



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

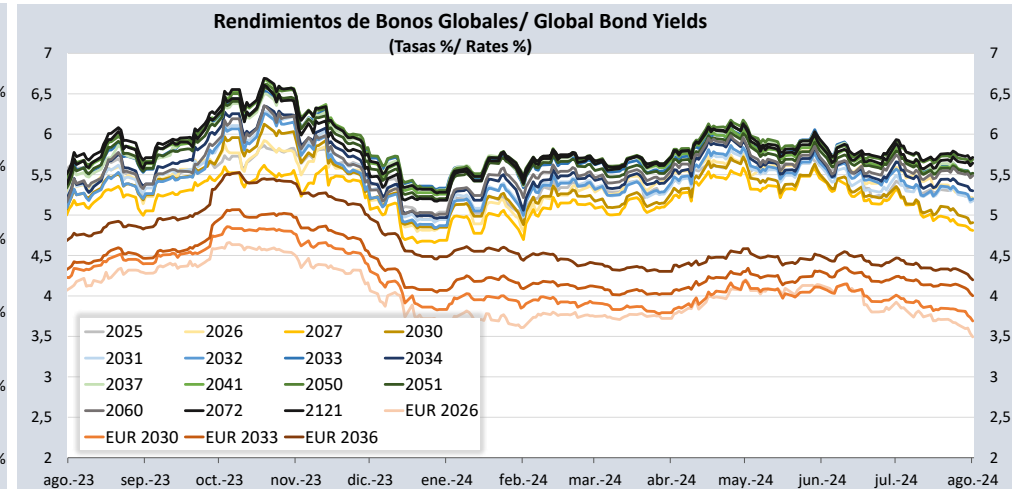
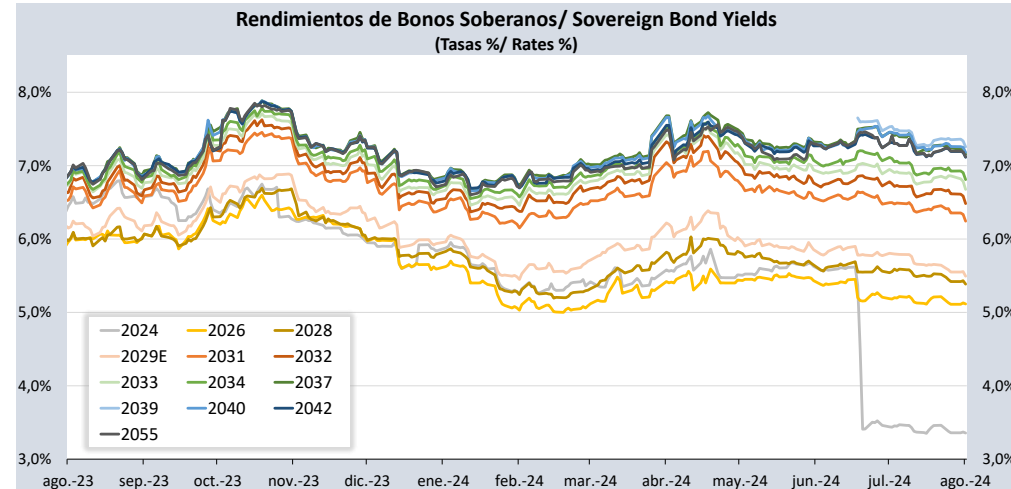
01/08/2024

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 / Modified	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			
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,68	1 048	5,700	-	-	-	100,0686	-	-	-	3,3553	-	20-Jun-24	150	0,03	0,03	0,03
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,85	3 937	8,200	105,65	106,23	105,81	105,8587	5,20	4,90	5,12	5,1154	10	1-Ago-24	19	1,87	1,78	2,03
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,98	7 225	6,350	103,32	103,65	103,39	103,4227	5,41	5,32	5,39	5,3850	4	1-Ago-24	8	3,58	3,39	4,03
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,79	13 176	5,940	101,65	101,79	101,73	101,7215	5,51	5,48	5,49	5,4940	7	1-Ago-24	14	4,00	3,79	4,53
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,26	18 748	6,950	103,88	104,06	104,12	103,9970	6,26	6,23	6,22	6,2431	57	1-Ago-24	261	5,62	5,29	7,03
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,89	20 617	6,150	97,85	98,24	98,12	97,9873	6,51	6,44	6,46	6,4819	23	1-Ago-24	73	6,34	5,96	8,03
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,43	17 180	7,300	104,02	104,56	104,35	104,2609	6,71	6,63	6,66	6,6744	67	1-Ago-24	224	6,70	6,28	9,03
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,54	16 635	5,400	89,64	90,30	90,10	89,9581	6,86	6,76	6,79	6,8101	30	1-Ago-24	281	7,63	7,15	10,03
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,24	19 580	6,900	97,70	98,58	98,22	98,0297	7,20	7,09	7,13	7,1534	12	1-Ago-24	105	8,60	8,02	13,03
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,64	15 436	7,600	102,79	103,79	103,43	103,2929	7,31	7,20	7,24	7,2549	29	1-Ago-24	240	9,39	8,76	15,03
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,51	11 168	5,350	82,46	83,48	82,91	82,8948	7,24	7,11	7,18	7,1804	8	1-Ago-24	145	10,24	9,56	16,03
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,22	5 033	6,850	-	-	-	97,5510	-	-	-	7,1134	-	19-Jul-24	1	10,19	9,51	17,53
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,15	3 462	6,714	-	-	-	95,2025	-	-	-	7,1185	-	12-Jul-24	15	12,74	11,89	30,53
13-Oct-24	PEP01000C89	SB13OCT24	2,06	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,1310	-	-	-	1,1198	-	31-Oct-22	2	0,20	0,20	0,20
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,36	77	2,89%+VAC	-	-	-	98,0040	-	-	-	3,2637	-	18-Ago-23	20	5,15	4,99	5,53
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,02	911	7,39% + VAC	-	-	-	125,6265	-	-	-	4,3083	-	10-Jun-22	10	7,96	7,63	10,50
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,48	228	3,14%+VAC	-	-	-	83,2553	-	-	-	4,6536	-	10-Ago-23	50	12,01	11,47	15,53
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,80	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,7995	-	-	-	4,5536	-	21-Jul-22	2	14,56	13,93	22,03
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,53	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,9578	-	-	-	4,5565	-	12-Ago-21	10	17,64	16,87	29,53

