



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

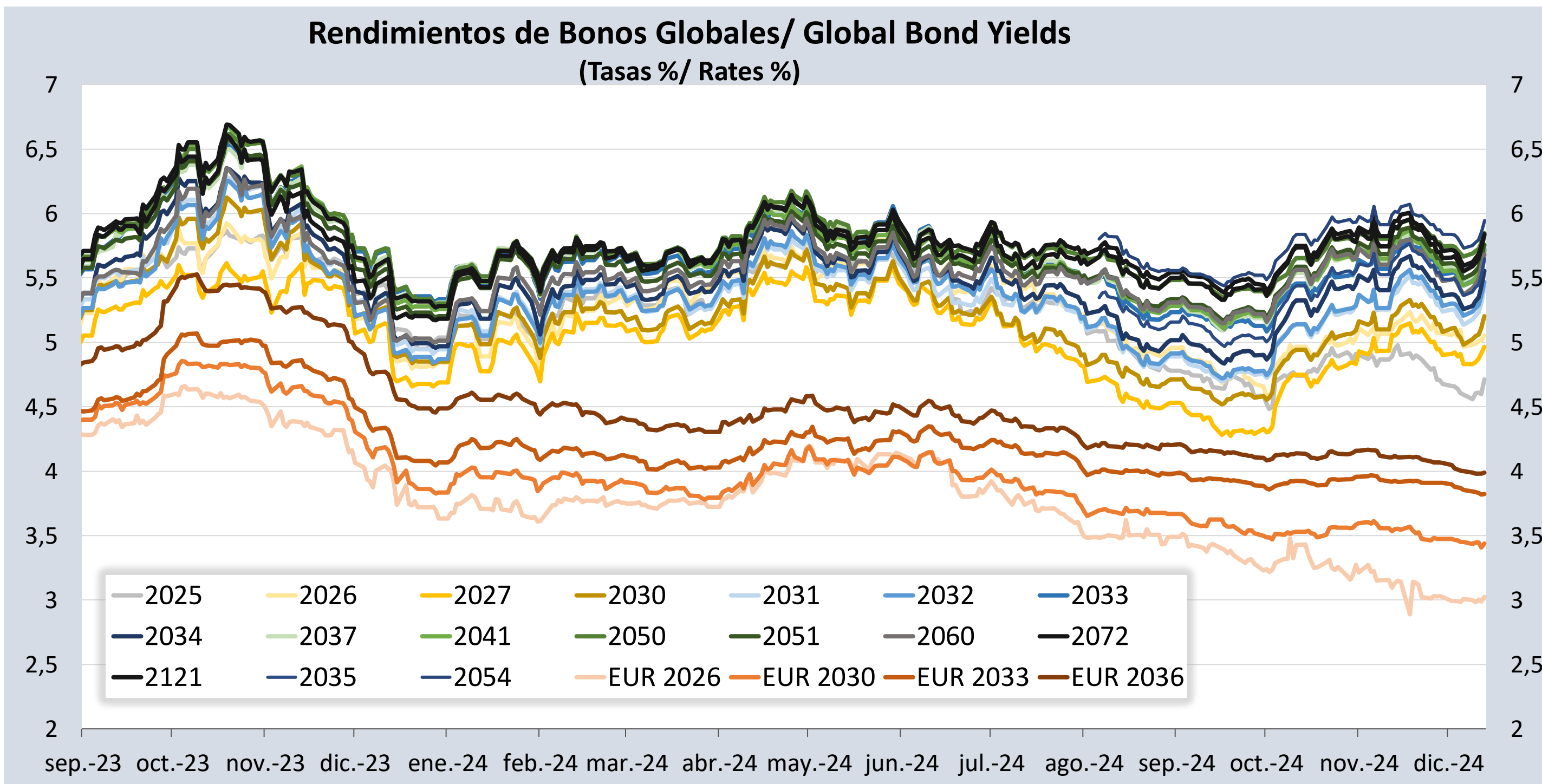
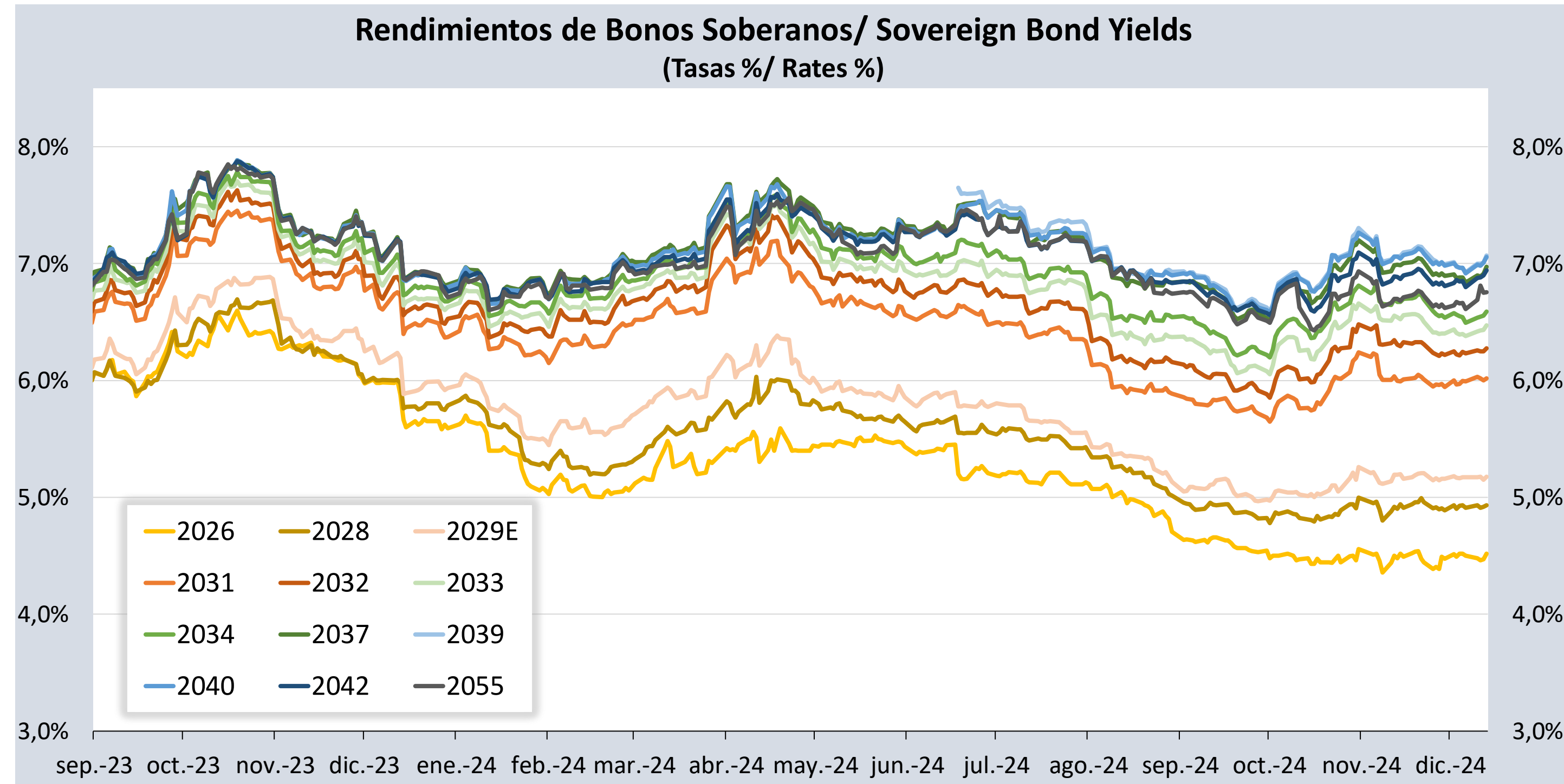
13/12/2024

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	2,74	3 937	8,200	105,7612	105,87	105,78	105,8222	4,53	4,46	4,52	4,5200	1	13-Dic-24	2	1,57	1,51	1,67
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,12	7 225	6,350	104,52	104,84	104,66	104,6700	4,97	4,88	4,93	4,9300	2	13-Dic-24	4	3,32	3,31	3,67
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,99	13 176	5,940	102,76	102,87	102,79	102,7743	5,18	5,15	5,17	5,1775	9	13-Dic-24	22	3,74	3,56	4,17
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,32	19 573	6,950	104,88	105,10	105,05	105,0697	6,05	6,01	6,02	6,0176	9	13-Dic-24	17	5,44	5,13	6,67
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,06	21 588	6,150	99,01	99,45	99,31	99,2634	6,32	6,25	6,27	6,2770	8	13-Dic-24	20	6,18	5,82	7,67
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,44	17 855	7,300	105,35	105,49	105,35	105,4752	6,49	6,47	6,49	6,4725	15	13-Dic-24	50	6,58	6,18	8,67
