



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

17/01/2025

Bonos soberanos / Sovereign bonds

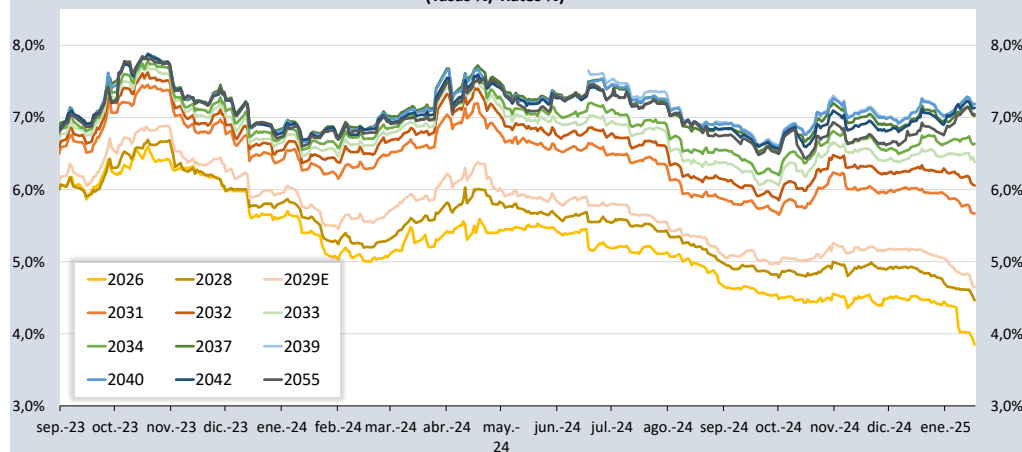
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses 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	3,52	3 937	8,200	106,4969	-	106,50	106,5506	3,85	-	3,85	3,8500	5	17-Ene-25	9	1,48	1,42	1,57
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,73	7 225	6,350	105,97	106,14	106,14	106,1208	4,50	4,45	4,45	4,4628	6	17-Ene-25	36	3,22	3,31	3,57
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,55	13 176	5,940	104,52	104,79	104,70	104,6862	4,69	4,62	4,64	4,6467	11	17-Ene-25	65	3,65	3,49	4,07
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,98	19 573	6,950	106,76	106,95	106,90	106,9333	5,70	5,67	5,68	5,6703	11	17-Ene-25	104	5,36	5,07	6,57
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,64	21 588	6,150	100,53	100,56	100,56	100,5822	6,07	6,06	6,06	6,0557	26	17-Ene-25	346	6,10	5,75	7,57
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,13	20 608	7,300	105,92	106,25	105,98	106,0274	6,40	6,35	6,39	6,3841	29	17-Ene-25	266	6,49	6,10	8,57
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,32	17 560	5,400	91,28	91,67	91,48	91,4360	6,66	6,60	6,63	6,6347	35	17-Ene-25	207	7,41	6,95	9,57
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,96	20 481	6,900	98,95	99,32	99,32	99,1568	7,05	7,00	7,00	7,0203	26	17-Ene-25	205	8,45	7,90	12,57
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	4,13	15 811	7,600	103,80	104,13	104,09	103,9719	7,20	7,16	7,17	7,1776	8	17-Ene-25	23	8,94	8,34	14,57
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,30	12 442	5,350	83,05	83,35	83,19	83,1022	7,20	7,16	7,18	7,1900	10	17-Ene-25	19	10,10	9,42	15,57
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,94	5 033	6,850	-	-	-	97,4167	-	-	-	7,1330	-	3-Ene-25	9	10,07	9,40	17,07
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,88	3 537	6,714	-	-	-	96,0741	-	-	-	7,0475	-	13-Dic-24	30	12,79	11,94	30,07
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,24	77	2,89%+VAC	-	-	-	102,2747	-	-	-	2,3893	-	18-Ago-23	20	4,77	4,66	5,07
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,41	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,6027	-	-	-	3,8975	-	17-Dic-24	2	7,54	7,26	10,04
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,35	228	3,14%+VAC	-	-	-	87,2447	-	-	-	4,2829	-	10-Ago-23	50	11,86	11,37	15,07
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,64	649	3,83% + VAC	-	-	-	96,0768	-	-	-	4,0880	-	11-Oct-24	52	14,68	14,10	21,57
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,40	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	88,6458	-	-	-	3,9059	-	18-Oct-24	5	18,26	17,58	29,07

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).

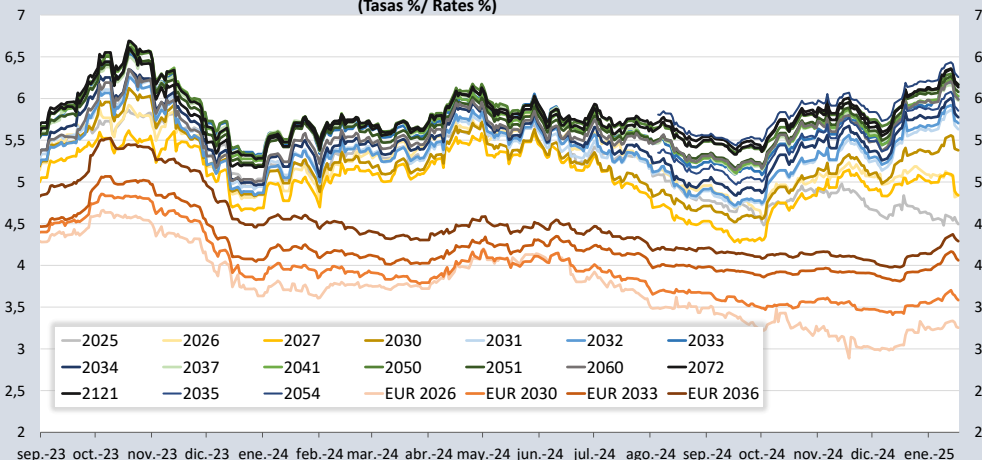
Rendimientos de Bonos Soberanos/ Sovereign Bond Yields

