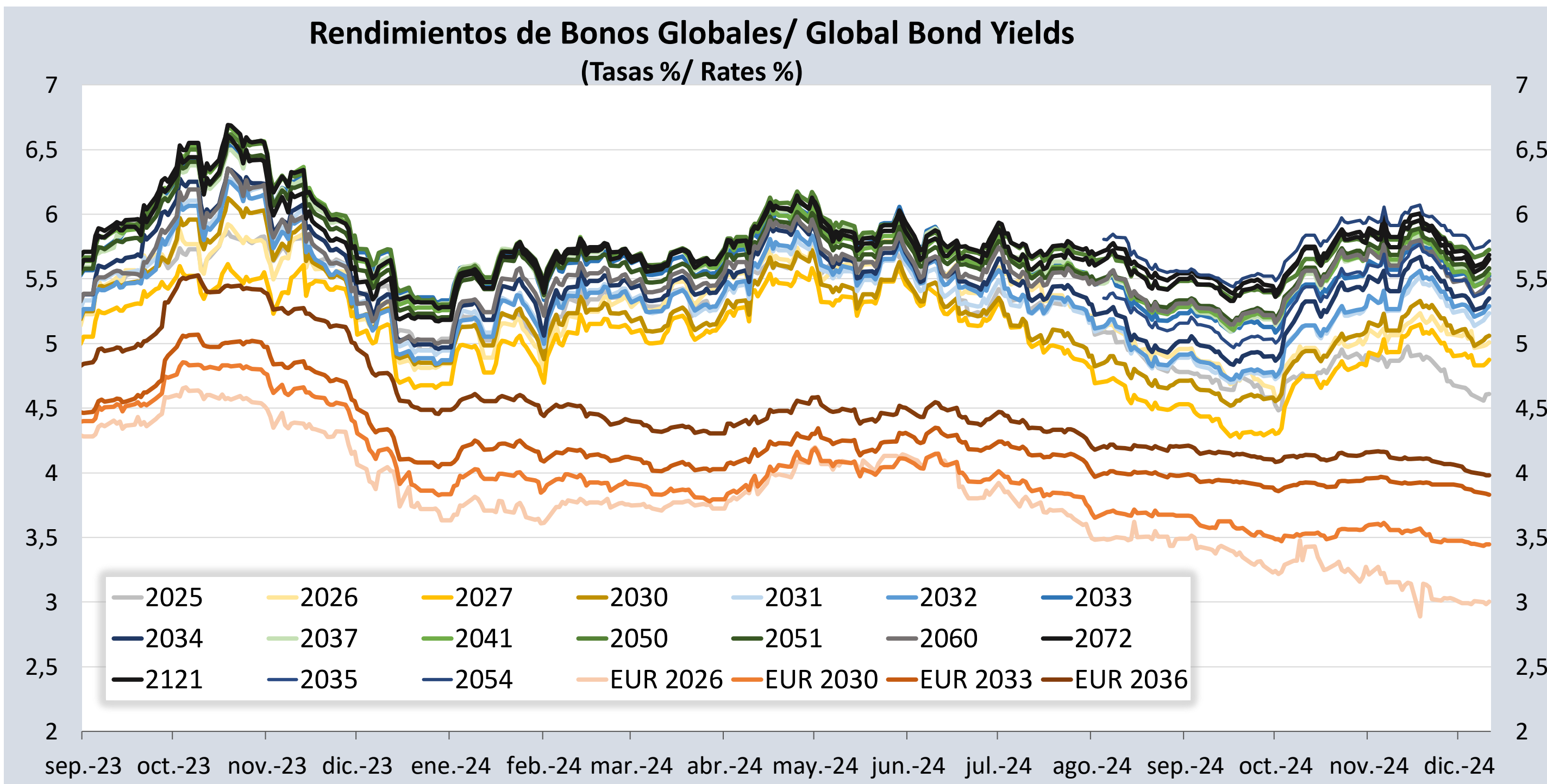
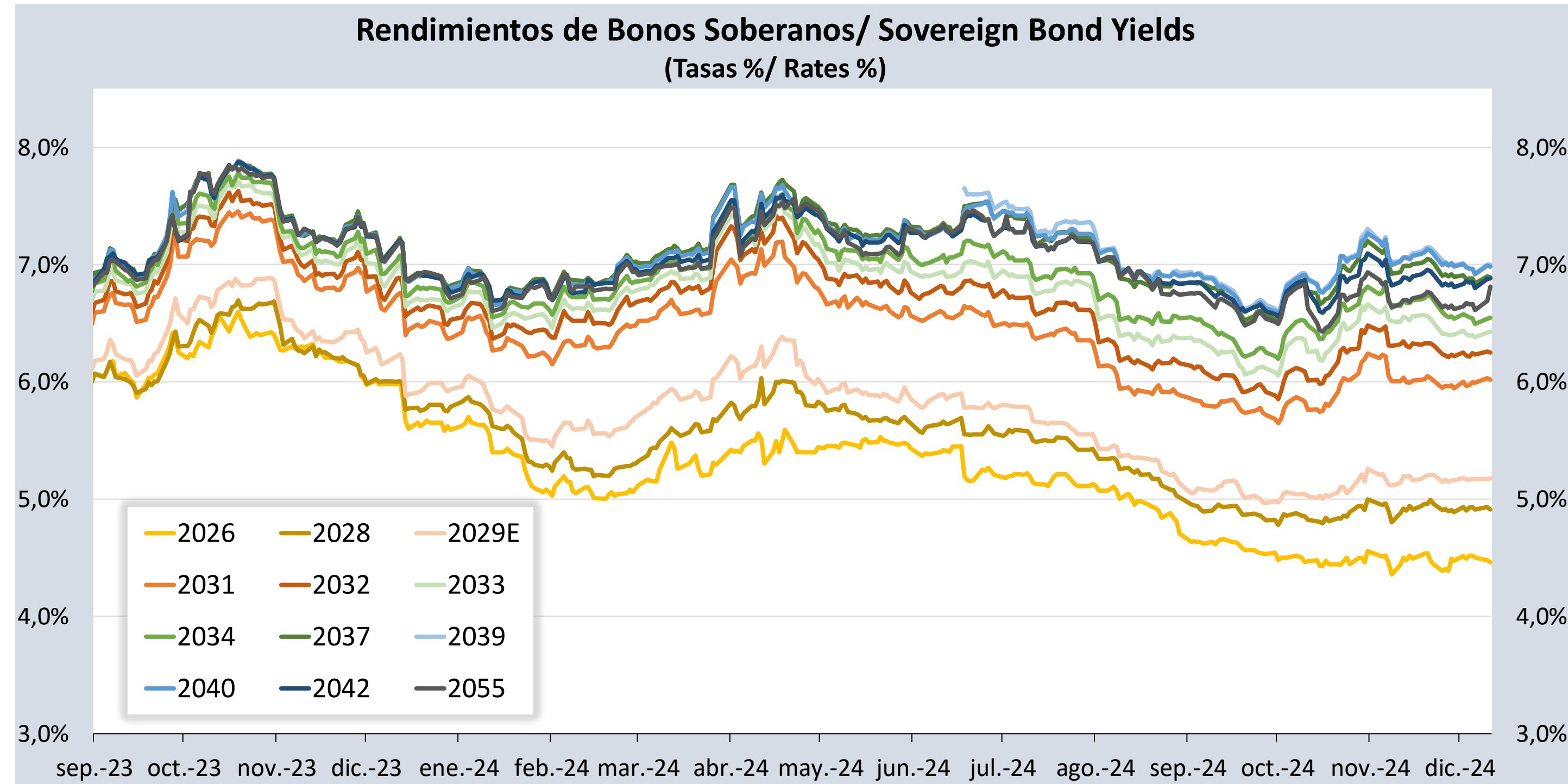
11/12/2024

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	2,70	3 937	8,200	-	-	-	105,9386	-	-	-	4,4600	-	11-Dic-24	0	1,58	1,51	1,67
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,09	7 225	6,350	104,59	104,83	104,73	104,7436	4,95	4,88	4,91	4,9100	1	11-Dic-24	5	3,32	3,31	3,67
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,95	13 176	5,940	102,67	102,95	102,87	102,7772	5,21	5,13	5,15	5,1775	9	11-Dic-24	274	3,75	3,56	4,17
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,29	19 573	6,950	104,89	105,33	105,16	105,0803	6,05	5,97	6,00	6,0162	88	11-Dic-24	518	5,45	5,14	6,67
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,02	21 588	6,150	99,25	99,78	99,54	99,4254	6,28	6,19	6,23	6,2494	43	11-Dic-24	357	6,19	5,83	7,67
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,40	17 855	7,300	105,66	105,89	105,89	105,7894	6,45	6,41	6,41	6,4258	8	11-Dic-24	66	6,59	6,19	8,67
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,78	17 260	5,400	91,76	92,53	92,06	91,9470	6,58	6,46	6,53	6,5459	29	11-Dic-24	162	7,52	7,06	9,67