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,80	17 260	5,400	91,60	91,67	91,60	91,6590	6,60	6,59	6,60	6,5901	32	13-Dic-24	124	7,51	7,05	9,67
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,31	20 481	6,900	99,23	99,47	99,47	99,5188	7,01	6,98	6,98	6,9739	26	13-Dic-24	110	8,56	8,00	12,67
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,41	15 811	7,600	104,54	104,86	104,81	104,9659	7,12	7,08	7,09	7,0682	22	13-Dic-24	174	9,07	8,47	14,67
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,79	12 442	5,350	83,78	84,02	84,10	84,1357	7,10	7,07	7,06	7,0550	5	13-Dic-24	10	10,24	9,56	15,67
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,29	5 033	6,850	-	-	-	99,2429	-	-	-	6,9406	-	3-Dic-24	20	10,24	9,57	17,17
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,24	3 462	6,714	-	-	99,25	99,6159	-	-	6,79	6,7558	2	13-Dic-24	30	13,16	12,33	30,17
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,97	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2505	-	-	-	2,6070	-	18-Ago-23	20	4,86	4,74	5,17
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,71	911	7,39% + VAC	-	-	-	131,1709	-	-	-	3,6567	-	30-Oct-24	2	7,66	7,39	10,14
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,05	228	3,14%+VAC	-	-	-	90,1023	-	-	-	4,0001	-	10-Ago-23	50	12,02	11,56	15,17
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,28	649	3,83% + VAC	-	-	-	100,9202	-	-	-	3,7477	-	11-Oct-24	52	14,97	14,43	21,67
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,09	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	94,3384	-	-	-	3,5605	-	18-Oct-24	5	18,74	18,10	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).

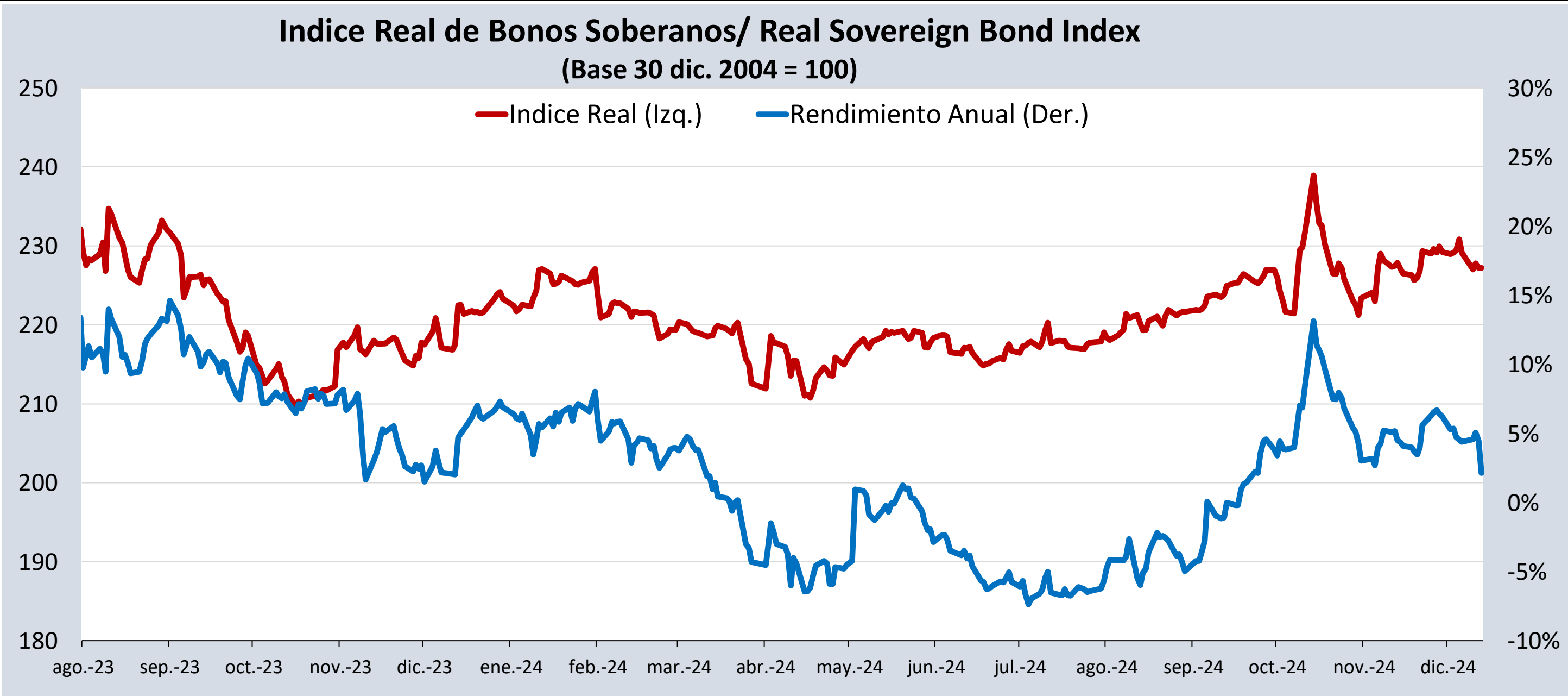
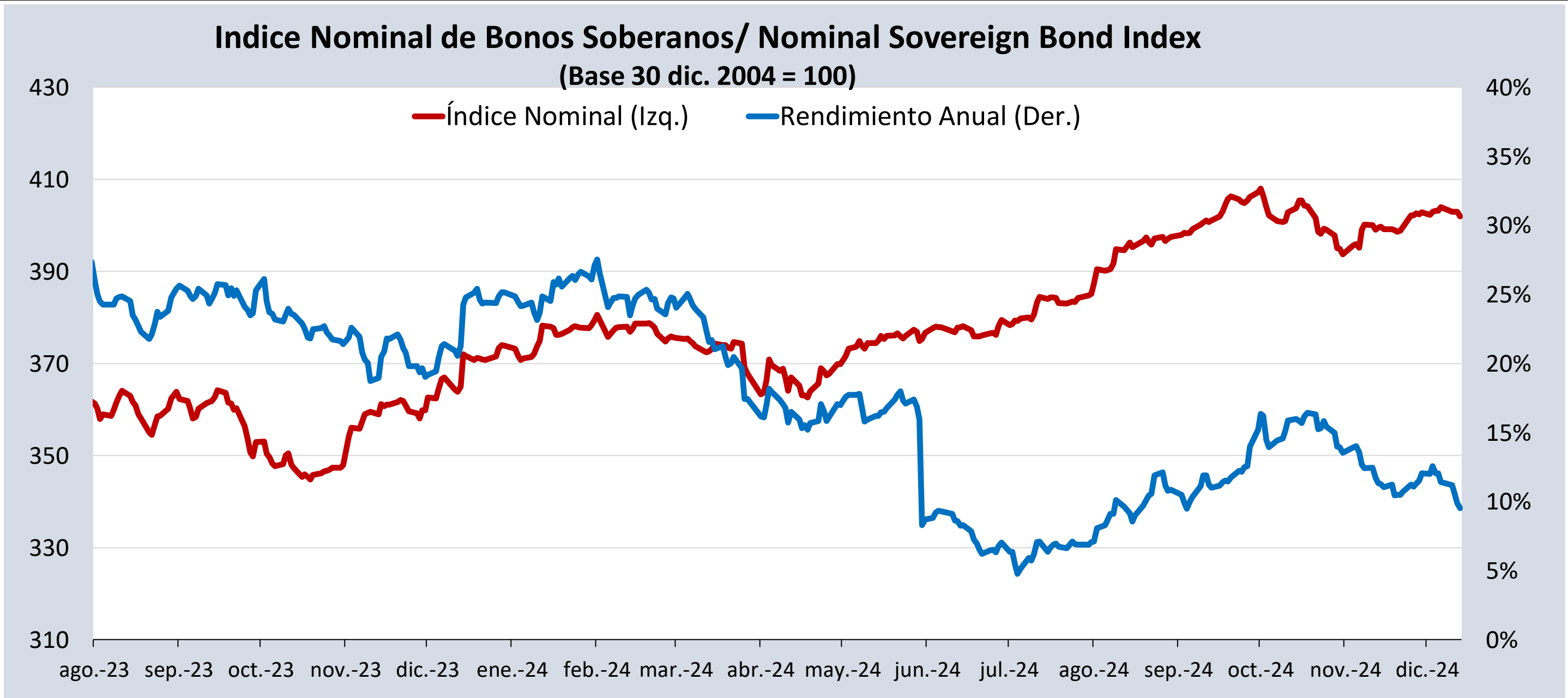
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	101,5290	-0,09	-0,12	-0,37	4,7120	11	12	63	0,59	0,57	0,61
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,1790	-0,02	-0,04	-0,48	5,0520	4	9	46	1,09	1,07	1,13
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,7000	-0,03	-0,01	-0,59	3,0220	3	1	54	1,11	1,09	1,15
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	97,8970	-0,13	-0,32	-0,43	4,9670	5	13	17	2,55	2,49	2,74
