



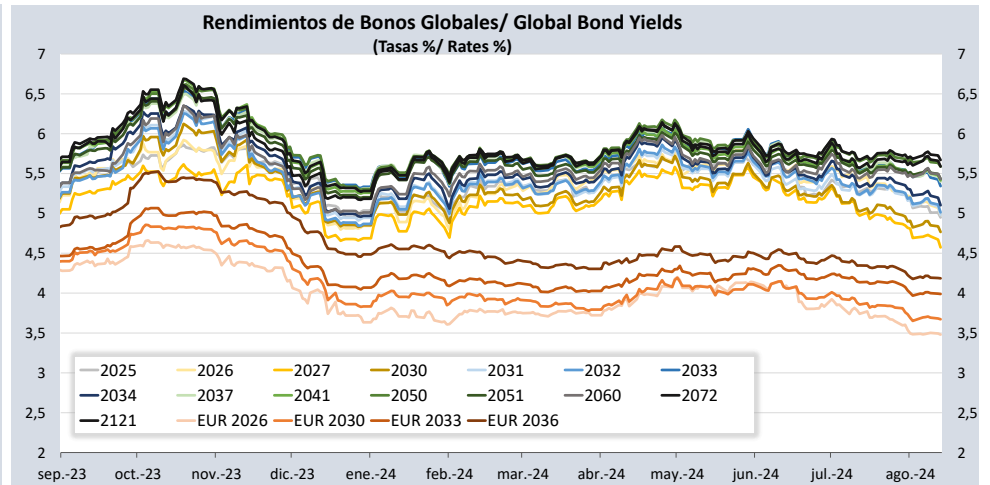
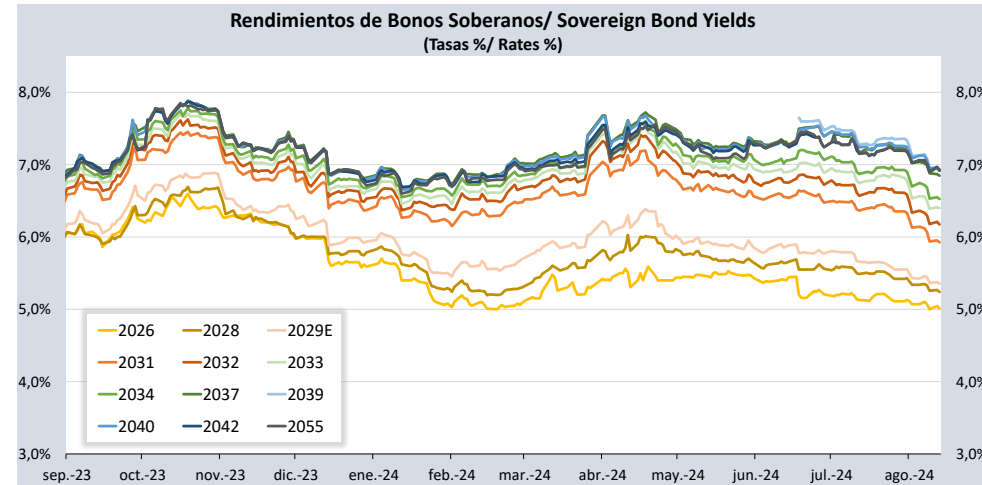
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

