



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

10/01/2025

Bonos soberanos / Sovereign bonds

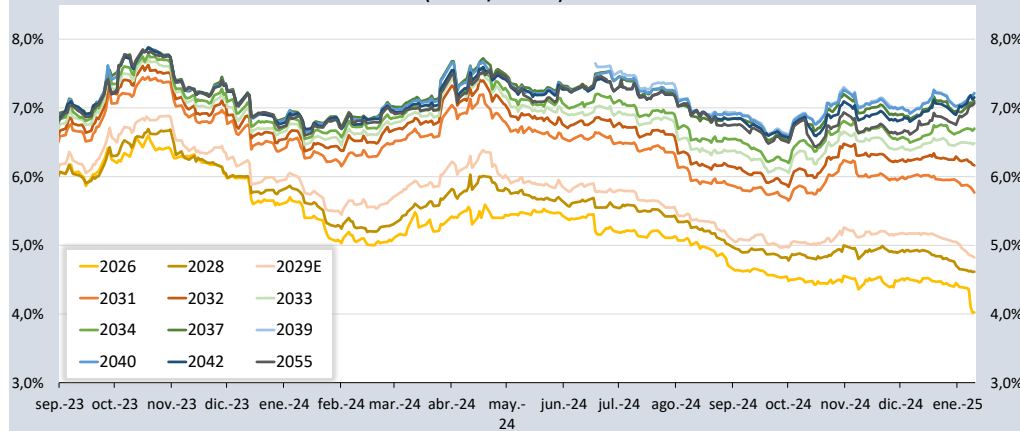
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones S./ / Millions PEN	Postura / Position			Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Postura / Position				Prom. ponderado / Weighted average (%)	Día / Date	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid			Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Compra / Bid		Venta / Ask	Última neg. / Last trading day							
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,34	3 937	8,200	-	-	-	106,3523	-	-	-	4,0228	-	9-Ene-25	2	1,50	1,44	1,59
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,59	7 225	6,350	105,57	105,64	105,64	105,6359	4,63	4,61	4,61	4,6153	6	10-Ene-25	24	3,24	3,31	3,59
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,42	13 176	5,940	103,97	104,10	104,04	104,0484	4,84	4,81	4,82	4,8220	5	10-Ene-25	10	3,67	3,50	4,09
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,83	19 573	6,950	106,33	106,38	106,33	106,4098	5,78	5,77	5,78	5,7669	73	10-Ene-25	362	5,37	5,08	6,59
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,51	21 588	6,150	99,79	99,91	99,79	99,9423	6,19	6,17	6,19	6,1636	19	10-Ene-25	104	6,11	5,76	7,59
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,98	20 608	7,300	105,20	105,53	105,53	105,3667	6,51	6,46	6,46	6,4847	35	10-Ene-25	271	6,50	6,10	8,59
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,20	17 560	5,400	90,75	91,14	91,07	91,0028	6,74	6,68	6,69	6,6991	10	10-Ene-25	140	7,42	6,96	9,59
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,81	20 481	6,900	98,48	98,60	98,52	98,5207	7,11	7,09	7,10	7,0990	31	10-Ene-25	223	8,46	7,90	12,59
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,96	15 811	7,600	103,32	103,59	103,50	103,6008	7,25	7,22	7,23	7,2187	35	10-Ene-25	488	8,95	8,35	14,59
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,18	12 442	5,350	82,66	82,86	82,78	82,9247	7,25	7,22	7,23	7,2104	6	10-Ene-25	46	10,11	9,43	15,59
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,79	5 033	6,850	-	-	-	97,2204	-	-	-	7,1534	-	3-Ene-25	9	10,08	9,41	17,09
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,74	3 537	6,714	-	-	-	95,8302	-	-	-	7,0679	-	13-Dic-24	30	12,79	11,94	30,09
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,19	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,8858	-	-	-	2,4714	-	18-Ago-23	20	4,79	4,67	5,09
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,27	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,0663	-	-	-	3,9580	-	17-Dic-24	2	7,55	7,26	10,06
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,29	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,4215	-	-	-	4,3638	-	10-Ago-23	50	11,85	11,36	15,09
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,57	649	3,83% + VAC	-	-	-	94,1406	-	-	-	4,2301	-	11-Oct-24	52	14,61	14,02	21,59
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,34	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	85,1916	-	-	-	4,1298	-	18-Oct-24	5	18,03	17,32	29,09

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).

