



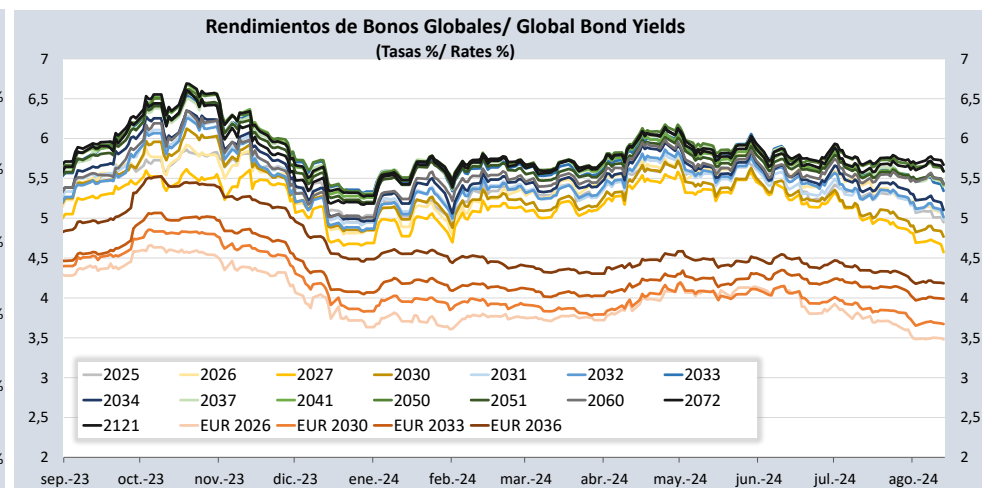
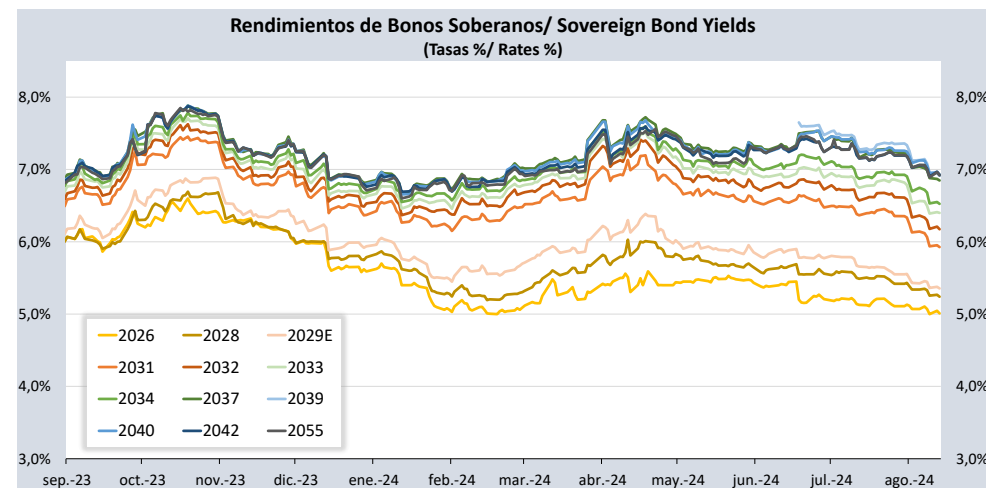
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

13/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración / Modificada	Vida media / Average
Descripción / Descripción	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones SI. / 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)	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,02	3 937	8,200	-	-	-	105,9738	-	-	-	5,0100	-	12-Ago-24	10	1,91	1,82	2,00
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,02	7 225	6,350	103,74	103,92	103,91	103,9208	5,29	5,24	5,24	5,2400	2	13-Ago-24	4	3,65	3,47	4,00
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,02	13 176	5,940	-	-	-	102,2605	-	-	-	5,3550	-	12-Ago-24	76	4,08	3,87	4,50
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,02	18 748	6,950	105,54	105,71	105,77	105,7943	5,97	5,94	5,93	5,9262	59	13-Ago-24	196	5,78	5,46	7,00
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,02	20 617	6,150	99,52	99,70	99,83	99,8638	6,23	6,20	6,18	6,1739	32	13-Ago-24	220	6,53	6,15	8,00
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,02	17 180	7,300	105,92	106,12	106,26	106,1306	6,43	6,40	6,38	6,3992	3	13-Ago-24	97	6,92	6,51	9,00
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,01	16 635	5,400	91,59	91,66	92,00	91,8914	6,57	6,56	6,51	6,5247	11	13-Ago-24	117	7,86	7,38	10,00
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,02	19 580	6,900	100,12	100,46	100,71	100,5606	6,90	6,86	6,83	6,8475	7	13-Ago-24	87	8,92	8,35	13,00
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,89	15 436	7,600	105,83	106,21	106,40	106,3696	6,98	6,94	6,92	6,9229	16	13-Ago-24	155	9,45	8,84	15,00
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,01	11 168	5,350	84,66	84,91	85,25	85,1340	6,97	6,94	6,90	6,9133	11	13-Ago-24	22	10,62	9,93	16,00
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,02	5 033	6,850	-	-	-	99,3518	-	-	-	6,9283	-	12-Ago-24	10	10,58	9,89	17,50
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,02	3 462	6,714	-	-	-	97,5963	-	-	-	6,9183	-	8-Ago-24	2	13,35	12,48	30,50
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,28	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,7242	-	-	-	2,4060	-	31-Oct-22	2	0,17	0,17	0,17
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,01	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,1975	-	-	-	3,0257	-	18-Ago-23	20	5,20	5,04	5,50
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,26	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,6214	-	-	-	3,9934	-	10-Jun-22	10	7,96	7,66	10,47
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,01	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,5184	-	-	-	4,3280	-	10-Ago-23	50	12,28	11,77	15,50
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,01	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,6603	-	-	-	4,3346	-	21-Jul-22	2	14,97	14,35	22,00
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,01	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,1473	-	-	-	4,3289	-	12-Ago-21	10	18,23	17,47	29,50