12/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración / Duración	Vida media / Average
Descripción / Descripción	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones \$ / 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. \$) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,00	3 937	8,200	105,7686	106,04	105,86	105,9122	5,11	4,97	5,06	5,0460	5	12-Ago-24	10	5,78	5,46	2,01
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,00	7 225	6,350	103,74	103,92	103,81	103,8241	5,29	5,24	5,27	5,2675	4	12-Ago-24	30	6,53	6,15	4,01
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,00	13 176	5,940	102,00	102,24	102,16	102,1731	5,42	5,36	5,38	5,3774	4	12-Ago-24	76	6,93	6,51	4,51
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,00	18 748	6,950	105,54	105,71	105,60	105,6433	5,97	5,94	5,96	5,9527	13	12-Ago-24	50	7,86	7,37	7,01
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,00	20 617	6,150	99,52	99,70	99,67	99,6473	6,23	6,20	6,21	6,2092	9	12-Ago-24	58	8,92	8,35	8,01
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,00	17 180	7,300	105,92	106,12	106,05	106,0596	6,43	6,40	6,41	6,4097	13	12-Ago-24	74	9,44	8,83	9,01
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,00	16 635	5,400	91,59	91,66	91,72	91,7206	6,57	6,56	6,55	6,5497	21	12-Ago-24	159	10,61	9,92	10,01
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,00	19 580	6,900	100,12	100,46	100,29	100,3838	6,90	6,86	6,88	6,8686	6	12-Ago-24	88	10,57	9,88	13,01
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,87	15 436	7,600	105,83	106,21	105,92	105,9902	6,98	6,94	6,97	6,9631	17	12-Ago-24	167	13,31	12,44	15,01
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,00	11 168	5,350	84,66	84,91	84,74	84,7810	6,97	6,94	6,96	6,9550	2	12-Ago-24	4	0,17	0,17	16,01
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,00	5 033	6,850	99,1386	100,13	99,14	99,9431	6,95	6,85	6,95	6,9700	2	12-Ago-24	10	5,13	4,97	17,51
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,00	3 462	6,714	-	-	-	97,0905	-	-	-	6,9600	-	8-Ago-24	2	7,96	7,66	30,51
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,26	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,7313	-	-	-	2,4336	-	31-Oct-22	2	0,17	0,17	0,18
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,44	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,1561	-	-	-	3,0339	-	18-Ago-23	20	5,20	5,04	5,51
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,24	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,5446	-	-	-	4,0018	-	10-Jun-22	10	7,96	7,66	10,48
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,57	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,2676	-	-	-	4,3525	-	10-Ago-23	50	12,28	11,77	15,51
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,92	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,3255	-	-	-	4,3598	-	21-Jul-22	2	14,97	14,35	22,01
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,63	383	3,26%+VAC	-	-	-	81,7844	-	-	-	4,3542	-	12-Ago-21	10	18,23	17,47	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).



Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

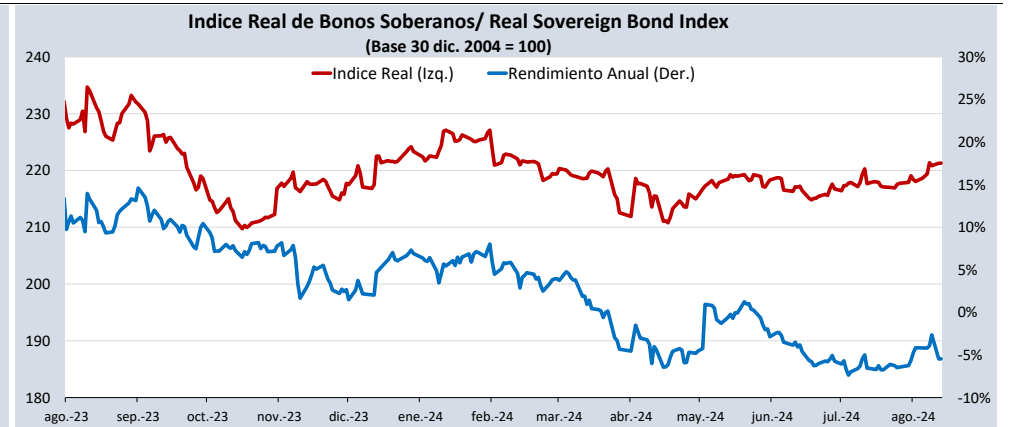
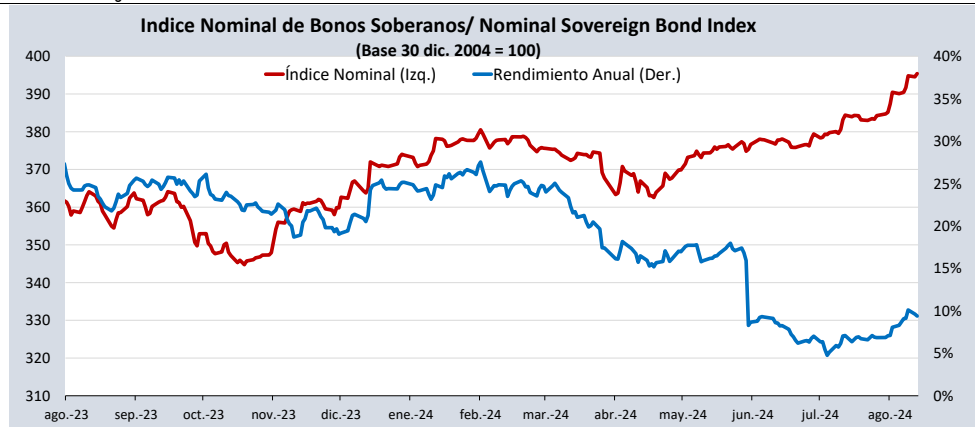
Bonos globales\*\*\*\* / Global bonds