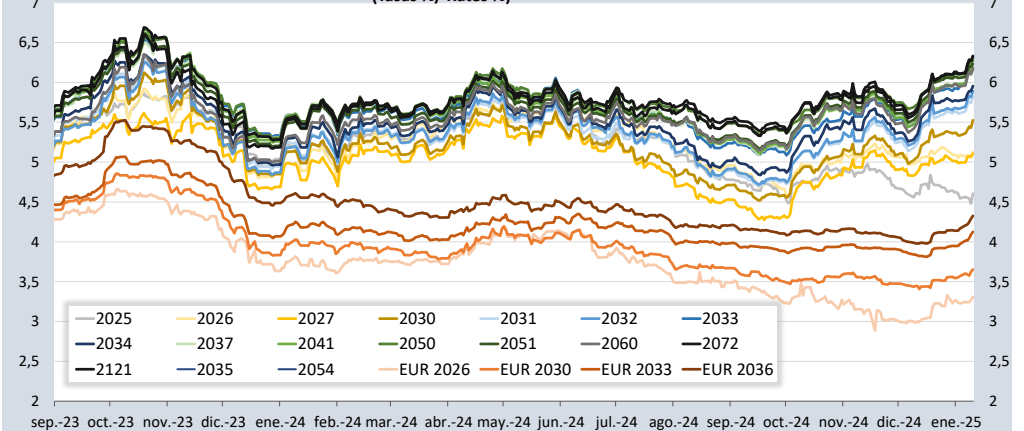
Rendimientos de Bonos Soberanos/ Sovereign Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)



Rendimientos de Bonos Globales/ Global Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)

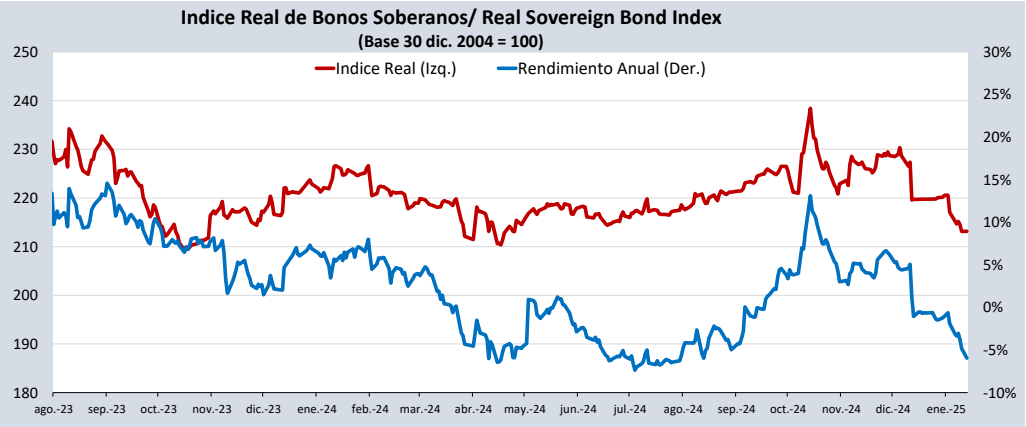
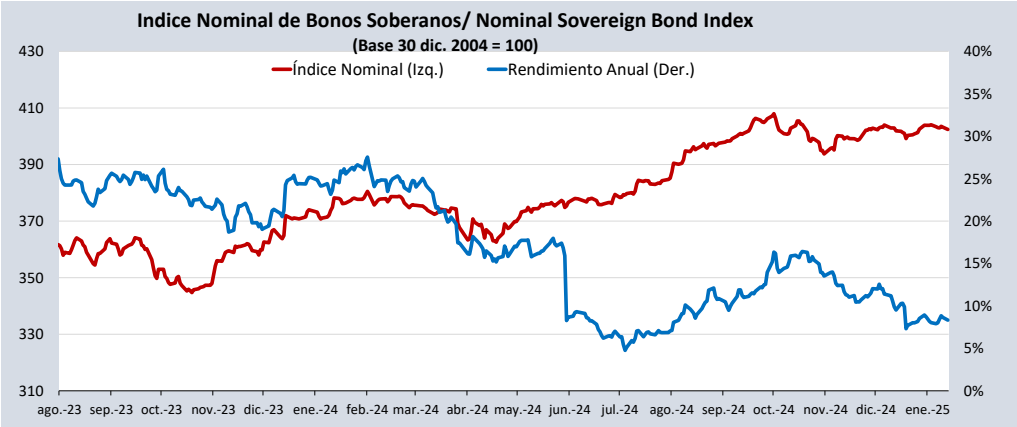