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,27	20 481	6,900	100,12	100,21	100,29	100,2160	6,90	6,89	6,88	6,8887	21	11-Dic-24	62	8,58	8,03	12,67
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,37	15 811	7,600	105,36	105,78	105,78	105,6191	7,03	6,98	6,98	6,9974	18	11-Dic-24	330	9,09	8,50	14,67
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,76	12 442	5,350	84,55	85,51	84,76	84,7244	7,01	6,89	6,98	6,9833	6	11-Dic-24	12	10,27	9,60	15,67
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,25	5 033	6,850	-	-	-	99,8143	-	-	-	6,8820	-	3-Dic-24	20	10,26	9,60	17,17
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,21	3 462	6,714	-	-	98,94	98,9210	-	-	6,81	6,8114	4	11-Dic-24	27	13,12	12,28	30,17
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,95	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2549	-	-	-	2,6063	-	18-Ago-23	20	4,87	4,75	5,17
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,67	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,6747	-	-	-	3,6073	-	30-Oct-24	2	7,67	7,41	10,14
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,03	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,8335	-	-	-	3,9308	-	10-Ago-23	50	12,04	11,59	15,17
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,26	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,1950	-	-	-	3,7291	-	11-Oct-24	52	14,99	14,45	21,67
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,07	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	93,5595	-	-	-	3,6058	-	18-Oct-24	5	18,70	18,05	29,17

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).

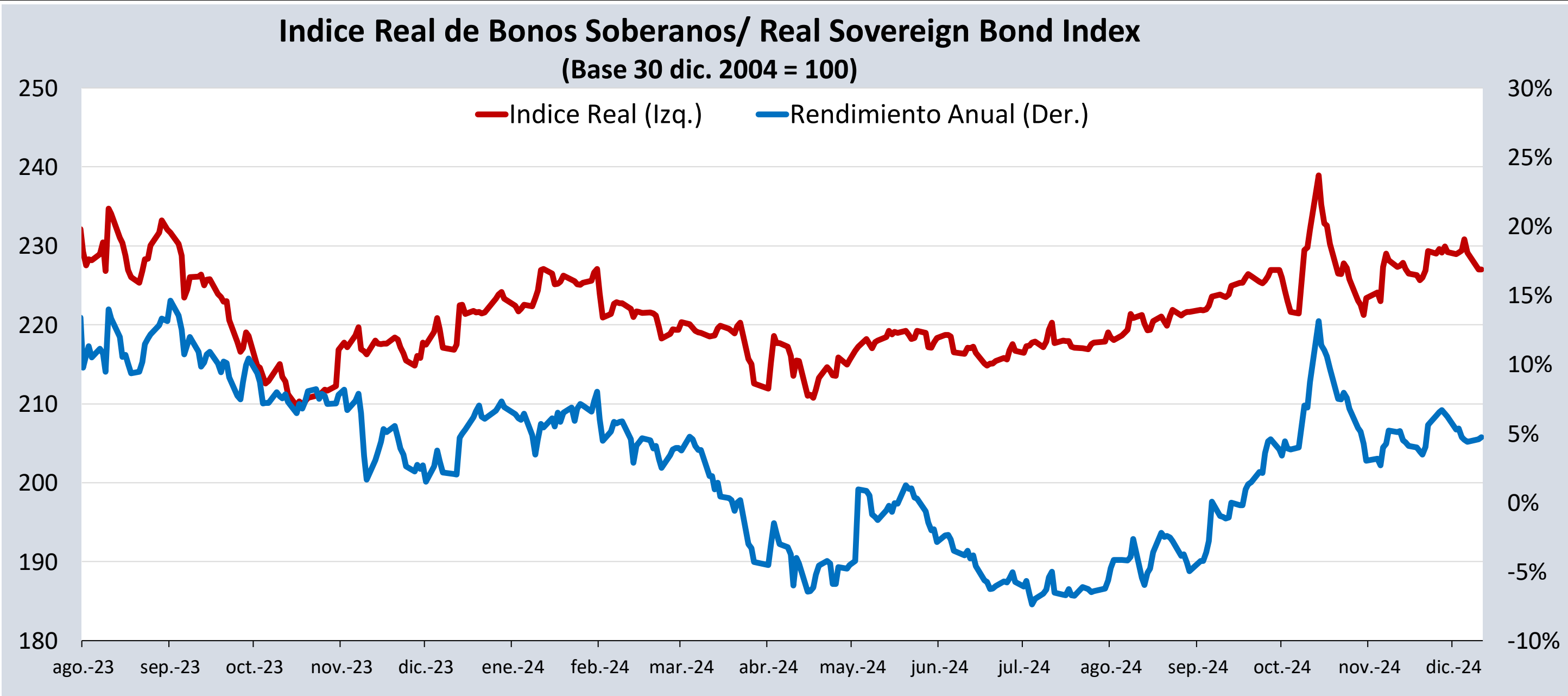
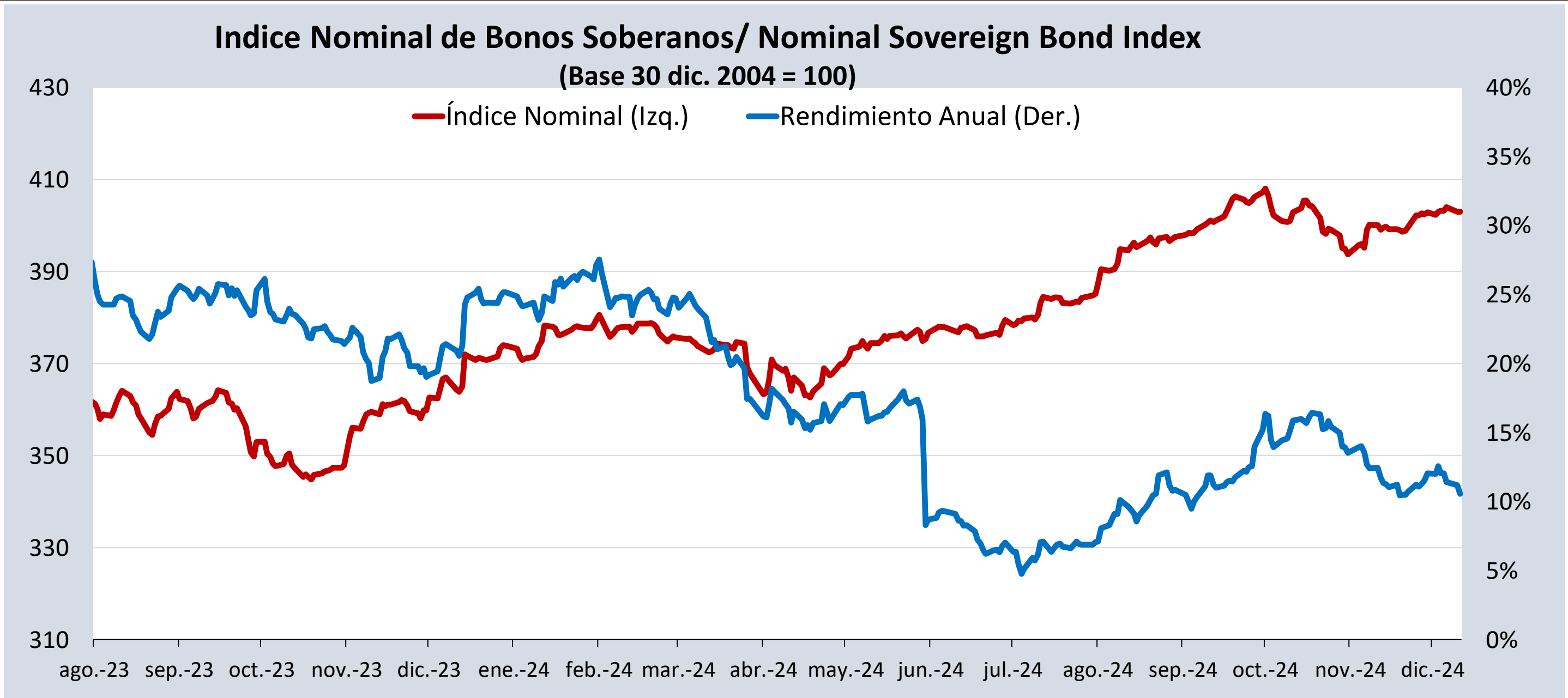
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,6180	-0,01	-0,03	-0,37	4,6100	0	-3	61	0,59	0,58	0,62
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,1970	-0,01	0,08	-0,44	5,0080	2	-3	42	1,10	1,07	1,13
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7190	-0,02	-0,01	-0,64	3,0020	2	1	58	1,12	1,10	1,15
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,1190	-0,06	0,05	-0,46	4,8740	3	-2	18	2,56	2,50	2,74
