



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

07/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

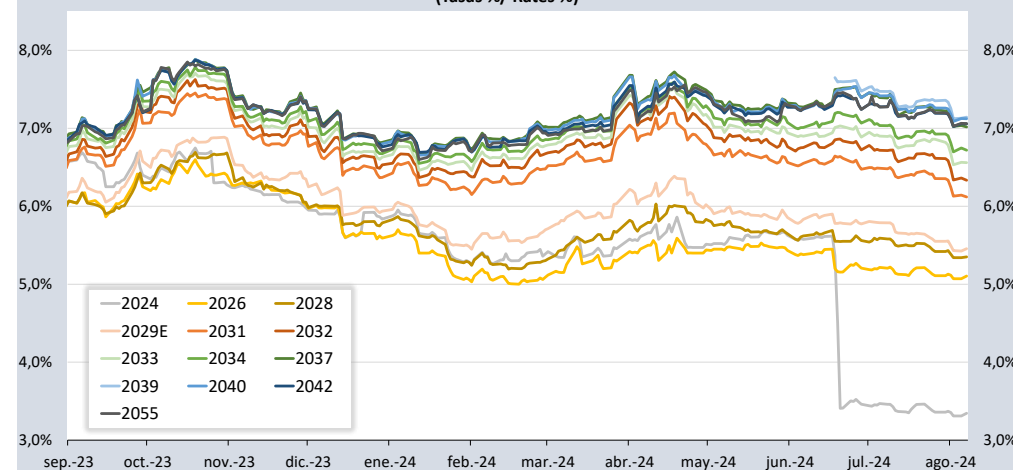
Bonos* / Bonds			Intereses corridos / Accrued Interest (%)	Saldo vigente Millones S. / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration Años / Years	Duración Modificada / Modified Años / Years	Vida media / Average life Años / Years	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic				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)				
			Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask														
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,77	1 048	5,700	-	-	-	-	100,0313	-	-	-	3,3449	-	20-Jun-24	150	0,01	0,01	0,02
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,99	3 937	8,200	105,69	106,00	105,87	105,87	105,8350	5,16	5,00	5,07	5,1050	2	7-Ago-24	4	1,86	1,77	2,02
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,09	7 225	6,350	103,49	103,60	103,49	103,49	103,5372	5,36	5,33	5,36	5,3500	3	7-Ago-24	5	3,56	3,38	4,02
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,89	13 176	5,940	101,81	101,97	101,89	101,89	101,8669	5,47	5,43	5,45	5,4560	3	7-Ago-24	5	3,98	3,77	4,52
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,38	18 748	6,950	104,40	104,83	104,80	104,80	104,6927	6,17	6,10	6,10	6,1196	43	7-Ago-24	167	5,61	5,28	7,02
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,99	20 617	6,150	98,73	99,23	99,03	99,03	98,8850	6,36	6,28	6,31	6,3339	32	7-Ago-24	173	6,34	5,96	8,02
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,55	17 180	7,300	104,86	105,44	105,23	105,23	105,0367	6,59	6,50	6,53	6,5595	41	7-Ago-24	218	6,70	6,28	9,02
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,63	16 635	5,400	89,06	90,78	90,71	90,71	90,5802	6,95	6,69	6,70	6,7182	44	7-Ago-24	132	7,63	7,15	10,02
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,36	19 580	6,900	99,13	99,44	99,29	99,29	99,1437	7,02	6,98	7,00	7,0176	18	7-Ago-24	113	8,61	8,04	13,02
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,76	15 436	7,600	104,16	104,99	104,71	104,71	104,3199	7,16	7,07	7,10	7,1425	29	7-Ago-24	386	9,40	8,78	15,02
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,60	11 168	5,350	83,45	83,82	83,74	83,74	83,3738	7,12	7,07	7,08	7,1232	22	7-Ago-24	64	10,24	9,56	16,02
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,33	5 033	6,850	-	-	-	-	98,1038	-	-	-	7,0562	-	19-Jul-24	1	10,19	9,52	17,52
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,26	3 462	6,714	-	-	-	-	95,8775	-	-	-	7,0613	-	12-Jul-24	15	12,78	11,94	30,52
13-Oct-24	PEP01000C89	SB13OCT24	2,17	884	6,84% + VAC	-	-	-	-	101,0421	-	-	-	1,0984	-	31-Oct-22	2	0,19	0,18	0,19
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,40	77	2,89%+VAC	-	-	-	-	98,5604	-	-	-	3,1527	-	18-Ago-23	20	5,14	4,98	5,52
31-Ene-35	PEP01000C85	SB31ENE35	0,14	911	7,39% + VAC	-	-	-	-	126,9191	-	-	-	4,1709	-	10-Jun-22	10	7,96	7,64	10,49
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,53	228	3,14%+VAC	-	-	-	-	84,4816	-	-	-	4,5298	-	10-Ago-23	50	12,02	11,50	15,52
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,86	424	3,83% + VAC	-	-	-	-	91,0516	-	-	-	4,4567	-	21-Jul-22	2	14,61	13,98	22,02
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,59	383	3,26%+VAC	-	-	-	-	80,2953	-	-	-	4,4596	-	12-Ago-21	10	17,74	16,98	29,52