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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	101,3990	-0,09	-0,08	-0,34	4,6050	13	6	65	0,51	0,50	0,53	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,2950	-0,05	0,02	-0,38	5,1270	7	4	39	1,02	0,99	1,05	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,4350	-0,04	-0,07	-0,47	3,3080	4	8	47	1,04	1,02	1,07	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	97,6200	-0,08	-0,25	-0,54	5,1060	4	11	23	2,48	2,41	2,66	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	87,5520	-0,39	-0,79	-0,55	5,5260	9	19	13	5,04	4,91	5,52	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,4410	-0,14	-0,39	-0,65	3,6520	3	8	14	4,58	4,50	5,13	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	84,7330	-0,33	-0,91	-0,55	5,8220	8	21	12	5,47	5,31	6,12	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	74,8720	-0,39	-1,13	-0,52	5,8920	8	22	10	7,25	7,05	8,01	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,3700	-0,55	-1,70	-0,75	6,1720	7	22	10	6,50	6,30	8,99	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4290	-0,20	-0,89	-0,66	4,1250	3	15	11	7,70	7,54	8,28	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	79,6290	-0,37	-1,08	-0,57	5,9550	6	18	9	7,66	7,44	9,14	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	94,9700	-0,38	-1,35	-0,56	6,0490	5	19	8	7,66	7,44	10,23	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,3420	-0,28	-1,25	-0,67	4,3250	4	16	9	10,40	10,18	12,03	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	103,3940	-0,50	-1,51	-0,74	6,1480	6	17	9	8,47	8,22	12,35	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	70,7380	-0,32	-1,70	-0,61	6,1900	4	21	7	11,67	11,32	16,40	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,6810	-0,61	-2,17	-0,56	6,2790	5	18	5	13,28	12,88	26,23	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,6020	-0,36	-1,68	-0,69	6,2320	4	17	7	14,67	14,22	26,54	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	92,9780	-0,58	-2,55	-0,64	6,4070	5	20	5	13,48	13,06	30,01	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,2340	-0,58	-1,98	-0,65	6,1730	7	22	8	17,27	16,75	36,41	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,2930	-0,40	-2,06	-0,70	6,3180	4	21	7	16,20	15,71	47,70	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,1160	-0,55	-1,90	-0,52	6,3330	7	23	6	15,98	15,49	97,95	

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	-1	8,65	-19	62	2,61	4,73	8,49	12,94	13,39	13,51	9,91	12,56	10,29	6,41	3,05	2,11

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	213	-1	-4	-4,82	-105	-293	2,50				37,76		6,31		19,60		33,83	



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.