



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

05/08/2024

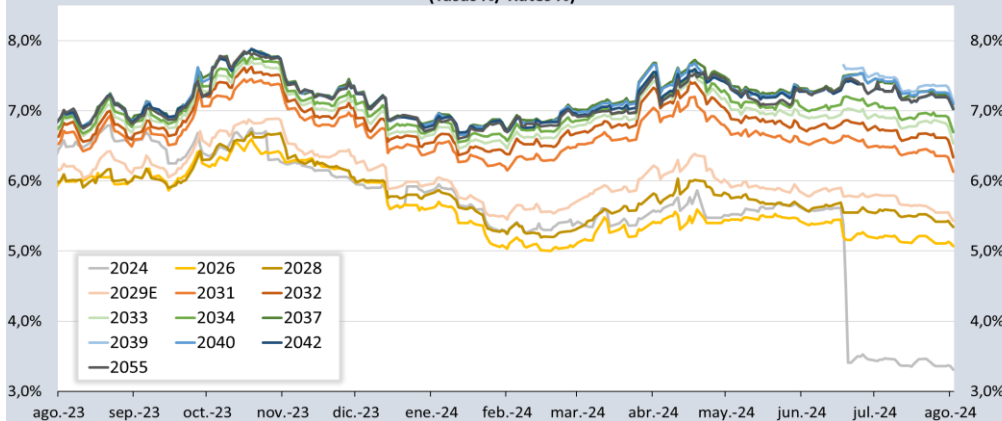
Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price			Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Rendimiento / Yield			Nº 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 (%)			Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day		Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day		Compra / Bid	Venta / Ask				Día / Date
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,74	1 048	5,700	-	-	-	100,0445	-	-	-	3,3099	-	20-Jun-24	150	0,02	0,02	0,03
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,94	3 937	8,200	-	-	-	105,9178	-	-	-	5,0700	-	2-Ago-24	2	1,86	1,77	2,03
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,05	7 225	6,350	103,35	103,68	103,57	103,5773	5,40	5,31	5,34	5,3400	5	5-Ago-24	10	3,57	3,39	4,03
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,86	13 176	5,940	-	-	-	101,9914	-	-	-	5,4250	-	2-Ago-24	27	3,99	3,78	4,53
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,34	18 748	6,950	104,35	104,92	104,74	104,5685	6,18	6,08	6,11	6,1418	21	5-Ago-24	51	5,61	5,29	7,03
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,96	20 617	6,150	98,55	99,03	98,79	98,7074	6,39	6,31	6,35	6,3630	27	5-Ago-24	293	6,34	5,96	8,03
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,51	17 180	7,300	104,73	105,37	105,10	105,0132	6,61	6,51	6,55	6,5632	14	5-Ago-24	50	6,70	6,29	9,03
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,60	16 635	5,400	89,95	90,44	90,49	90,3852	6,81	6,74	6,73	6,7469	39	5-Ago-24	140	7,63	7,15	10,03
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,32	19 580	6,900	98,63	99,62	99,04	98,9848	7,08	6,96	7,03	7,0368	10	5-Ago-24	196	8,61	8,04	13,03
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,72	15 436	7,600	104,43	104,71	104,59	104,4419	7,13	7,10	7,11	7,1294	28	5-Ago-24	358	9,41	8,79	15,03
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,57	11 168	5,350	83,16	83,57	83,40	83,3556	7,15	7,10	7,12	7,1250	2	5-Ago-24	4	10,25	9,57	16,03
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,29	5 033	6,850	-	-	-	98,0856	-	-	-	7,0580	-	19-Jul-24	1	10,20	9,53	17,53
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,23	3 462	6,714	-	-	-	95,8556	-	-	-	7,0631	-	12-Jul-24	15	12,78	11,94	30,53
13-Oct-24	PEP01000C89	SB13OCT24	2,13	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,0821	-	-	-	1,0529	-	31-Oct-22	2	0,19	0,19	0,20
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,39	77	2,89%+VAC	-	-	-	98,5186	-	-	-	3,1608	-	18-Ago-23	20	5,14	4,99	5,53
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,10	911	7,39% + VAC	-	-	-	126,5002	-	-	-	4,2153	-	10-Jun-22	10	7,96	7,64	10,50
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,51	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,3561	-	-	-	4,5421	-	10-Ago-23	50	12,03	11,50	15,53
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,84	424	3,83% + VAC	-	-	-	90,7960	-	-	-	4,4763	-	21-Jul-22	2	14,60	13,97	22,03
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,57	383	3,26%+VAC	-	-	-	80,0215	-	-	-	4,4792	-	12-Ago-21	10	17,72	16,96	29,53