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).

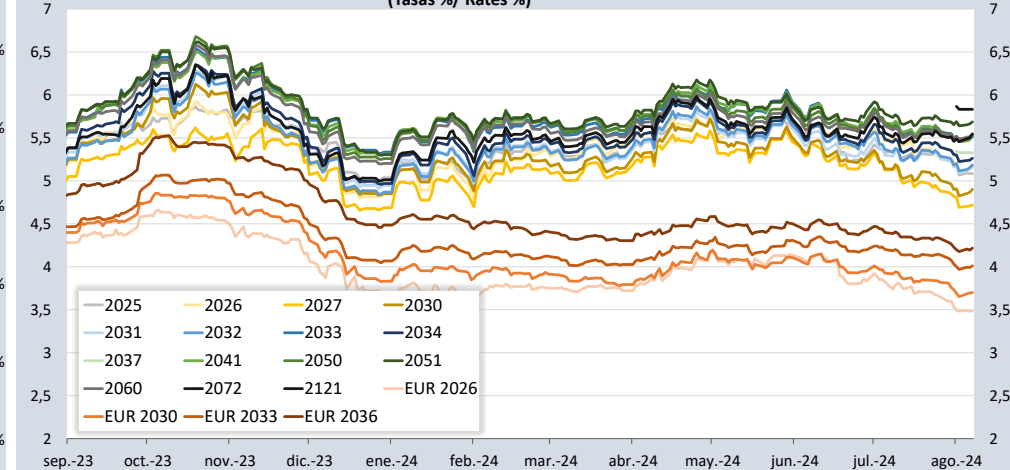
Rendimientos de Bonos Soberanos/ Sovereign Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)



Rendimientos de Bonos Globales/ Global Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)