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,4280	-0,06	0,03	-0,52	5,0620	2	0	12	5,05	4,92	5,60
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,4190	0,00	0,07	-0,84	3,4460	0	-2	18	4,66	4,58	5,21
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,3060	-0,12	-0,11	-0,52	5,2350	3	3	11	5,56	5,42	6,21
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,9400	-0,13	-0,03	-0,53	5,2900	3	1	9	7,35	7,16	8,09
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,5090	-0,14	-0,15	-1,05	5,5250	2	1	13	6,63	6,46	9,08
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,0530	0,05	0,30	-0,84	3,8300	-1	-4	14	7,78	7,64	8,37
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,2470	-0,19	0,00	-0,56	5,3510	3	0	9	7,79	7,58	9,23
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,4400	-0,17	0,11	-0,51	5,4470	2	-1	7	7,81	7,60	10,31
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,0230	0,02	0,30	-0,70	3,9790	0	-3	8	10,51	10,31	12,11
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,5920	-0,22	-0,22	-1,00	5,5720	2	2	11	8,65	8,42	12,43
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,2090	-0,34	-0,01	-0,68	5,5390	4	0	8	11,95	11,63	16,48
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,6660	-0,19	-0,13	-0,61	5,7240	1	1	5	13,81	13,43	26,31
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,1400	-0,31	0,06	-0,70	5,5850	3	0	7	15,33	14,91	26,63
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,0980	-0,33	0,17	-0,60	5,7960	2	-1	4	14,18	13,78	30,09
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,6080	-0,44	-0,45	-0,72	5,4960	4	4	7	18,44	17,95	36,50
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,9400	-0,36	-0,04	-0,72	5,6850	3	0	6	17,61	17,13	47,78
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,3160	-0,38	-0,25	-0,62	5,6540	4	2	6	18,00	17,51	98,03

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	0	0	10,57	-63	-147	2,65	4,78	8,54	13,01	13,56	11,96	9,84	12,99	10,67	6,66	3,18	2,17
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	227	0	-2	4,71	13	0	2,34				36,54		6,25		19,85		35,00	



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.