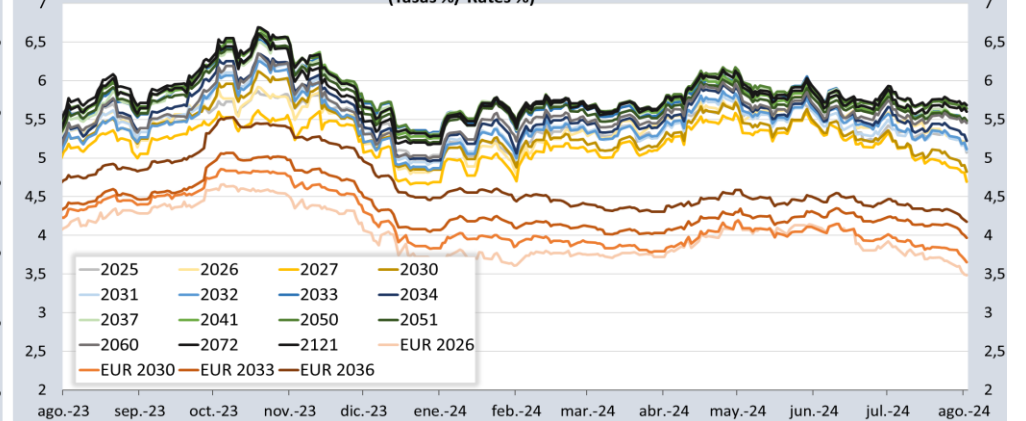
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).

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).

Rendimientos de Bonos Soberanos/ Sovereign Bond Yields (Tasas % / Rates %)



Rendimientos de Bonos Globales/ Global Bond Yields (Tasas % / Rates %)



