



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

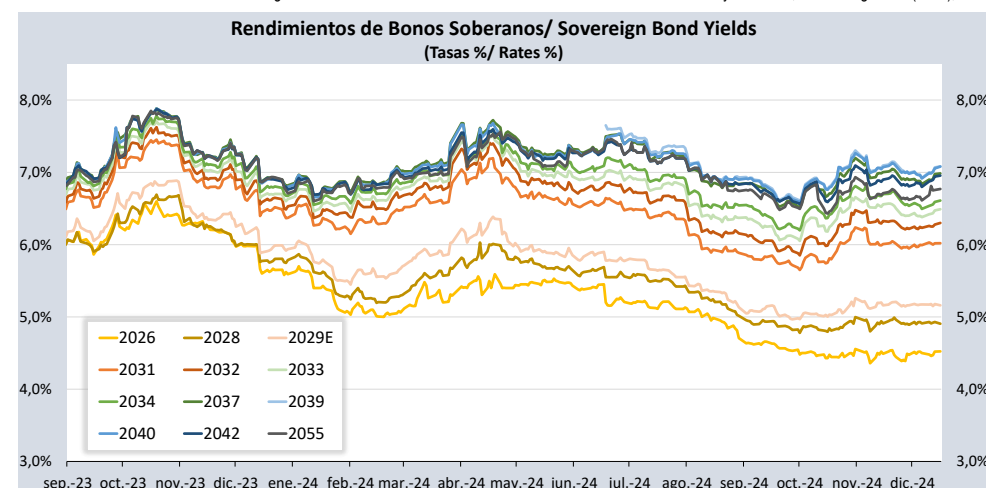
16/12/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

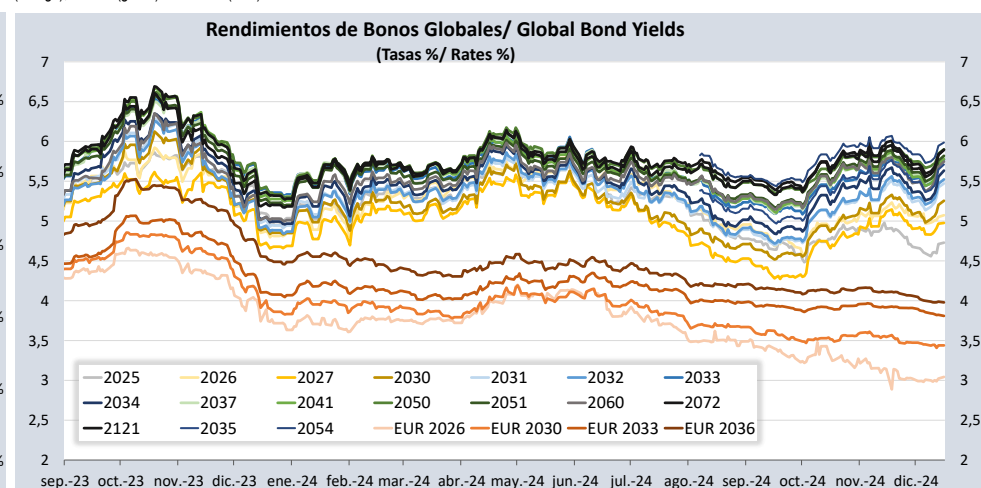
Bonos* / Bonds					Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	2,81	3 937	8,200	-	-	-	105,7914	-	-	-	4,5224	-	13-Dic-24	2	1,57	1,50	1,66	
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,17	7 225	6,350	-	-	-	104,7453	-	-	-	4,9050	-	13-Dic-24	4	3,31	3,31	3,66	
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,03	13 176	5,940	-	-	-	102,8351	-	-	-	5,1600	-	13-Dic-24	22	3,73	3,55	4,16	
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,38	19 573	6,950	104,99	105,18	105,05	105,0522	6,03	6,00	6,02	6,0200	9	16-Dic-24	4	5,43	5,12	6,66	
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,11	21 588	6,150	98,95	99,22	99,13	99,1293	6,33	6,29	6,30	6,3000	8	16-Dic-24	2	6,17	5,81	7,66	
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,50	17 855	7,300	-	-	-	105,3556	-	-	-	6,4900	-	16-Dic-24	0	6,57	6,17	8,66	
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,85	17 260	5,400	-	-	-	91,5338	-	-	-	6,6100	-	13-Dic-24	124	7,50	7,04	9,66	
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,36	20 481	6,900	99,23	99,39	99,43	99,4294	7,01	6,99	6,99	6,9850	26	16-Dic-24	35	8,55	7,99	12,66	
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,47	15 811	7,600	104,58	104,77	104,86	104,8318	7,11	7,09	7,08	7,0828	22	16-Dic-24	95	9,06	8,46	14,66	
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,83	12 442	5,350	-	-	-	83,9359	-	-	-	7,0800	-	13-Dic-24	10	10,22	9,55	15,66	
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,35	5 033	6,850	-	-	-	99,1022	-	-	-	6,9552	-	3-Dic-24	20	10,22	9,56	17,16	
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,30	3 462	6,714	-	-	-	99,4336	-	-	-	6,7704	-	13-Dic-24	30	13,14	12,31	30,16	
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,99	77	2,89%+VAC	-	-	-	100,5053	-	-	-	2,7614	-	18-Ago-23	20	4,85	4,72	5,16	
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,77	911	7,39% + VAC	-	-	-	129,1486	-	-	-	3,8612	-	30-Oct-24	2	7,63	7,35	10,13	
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,08	228	3,14%+VAC	-	-	-	87,7464	-	-	-	4,2279	-	10-Ago-23	50	11,96	11,47	15,16	
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,31	649	3,83% + VAC	-	-	-	97,3235	-	-	-	3,9975	-	11-Oct-24	52	14,82	14,25	21,66	
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,12	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	89,6494	-	-	-	3,8417	-	18-Oct-24	5	18,42	17,74	29,16	