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	88,8220	-0,39	-0,95	-0,53	5,2030	9	22	12	5,04	4,91	5,60
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,4500	-0,15	0,06	-0,84	3,4390	3	-1	18	4,66	4,58	5,21
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,4350	-0,56	-1,33	-0,54	5,4230	12	29	11	5,55	5,40	6,20
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,9770	-0,58	-1,40	-0,46	5,4690	11	26	8	7,34	7,14	8,08
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,9520	-0,90	-2,23	-0,95	5,7200	11	28	12	6,61	6,43	9,07
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,1140	-0,01	0,23	-0,73	3,8230	0	-3	12	7,78	7,63	8,36
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,9530	-0,78	-1,88	-0,54	5,5570	13	30	9	7,77	7,56	9,22
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,9070	-0,92	-2,16	-0,55	5,6480	12	28	7	7,78	7,57	10,30
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,9550	-0,06	0,11	-0,71	3,9890	1	-1	9	10,51	10,30	12,10
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,0730	-0,82	-2,36	-0,73	5,7370	9	26	8	8,62	8,38	12,43
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,7460	-0,78	-2,34	-0,73	5,7060	9	27	8	11,90	11,57	16,48
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,0330	-0,99	-2,40	-0,35	5,8480	8	18	3	13,71	13,32	26,31
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,3000	-0,97	-2,82	-0,73	5,7580	9	26	7	15,17	14,74	26,62
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	99,0210	-1,19	-3,03	-0,64	5,9450	9	22	5	14,02	13,61	30,08
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,7580	-0,93	-3,18	-0,62	5,6800	9	31	6	18,14	17,64	36,49
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,2030	-0,98	-2,78	-0,75	5,8390	9	24	7	17,27	16,78	47,78
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,5660	-0,95	-2,82	-0,55	5,8310	10	28	6	17,45	16,96	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	402	-1	-2	9,53	-37	-188	2,65	4,79	8,57	13,05	13,58	11,96	9,84	12,94	10,63	6,64	3,17	2,19
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	2,12	-235	-229	2,34					36,39		6,20		19,79		35,27



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.