



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

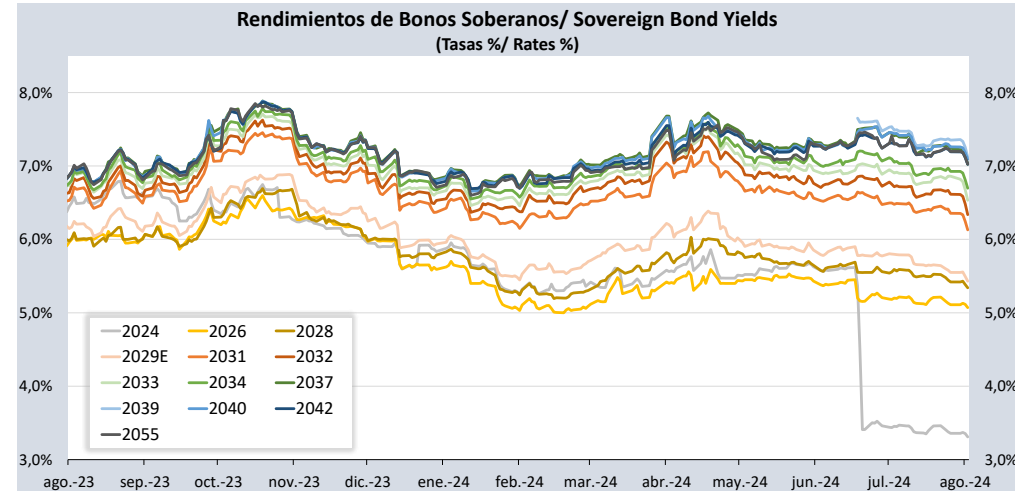
02/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

