



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

08/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

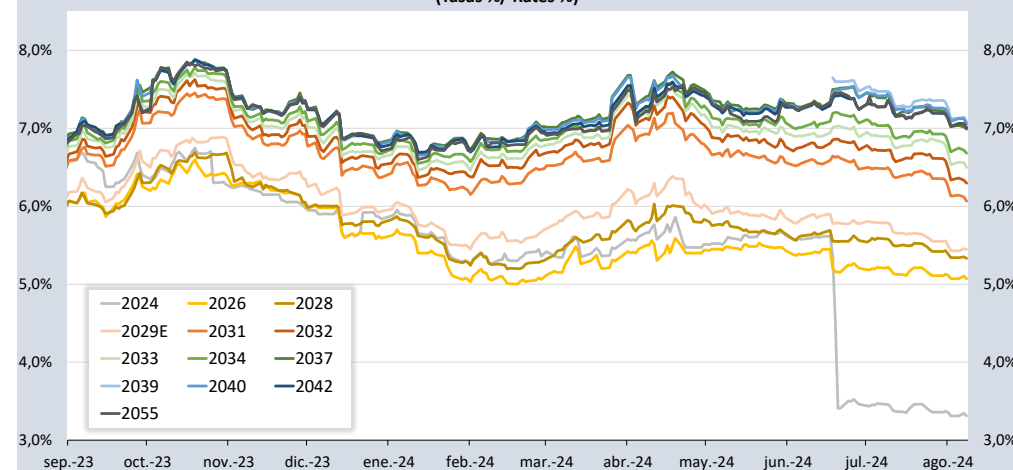
Bonos* / Bonds			Intereses corridos / Accrued Interest (%)	Saldo vigente Millones S. / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration Años / Years	Duración Modificada / Modified 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	2,79	1 048	5,700	-	-	-	100,0254	-	-	-	3,3099	-	20-Jun-24	150	0,01	0,01	0,01
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	4,01	3 937	8,200	105,61	105,99	105,86	105,8955	5,20	5,00	5,07	5,0700	1	8-Ago-24	20	1,85	1,77	2,01
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	3,11	7 225	6,350	103,38	103,74	103,63	103,6054	5,39	5,29	5,32	5,3305	9	8-Ago-24	43	3,56	3,38	4,01
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,90	13 176	5,940	101,69	102,08	101,92	101,9031	5,50	5,40	5,44	5,4466	20	8-Ago-24	94	3,98	3,77	4,51
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,40	18 748	6,950	104,92	105,31	105,20	105,0053	6,08	6,01	6,03	6,0647	44	8-Ago-24	256	5,61	5,29	7,01
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	3,01	20 617	6,150	98,85	99,40	99,34	99,1110	6,34	6,25	6,26	6,2968	34	8-Ago-24	313	6,34	5,96	8,01
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,57	17 180	7,300	105,51	105,85	105,68	105,4619	6,49	6,44	6,47	6,4972	55	8-Ago-24	316	6,70	6,29	9,01
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,64	16 635	5,400	90,85	91,38	91,25	90,8283	6,68	6,60	6,62	6,6813	87	8-Ago-24	528	7,63	7,15	10,01
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,37	19 580	6,900	98,92	100,12	99,70	99,3794	7,05	6,90	6,95	6,9891	22	8-Ago-24	65	8,61	8,05	13,01
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,78	15 436	7,600	104,52	105,45	105,27	104,8712	7,12	7,02	7,04	7,0829	33	8-Ago-24	321	9,42	8,80	15,01
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,62	11 168	5,350	83,78	84,32	84,32	83,9372	7,08	7,01	7,01	7,0552	26	8-Ago-24	72	10,26	9,59	16,01
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,35	5 033	6,850	-	-	-	98,5518	-	-	-	7,0100	-	8-Ago-24	0	10,21	9,54	17,51
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,28	3 462	6,714	96,61	99,06	96,61	96,6079	7,00	6,80	7,00	7,0000	1	8-Ago-24	2	12,84	12,00	30,51
13-Oct-24	PEP01000C89	SB13OCT24	2,19	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,0269	-	-	-	1,0962	-	31-Oct-22	2	0,18	0,18	0,18
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,41	77	2,89%+VAC	-	-	-	98,6566	-	-	-	3,1335	-	18-Ago-23	20	5,14	4,98	5,51
31-Ene-35	PEP01000C85	SB31ENE35	0,16	911	7,39% + VAC	-	-	-	127,1749	-	-	-	4,1440	-	10-Jun-22	10	7,96	7,64	10,48
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,54	228	3,14%+VAC	-	-	-	85,0239	-	-	-	4,4754	-	10-Ago-23	50	12,04	11,52	15,51
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,87	424	3,83% + VAC	-	-	-	91,6041	-	-	-	4,4144	-	21-Jul-22	2	14,63	14,01	22,01
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,60	383	3,26%+VAC	-	-	-	81,0084	-	-	-	4,4087	-	12-Ago-21	10	17,79	17,04	29,51

