



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

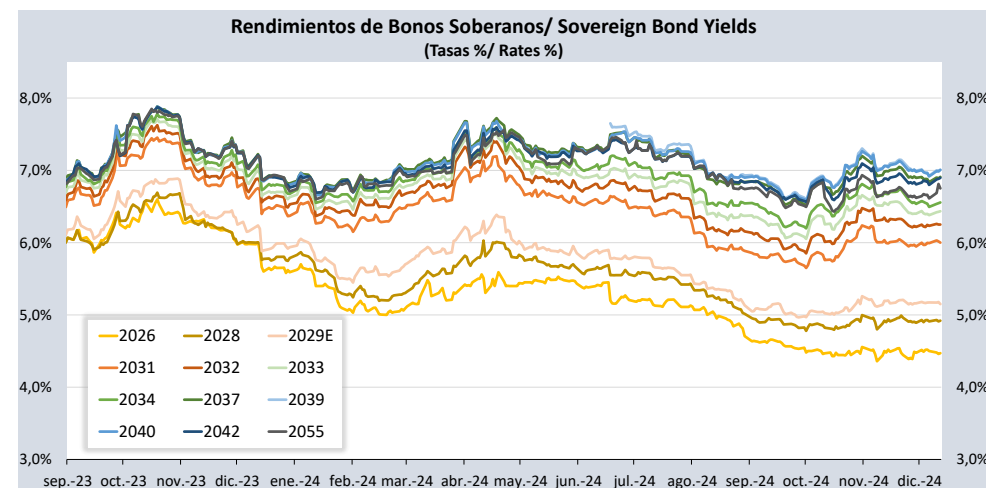
12/12/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

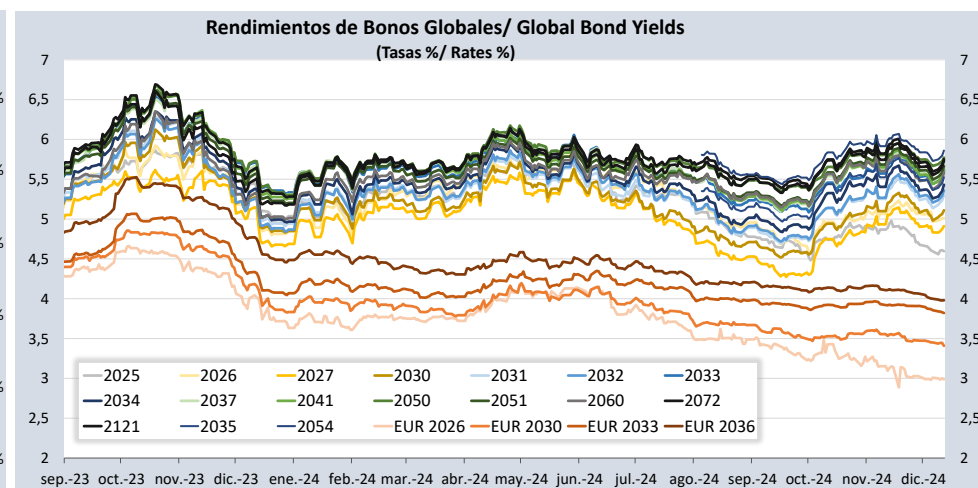
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	2,72	3 937	8,200	-	-	-	105,9130	-	-	-	4,4700	-	11-Dic-24	0	1,58	1,51	1,67
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,11	7 225	6,350	104,52	104,83	104,69	104,7067	4,97	4,88	4,92	4,9200	3	12-Dic-24	6	3,32	3,31	3,67
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,97	13 176	5,940	102,87	102,91	102,87	102,8784	5,15	5,14	5,15	5,1500	7	12-Dic-24	14	3,75	3,56	4,17
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,30	19 573	6,950	105,11	105,22	105,16	105,1644	6,01	5,99	6,00	6,0007	18	12-Dic-24	141	5,44	5,14	6,67
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,04	21 588	6,150	99,34	99,48	99,42	99,4223	6,27	6,24	6,25	6,2500	2	12-Dic-24	4	6,19	5,82	7,67
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,42	17 855	7,300	105,65	105,96	105,69	105,7361	6,45	6,40	6,44	6,4336	19	12-Dic-24	87	6,58	6,19	8,67
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,79	17 260	5,400	91,81	91,93	91,83	91,8814	6,57	6,55	6,57	6,5561	32	12-Dic-24	212	7,52	7,05	9,67
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,29	20 481	6,900	99,88	100,04	99,96	100,0411	6,93	6,91	6,92	6,9100	6	12-Dic-24	196	8,58	8,02	12,67
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,39	15 811	7,600	105,22	105,50	105,50	105,5300	7,04	7,01	7,01	7,0070	15	12-Dic-24	103	9,09	8,49	14,67
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,77	12 442	5,350	84,22	84,51	84,43	84,5355	7,05	7,01	7,02	7,0063	10	12-Dic-24	27	10,26	9,58	15,67
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,27	5 033	6,850	-	-	-	99,6745	-	-	-	6,8963	-	3-Dic-24	20	10,26	9,59	17,17
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,23	3 462	6,714	-	-	99,69	99,6886	-	-	6,75	6,7500	1	12-Dic-24	40	13,17	12,34	30,17
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,96	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3616	-	-	-	2,5842	-	18-Ago-23	20	4,87	4,74	5,17
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,69	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,5515	-	-	-	3,6190	-	30-Oct-24	2	7,67	7,40	10,14
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,04	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,6668	-	-	-	3,9466	-	10-Ago-23	50	12,04	11,58	15,17
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,27	649	3,83% + VAC	-	-	-	101,3670	-	-	-	3,7175	-	11-Oct-24	52	15,00	14,46	21,67
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,08	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	94,4867	-	-	-	3,5519	-	18-Oct-24	5	18,76	18,11	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).