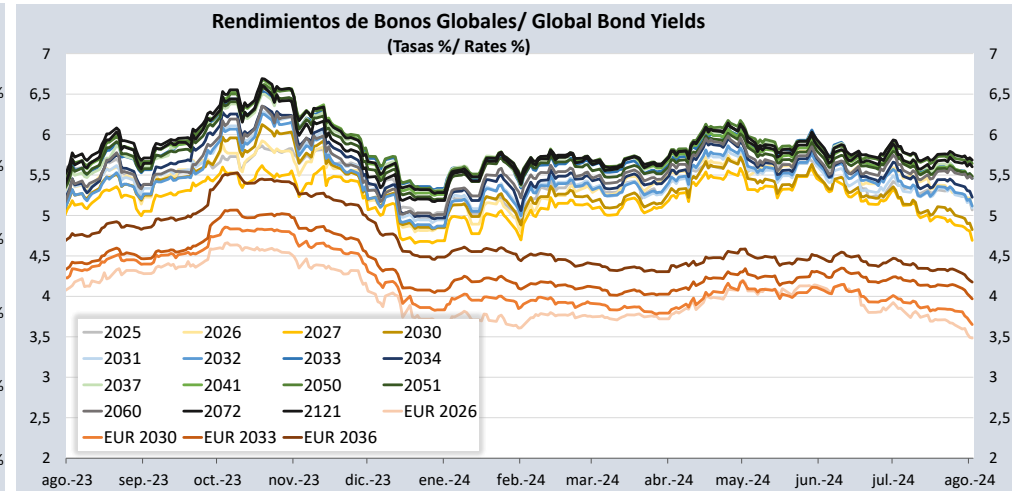
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)		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)
				Cupón / Coupon (%)		Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,69	1 048	5,700	-	-	-	100,0636	-	-	-	3,3099	-	20-Jun-24	150	0,03	0,03	0,03
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,87	3 937	8,200	105,78	105,93	105,90	105,9401	5,13	5,05	5,07	5,0700	1	2-Ago-24	2	1,87	1,78	2,03
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,00	7 225	6,350	103,43	103,75	103,61	103,5834	5,38	5,29	5,33	5,3400	5	2-Ago-24	30	3,57	3,39	4,03
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,81	13 176	5,940	101,77	102,13	102,01	101,9707	5,48	5,39	5,42	5,4309	8	2-Ago-24	27	3,99	3,79	4,53
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,28	18 748	6,950	104,12	105,06	104,75	104,6424	6,22	6,06	6,11	6,1295	24	2-Ago-24	50	5,62	5,29	7,03
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,91	20 617	6,150	98,55	99,03	98,94	98,8680	6,39	6,31	6,32	6,3363	45	2-Ago-24	265	6,35	5,97	8,03
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,45	17 180	7,300	104,76	105,31	105,24	105,2258	6,60	6,52	6,53	6,5325	41	2-Ago-24	148	6,71	6,30	9,03
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,55	16 635	5,400	90,64	90,90	90,77	90,7077	6,71	6,67	6,69	6,6976	21	2-Ago-24	215	7,64	7,16	10,03
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,26	19 580	6,900	98,47	99,54	99,29	99,0867	7,10	6,97	7,00	7,0243	20	2-Ago-24	132	8,62	8,06	13,03
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,66	15 436	7,600	104,81	104,99	104,90	104,5138	7,09	7,07	7,08	7,1218	71	2-Ago-24	551	9,42	8,80	15,03
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,53	11 168	5,350	83,20	83,90	83,65	83,6496	7,15	7,06	7,09	7,0887	9	2-Ago-24	49	10,27	9,59	16,03
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,24	5 033	6,850	-	-	-	98,4360	-	-	-	7,0217	-	19-Jul-24	1	10,22	9,55	17,53
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,17	3 462	6,714	-	-	-	96,2856	-	-	-	7,0268	-	12-Jul-24	15	12,83	11,98	30,53
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,07	884	6,84%+VAC	-	-	-	101,1261	-	-	-	1,0678	-	31-Oct-22	2	0,20	0,20	0,20
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,37	77	2,89%+VAC	-	-	-	98,4477	-	-	-	3,1746	-	18-Ago-23	20	5,15	4,99	5,53
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,04	911	7,39%+VAC	-	-	-	126,7804	-	-	-	4,1881	-	10-Jun-22	10	7,97	7,65	10,50
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,48	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,4095	-	-	-	4,5361	-	10-Ago-23	50	12,04	11,51	15,53
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,81	424	3,83%+VAC	-	-	-	91,0532	-	-	-	4,4563	-	21-Jul-22	2	14,62	14,00	22,03
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,54	383	3,26%+VAC	-	-	-	80,2975	-	-	-	4,4591	-	12-Ago-21	10	17,75	16,99	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.