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).

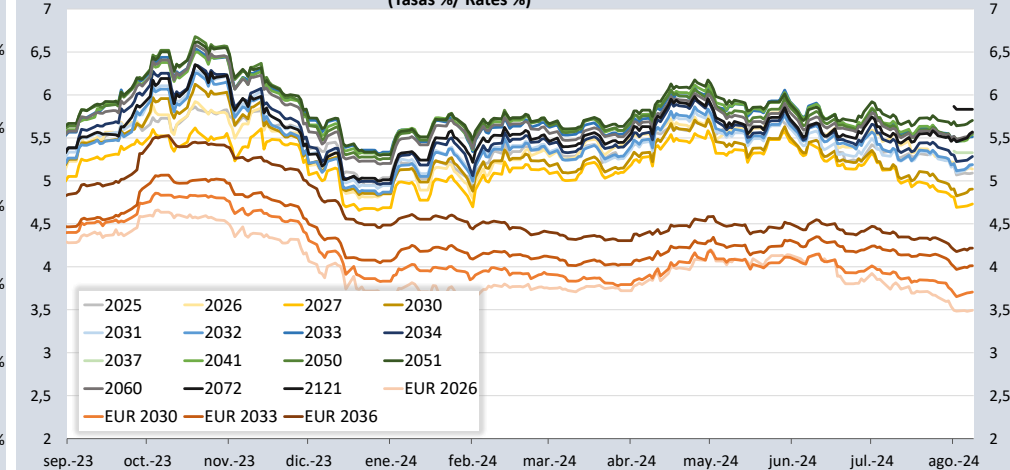
Rendimientos de Bonos Soberanos/ Sovereign Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)



Rendimientos de Bonos Globales/ Global Bond Yields

(Tasas %/ Rates %)