(Tasas % / Rates %)



Rendimientos de Bonos Globales/ Global Bond Yields

(Tasas % / Rates %)



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

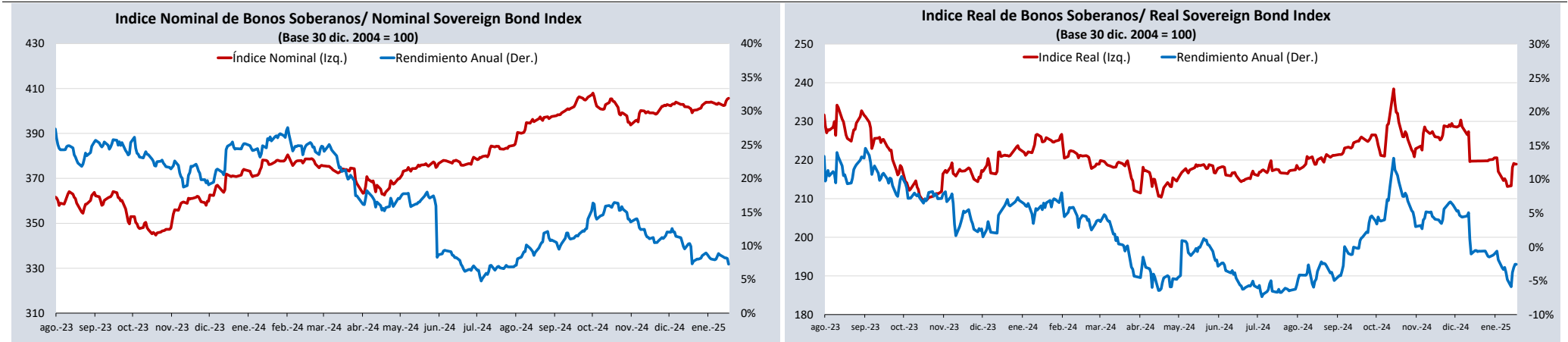
Bonos globales**** / Global bonds														
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- 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	101,3960	-0,01	0,00	-0,27	4,4950	-3	-11	54	0,49	0,48	0,51
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	97,6260	0,02	0,33	-0,45	4,8390	1	-29	47	1,00	0,98	1,03
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,5000	0,01	0,06	-0,47	3,2530	-1	-5	47	1,02	1,00	1,05
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,2710	0,04	0,65	-0,51	4,8410	-1	-27	21	2,46	2,40	2,64
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	88,2240	0,06	0,67	-0,53	5,3800	-1	-15	12	5,02	4,89	5,50
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,7600	0,11	0,32	-0,62	3,5830	-2	-7	13	4,56	4,48	5,11
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	85,6570	0,14	0,92	-0,56	5,6310	-2	-19	12	5,45	5,30	6,10
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,9310	0,15	1,06	-0,55	5,7040	-2	-19	10	7,24	7,04	7,99
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,7140	0,19	1,34	-0,83	5,9890	-3	-18	11	6,49	6,31	8,97
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,8510	0,14	0,42	-0,72	4,0610	-2	-6	12	7,68	7,52	8,26
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	80,7620	0,15	1,13	-0,61	5,7750	-2	-18	10	7,80	7,58	9,13
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	96,4020	0,24	1,43	-0,57	5,8530	-3	-20	8	7,66	7,45	10,21
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,6490	0,14	0,31	-0,74	4,2900	-2	-4	9	10,38	10,16	12,01
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	104,8940	0,17	1,50	-0,83	5,9760	-2	-17	9	8,48	8,24	12,33
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	72,1060	0,19	1,37	-0,69	6,0270	-2	-16	8	11,70	11,36	16,38
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	93,0040	0,22	1,32	-0,56	6,1690	-2	-11	5	13,35	12,95	26,21
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	67,0940	0,23	1,49	-0,72	6,0790	-2	-15	7	14,79	14,35	26,52
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	94,8920	0,34	1,91	-0,69	6,2560	-3	-15	5	13,61	13,20	29,99
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,8920	0,28	1,66	-0,66	5,9870	-3	-19	7	17,55	17,04	36,39
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	60,8050	0,24	1,51	-0,71	6,1640	-2	-15	7	16,99	16,48	47,68
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,7880	0,26	1,67	-0,59	6,1350	-3	-20	7	16,49	16,00	97,93

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	406	0	2	7,27	-84	-139	2,61	4,73	8,50	12,94	13,40	13,53	9,90	12,58	10,28	6,39	3,04	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	219	0	6	-2,58	-2	224	2,46				37,18		6,25		19,61		34,50	
---	-----	---	---	-------	----	-----	------	--	--	--	-------	--	------	--	-------	--	-------	--



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.