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	102,1140	-0,01	0,03	-0,48	5,0120	0	-8	53	0,92	0,90	0,95
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,3140	0,05	0,11	-0,46	5,0700	-3	-5	34	1,43	1,39	1,47
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9470	0,01	0,01	-0,42	3,4930	-1	0	30	1,45	1,42	1,49
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,4680	0,11	0,10	-0,46	4,6720	-4	-3	17	2,83	2,76	3,08
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	89,9390	0,07	0,10	-0,55	4,8380	-1	-1	11	5,38	5,26	5,94
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3230	0,05	0,02	-0,56	3,6810	-1	0	11	4,99	4,90	5,55
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	87,4760	0,17	0,20	-0,45	5,0860	-3	-3	9	5,89	5,75	6,54
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,2420	0,14	0,17	-0,56	5,1110	-2	-2	10	7,60	7,41	8,43
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	123,9520	0,19	0,34	-0,95	5,4260	-2	-5	11	6,74	6,57	9,41
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4060	0,05	0,05	-0,98	3,9930	-1	0	16	8,05	7,89	8,70
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,7860	0,16	0,28	-0,63	5,1980	-2	-4	10	8,13	7,92	9,56
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,2930	0,13	0,10	-0,47	5,3380	-2	-1	6	8,15	7,94	10,64
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,8520	0,04	0,15	-0,82	4,1900	0	-2	10	10,69	10,47	12,44
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	109,7500	0,17	-0,04	-0,83	5,4680	-2	0	9	8,74	8,51	12,77
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,4380	0,22	0,13	-0,79	5,4810	-2	-1	9	12,04	11,72	16,82
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,8500	0,12	0,24	-0,47	5,6350	-1	-2	3	13,83	13,45	26,65
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,9750	0,16	0,16	-0,79	5,4960	-1	-1	7	15,37	14,96	26,96
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	100,7910	0,05	-0,16	-0,55	5,8190	0	1	4	14,48	14,07	30,43
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,4820	0,09	-0,07	-0,65	5,4960	-1	1	6	18,34	17,85	36,83
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,3930	0,12	-0,14	-0,79	5,7280	-1	1	7	17,85	17,35	48,12
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,2580	0,16	-0,15	-0,75	5,6600	-2	2	7	18,31	17,81	98,37

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	395	0	4	9,62	-49	133	2,73	4,91	8,80	12,95	13,43	11,92	9,98	12,85	10,79	6,19	3,26	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	221	0	3	-5,47	-282	-129	29,56	2,51	38,08	6,50	12,97	10,38



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](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.