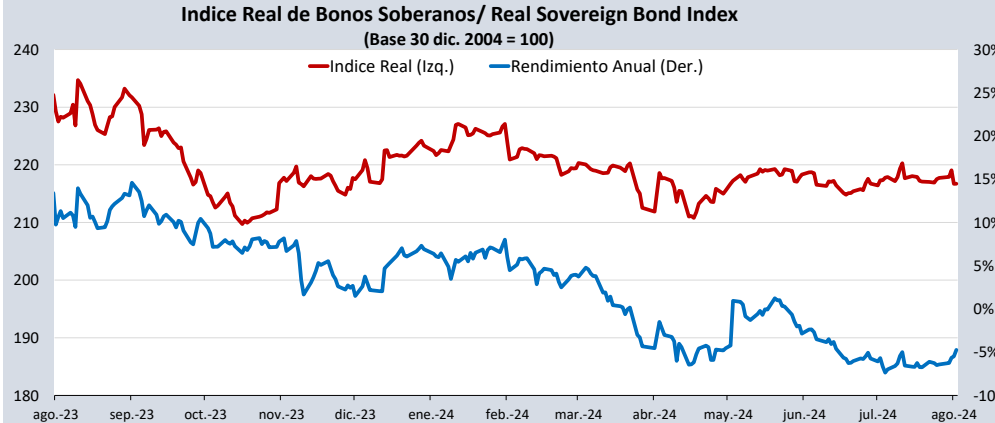
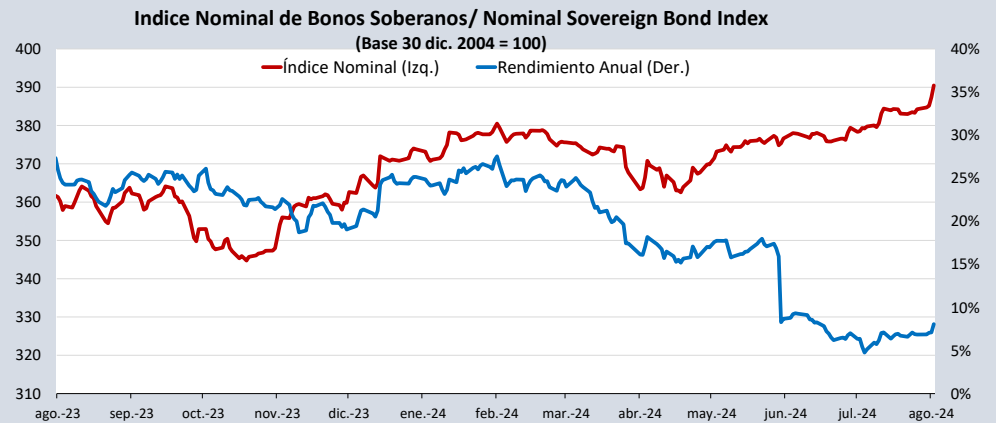
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,1110	0,09	0,17	-0,43	5,0680	-11	-21	45	0,95	0,93	0,98
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,2020	0,16	0,27	-0,49	5,1120	-10	-17	36	1,46	1,42	1,50
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9450	0,02	0,24	-0,54	3,4840	-1	-16	39	1,47	1,45	1,52
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,4020	0,34	0,54	-0,49	4,6920	-12	-19	18	2,86	2,79	3,11
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,9650	0,40	0,87	-0,53	4,8250	-8	-18	11	5,41	5,28	5,97
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,4670	0,19	0,82	-0,64	3,6520	-4	15	13	5,02	4,93	5,58
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,4050	0,43	0,84	-0,52	5,0930	-8	-16	10	5,92	5,77	6,57
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,1610	0,51	1,01	-0,53	5,1170	-8	-17	9	7,63	7,44	8,45
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,7430	0,47	0,83	-1,09	5,4570	-6	-11	13	6,77	6,59	9,44
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,5140	0,21	1,10	-0,96	3,9690	-3	-17	15	8,08	7,92	8,73
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,5740	0,51	1,11	-0,60	5,2250	-8	-17	9	8,15	7,94	9,59
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,3750	0,15	0,00	0,00	5,3280	-2	0	0	7,97	7,76	10,67
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,9310	0,19	1,25	-0,80	4,1770	-2	-15	10	10,72	10,50	12,47
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,8030	0,46	1,01	-0,83	5,4630	-5	-11	8	8,77	8,54	12,80
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,3940	0,28	0,83	-0,75	5,4840	-3	-9	8	12,07	11,75	16,85
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,7690	0,65	0,86	-0,62	5,6410	-5	-6	8	13,86	13,48	26,68
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,1210	0,41	0,90	-0,73	5,4820	-4	-8	4	15,41	15,00	26,99
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,6000	0,49	0,00	0,00	5,8320	-4	0	0	14,09	13,69	30,45
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,8910	0,34	0,72	-0,65	5,4560	-3	-7	7	18,43	17,94	36,86
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,8890	0,32	0,72	-0,77	5,6850	-3	-6	0	17,97	17,48	48,14
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,8610	0,42	0,62	-0,69	5,6020	-4	-6	6	18,52	18,02	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	390	3	6	8,07	96	121	2,78	4,95	8,87	13,00	13,48	11,99	9,96	12,87	10,43	6,18	3,29	2,21

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	217	0	-1	-4,74	75	168	30,18	2,52	37,86	6,39	12,85	10,20



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.