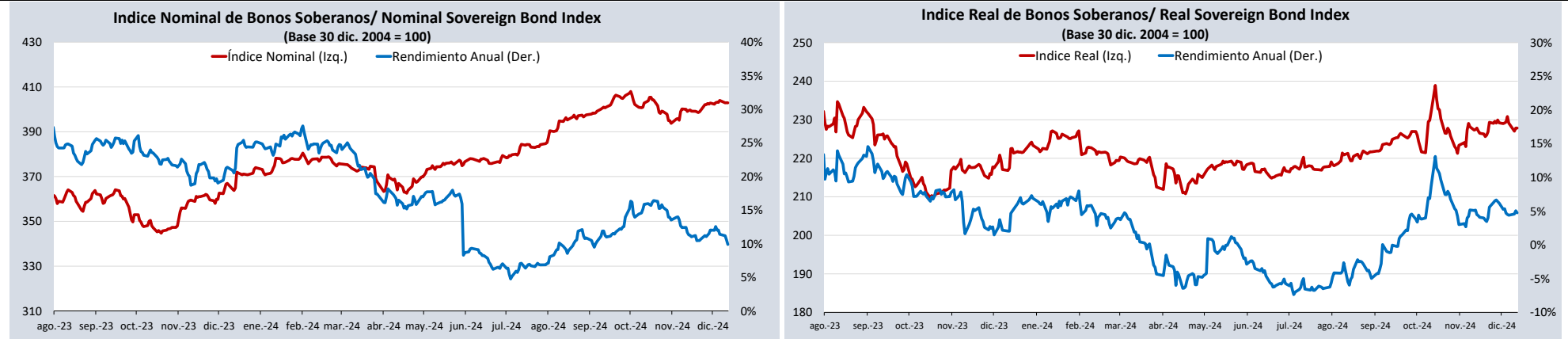


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,6190	0,00	-0,04	-0,36	4,5970	-1	-1	60	0,59	0,58	0,61	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,1990	0,00	0,14	-0,46	5,0130	0	-8	44	1,10	1,07	1,13	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7350	0,02	0,00	-0,43	2,9890	-1	1	40	1,11	1,10	1,15	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,0240	-0,09	0,01	-0,48	4,9130	4	0	20	2,55	2,49	2,74	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,2150	-0,21	-0,29	-0,53	5,1110	5	7	12	5,05	4,92	5,60	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,5970	0,18	0,21	-0,62	3,4080	-4	-4	13	4,66	4,58	5,21	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,9970	-0,31	-0,53	-0,53	5,3010	7	12	11	5,56	5,41	6,20	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,5570	-0,38	-0,59	-0,55	5,3600	7	11	10	7,35	7,15	8,09	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,8490	-0,66	-0,98	-1,12	5,6080	8	12	14	6,62	6,44	9,07	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,1270	0,07	0,34	-0,74	3,8200	-1	-5	12	7,78	7,63	8,36	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,7300	-0,52	-0,81	-0,57	5,4320	8	13	9	7,78	7,57	9,23	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,8320	-0,61	-0,94	-0,61	5,5260	8	12	8	7,80	7,59	10,31	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,0200	0,00	0,22	-0,71	3,9800	0	-2	8	10,51	10,30	12,11	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8920	-0,70	-1,17	-0,91	5,6480	8	13	10	8,64	8,40	12,43	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,5210	-0,69	-1,19	-0,72	5,6170	8	14	8	11,93	11,60	16,48	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,0240	-0,64	-1,09	-0,38	5,7730	5	8	3	13,77	13,38	26,31	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,2650	-0,88	-1,29	-0,78	5,6660	8	12	7	15,25	14,83	26,62	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,2070	-0,89	-1,25	-0,69	5,8600	6	9	5	14,11	13,71	30,09	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,6910	-0,92	-1,78	-0,71	5,5860	9	17	7	18,29	17,80	36,49	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1820	-0,76	-1,30	-0,75	5,7510	7	11	7	17,47	16,98	47,78	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,5120	-0,80	-1,47	-0,66	5,7340	8	14	7	17,75	17,25	98,03	

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	0	0	9,89	-67	-214	2,65	4,78	8,55	13,02	13,56	11,96	9,84	12,98	10,66	6,65	3,18	2,18
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	228	0	-3	4,76	-32	23	2,34				36,39		6,22		19,82		35,23	



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.