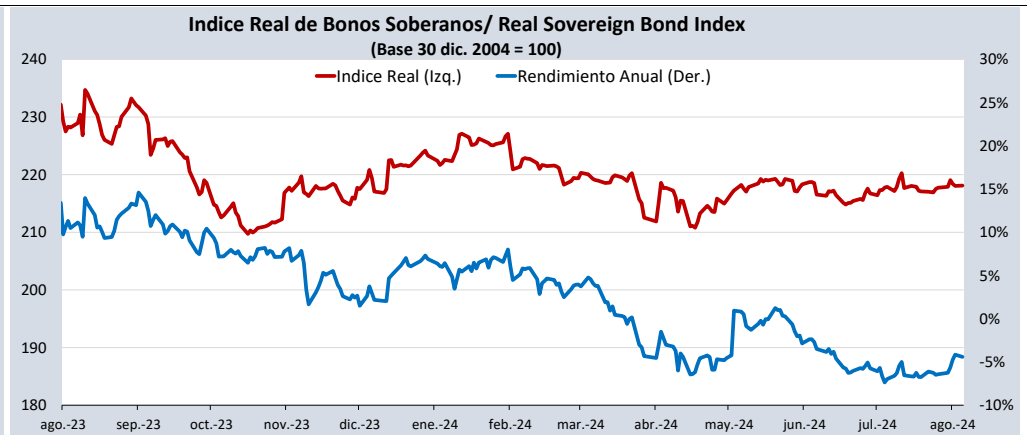
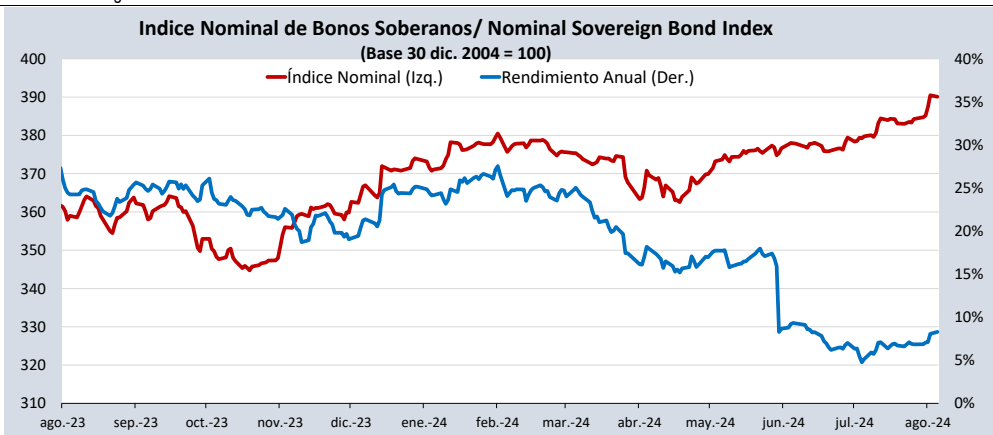
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,0840	-0,03	0,10	-0,46	5,0910	2	-14	49	0,94	0,92	0,97
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,2010	0,00	0,24	-0,51	5,1180	1	-15	37	1,45	1,41	1,49
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9360	-0,01	0,16	-0,43	3,4910	1	-11	30	1,47	1,44	1,51
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,3690	-0,03	0,46	-0,46	4,7040	1	-16	16	2,85	2,78	3,10
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,8370	-0,13	0,61	-0,55	4,8530	3	-12	12	5,40	5,27	5,96
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3040	-0,16	0,62	-0,56	3,6850	3	-13	11	5,01	4,92	5,57
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,2740	-0,13	0,60	-0,52	5,1200	3	-12	10	5,91	5,76	6,56
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,0740	-0,09	0,82	-0,52	5,1330	2	-14	9	7,62	7,43	8,44
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,6100	-0,13	0,63	-0,86	5,4730	2	-8	10	6,76	6,58	9,43
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,3590	-0,16	0,68	-0,97	3,9950	3	-10	15	8,07	7,91	8,72
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,5040	-0,07	0,86	-0,64	5,2370	1	-13	10	8,14	7,93	9,58
02-ago-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,3750	0,00	0,00	0,00	5,3280	0	0	0	8,24	8,02	11,17
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,6980	-0,23	0,66	-0,79	4,2060	3	-8	10	10,71	10,49	12,46
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,7880	-0,02	0,67	-0,90	5,4650	0	-7	9	8,76	8,53	12,79
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,3100	-0,08	0,47	-0,73	5,4930	1	-5	8	12,06	11,74	16,84
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,6070	-0,16	0,48	-0,74	5,6530	1	-4	5	13,84	13,46	26,67
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,8160	-0,30	0,30	-0,77	5,5090	3	-3	7	15,38	14,96	26,98
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,6000	0,00	0,00	0,00	5,8320	0	0	0	14,08	13,68	30,44
01-dic-60	US715638DC26	2 000	2,780	57,5480	-0,34	0,16	-0,67	5,4890	3	-1	6	18,37	17,88	36,85
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,5330	-0,36	0,11	-0,74	5,7160	3	-1	6	17,90	17,40	48,14
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,4080	-0,45	0,01	-0,66	5,6450	4	0	6	18,38	17,87	98,39

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	0	6	8,30	23	144	2,78	4,95	8,88	13,01	13,48	11,99	9,94	12,88	10,44	6,17	3,28	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	218	0	0	-4,41	-26	201	29,98	2,52	37,89	6,43	12,91	10,27



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.