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).

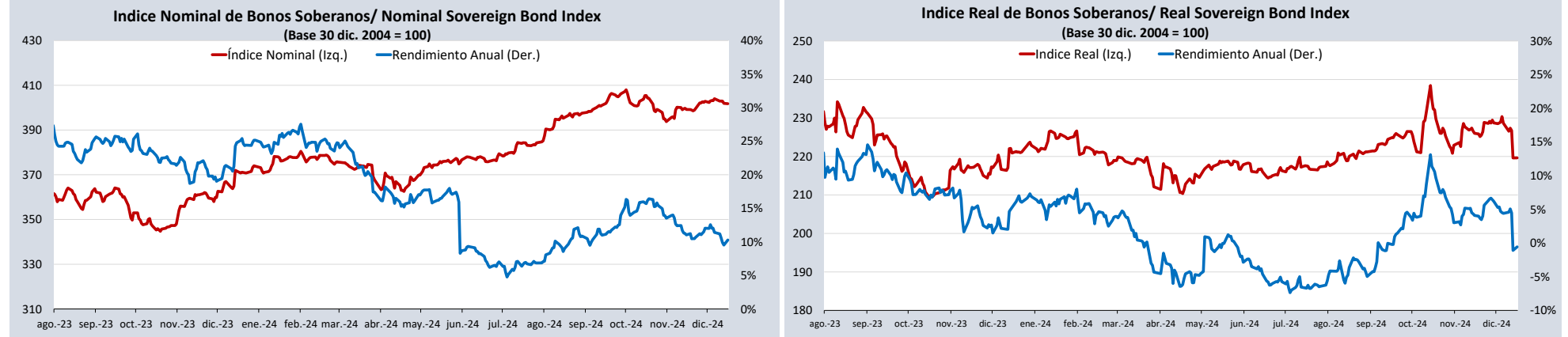


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.



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	101,5120	-0,02	-0,15	-0,37	4,7290	2	17	63	0,58	0,57	0,60	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,1630	-0,02	-0,05	-0,49	5,0740	2	9	47	1,08	1,06	1,12	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,6780	-0,02	-0,04	-0,61	3,0430	2	4	56	1,10	1,09	1,14	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	97,8750	-0,02	-0,35	-0,44	4,9770	1	15	18	2,54	2,48	2,73	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	88,5960	-0,23	-0,99	-0,54	5,2550	5	23	12	5,03	4,90	5,59	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	101,4470	0,00	-0,02	-0,81	3,4390	0	0	17	4,65	4,57	5,20	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,2090	-0,23	-1,35	-0,54	5,4720	5	29	12	5,54	5,39	6,19	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,6840	-0,29	-1,54	-0,50	5,5230	5	28	9	7,33	7,13	8,08	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,5460	-0,41	-2,35	-1,01	5,7720	5	29	13	6,60	6,41	9,06	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,2030	0,09	0,23	-0,67	3,8100	-1	-3	11	7,77	7,62	8,35	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,4790	-0,47	-2,20	-0,55	5,6340	8	35	9	7,75	7,54	9,21	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,4370	-0,47	-2,42	-0,51	5,7100	6	32	7	7,77	7,55	10,29	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,0390	0,08	0,10	-0,68	3,9790	-1	-1	8	10,50	10,29	12,09	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,4960	-0,58	-2,63	-0,95	5,8000	6	29	11	8,60	8,36	12,42	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,1290	-0,62	-2,67	-0,74	5,7770	7	30	9	11,87	11,53	16,47	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	96,3520	-0,68	-2,77	-0,42	5,9010	5	21	3	13,66	13,26	26,30	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	69,6490	-0,65	-3,08	-0,75	5,8200	6	29	7	15,11	14,68	26,61	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,4480	-0,57	-3,31	-0,65	5,9870	4	24	5	13,97	13,56	30,08	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,1030	-0,66	-3,30	-0,73	5,7470	7	33	8	18,02	17,52	36,48	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,5910	-0,61	-3,06	-0,75	5,8950	6	27	7	17,15	16,66	47,77	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	54,9490	-0,62	-3,03	-0,72	5,8950	6	31	8	17,25	16,76	98,02	

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	0	-2	10,28	76	-112	2,65	4,80	8,58	13,06	13,57	11,96	9,83	12,94	10,63	6,63	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	220	0	-9	-0,57	52	-498	2,40				37,01		6,24		19,72		34,63	



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.