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	102,0240	0,02	0,10	-0,45	5,1800	-3	-14	48	0,95	0,93	0,98
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,0430	0,02	0,14	-0,48	5,2130	-1	-7	36	1,46	1,42	1,50
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9290	0,07	0,26	-0,53	3,4940	-4	-17	37	1,48	1,45	1,52
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,0660	0,03	0,28	-0,48	4,8100	-1	-10	17	2,86	2,79	3,11
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,5650	-0,03	0,68	-0,56	4,9070	1	-14	12	5,41	5,28	5,97
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2820	0,21	0,72	-0,63	3,6900	-4	-15	13	5,02	4,93	5,58
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,9770	-0,08	0,69	-0,50	5,1760	2	-13	10	5,92	5,77	6,57
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,6540	-0,09	0,76	-0,56	5,2010	2	-13	10	7,63	7,43	8,46
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,2710	-0,12	0,76	-1,00	5,5160	1	-10	12	6,77	6,58	9,44
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,3060	0,21	0,94	-0,94	4,0020	-3	-14	15	8,08	7,92	8,73
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,0650	0,04	0,85	-0,60	5,3010	-1	-13	9	8,15	7,94	9,59
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7440	0,23	1,15	-0,81	4,1990	-3	-14	10	10,72	10,50	12,48
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,3400	-0,21	0,92	-0,90	5,5120	2	-10	9	8,77	8,53	12,80
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,1190	-0,17	0,87	-0,72	5,5130	2	-10	8	12,07	11,74	16,85
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,1190	-0,48	0,61	-0,49	5,6890	4	-5	4	13,82	13,44	26,68
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,7110	-0,21	0,82	-0,72	5,5180	2	-7	7	15,38	14,97	26,99
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,5520	-0,30	0,73	-0,67	5,4880	3	-7	6	18,38	17,89	36,86
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,5670	-0,23	0,71	-0,74	5,7130	2	-6	6	17,91	17,42	48,15
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,4380	-0,34	0,47	-0,60	5,6420	3	-5	6	18,40	17,89	98,40

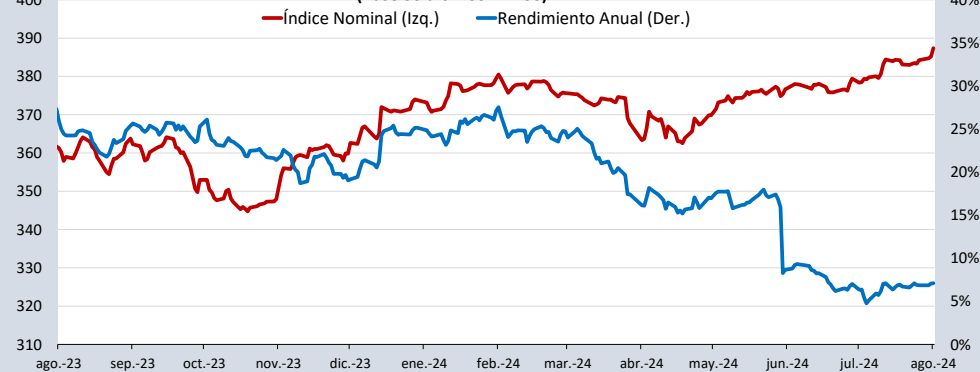
Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index

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	387	2	4	7,11	4	21	2,80	4,98	8,92	13,02	13,46	11,98	9,96	12,84	10,39	6,18	3,28	2,20

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	13-Oct-24	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	2	-4,46	118	203	29,85	2,50	38,54	6,32	12,70	10,09

Índice Nominal de Bonos Soberanos/ Nominal Sovereign Bond Index

(Base 30 dic. 2004 = 100)



Índice Real de Bonos Soberanos/ Real Sovereign Bond Index

(Base 30 dic. 2004 = 100)