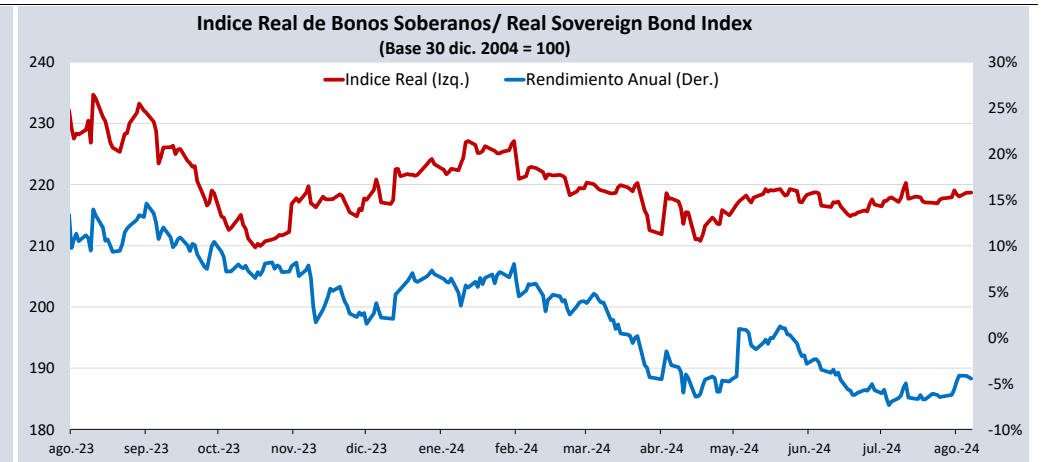
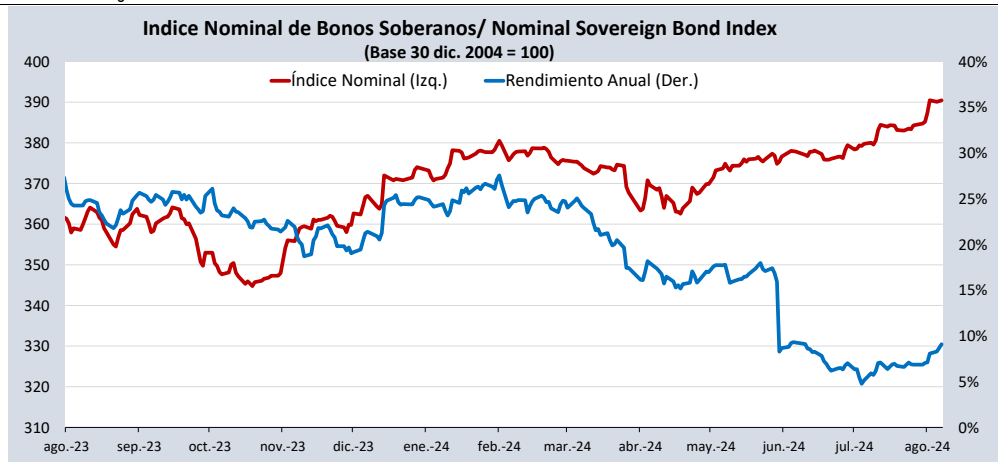
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,0780	0,00	0,07	-0,43	5,0840	0	-12	46	0,94	0,91	0,97
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,1730	-0,01	0,15	-0,50	5,1490	1	-7	37	1,44	1,41	1,48
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9440	-0,01	0,08	-0,43	3,4880	1	-5	30	1,46	1,44	1,50
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,3310	-0,03	0,29	-0,47	4,7190	1	-10	17	2,84	2,78	3,09
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,6170	-0,16	0,02	-0,55	4,9010	4	0	11	5,40	5,27	5,95
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2350	-0,01	0,17	-0,56	3,6990	0	-3	11	5,00	4,91	5,56
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,0390	-0,12	-0,02	-0,52	5,1690	2	1	10	5,91	5,76	6,56
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,7760	-0,19	0,04	-0,55	5,1860	3	0	9	7,61	7,42	8,44
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,2850	-0,13	-0,11	-0,92	5,5110	1	1	11	6,75	6,57	9,43
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,2700	-0,12	0,17	-0,99	4,0110	2	-2	16	8,06	7,90	8,72
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,3360	-0,14	0,31	-0,64	5,2630	2	-4	10	8,14	7,93	9,58
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,6140	-0,19	0,11	-0,81	4,2170	2	-1	10	10,70	10,48	12,46
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	100,3750	0,00	-	0,00	5,3280	0	533	0	8,78	8,56	12,78
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	109,1610	-0,51	-0,39	-0,95	5,5300	5	4	10	12,04	11,72	16,83
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	75,9260	-0,31	-0,36	-0,73	5,5360	3	4	8	13,93	13,56	26,66
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	99,1510	-0,32	-0,45	-0,54	5,6870	2	3	4	15,20	14,78	26,98
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	72,4700	-0,29	-0,45	-0,72	5,5410	3	4	7	18,28	17,79	36,85
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	100,6000	0,00	-	0,00	5,8320	0	583	0	17,64	17,14	48,13
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,9490	-0,48	-0,90	-0,63	5,5470	5	9	6	18,69	18,18	98,38

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	5	9,09	79	203	2,78	4,95	8,87	13,01	13,49	11,98	9,96	12,89	10,42	6,17	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	0	-4,48	-31	115	29,91	2,52	37,94	6,43	12,91	10,29



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.