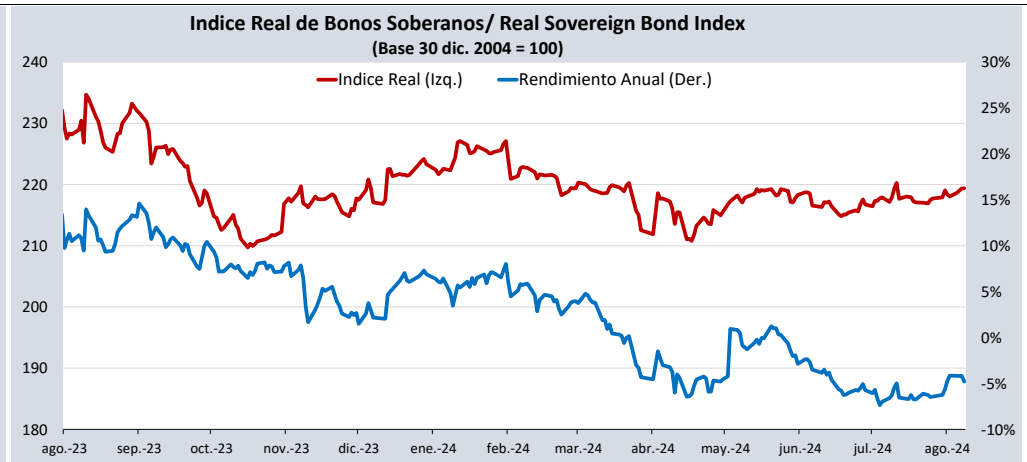
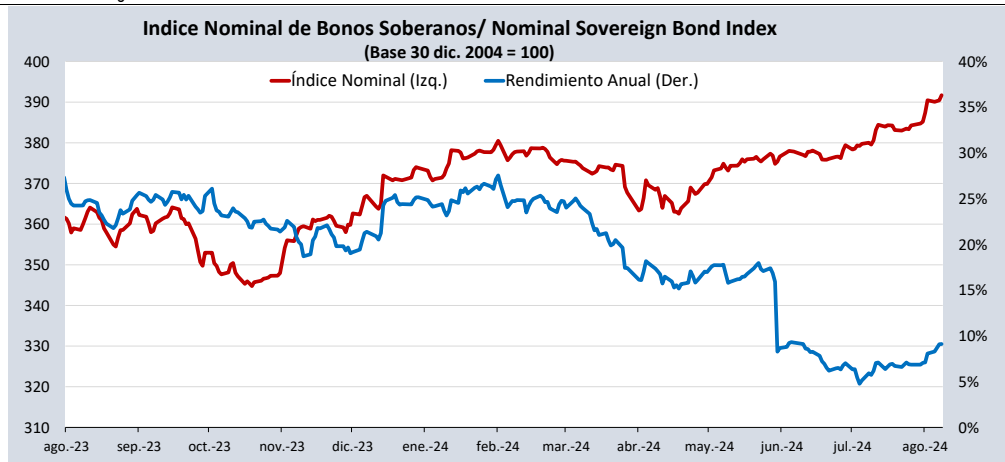
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,0660	-0,01	0,04	-0,44	5,0900	1	-9	47	0,94	0,91	0,96
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,1940	0,02	0,15	-0,49	5,1380	-1	-8	36	1,44	1,40	1,48
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9420	0,00	0,01	-0,42	3,4940	1	0	30	1,46	1,43	1,50
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,2980	-0,03	0,23	-0,43	4,7310	1	-8	16	2,84	2,77	3,09
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,6060	-0,01	0,04	-0,55	4,9040	0	0	12	5,39	5,26	5,95
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2000	-0,03	-0,08	-0,56	3,7060	1	2	11	5,00	4,91	5,56
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	86,9540	-0,09	-0,02	-0,51	5,1870	2	1	10	5,90	5,75	6,55
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	77,7640	-0,01	0,11	-0,55	5,1890	0	-1	9	7,61	7,42	8,44
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,2640	-0,02	-0,01	-0,95	5,5130	0	0	12	6,75	6,57	9,42
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,2790	0,01	-0,03	-0,98	4,0120	0	1	16	8,06	7,90	8,71
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,2090	-0,13	0,14	-0,61	5,2830	2	-2	9	8,13	7,92	9,58
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,6270	0,01	-0,12	-0,80	4,2170	0	2	10	10,70	10,48	12,46
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	100,3750	0,00	-	0,00	5,3280	0	-	0	8,78	8,55	12,78
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	109,0940	-0,07	-0,25	-0,88	5,5370	1	3	9	12,04	11,71	16,83
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	75,7780	-0,15	-0,34	-0,77	5,5530	2	4	9	13,91	13,54	26,66
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	98,9280	-0,22	-0,19	-0,61	5,7030	2	1	4	15,19	14,77	26,97
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	72,2540	-0,22	-0,46	-0,74	5,5600	2	4	7	18,24	17,75	36,84
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	100,6000	0,00	-	0,00	5,8320	0	-	0	17,64	17,14	48,13
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,7300	-0,22	-0,82	-0,67	5,5690	2	8	7	18,61	18,11	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	392	1	4	9,12	3	201	2,77	4,94	8,84	13,01	13,48	11,99	9,96	12,88	10,44	6,19	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	219	0	1	-4,79	-61	-5	29,83	2,51	37,91	6,45	12,95	10,35



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.