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.

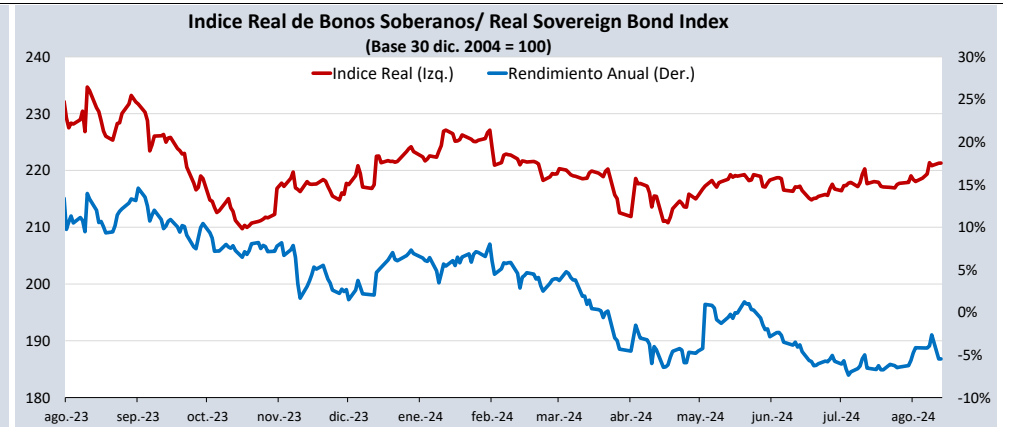
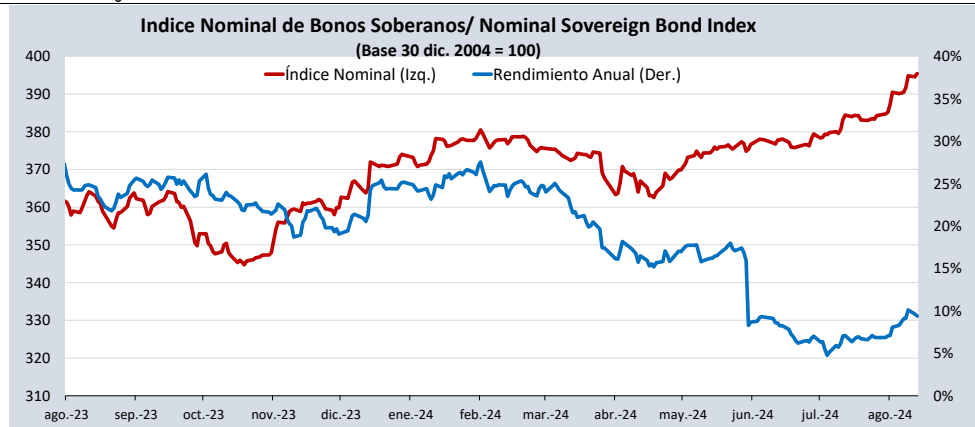
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,1650	0,05	0,08	-0,48	4,9490	-6	-14	52	0,92	0,90	0,95
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,4390	0,13	0,26	-0,53	4,9810	-9	-16	40	1,43	1,39	1,47
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9670	0,02	0,02	-0,42	3,4800	-1	0	31	1,44	1,42	1,49
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,7420	0,27	0,38	-0,50	4,5740	-10	-13	18	2,83	2,76	3,08
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,2760	0,34	0,49	-0,57	4,7680	-7	-10	12	5,38	5,26	5,94
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3690	0,05	0,12	-0,56	3,6720	-1	-2	11	4,99	4,90	5,54
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,0180	0,54	0,86	-0,53	4,9800	-11	-16	10	5,89	5,75	6,54
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,8220	0,58	0,86	-0,53	5,0130	-10	-14	9	7,60	7,42	8,42
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	124,6500	0,70	1,24	-1,01	5,3420	-8	-15	12	6,75	6,57	9,41
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4400	0,03	0,05	-0,98	3,9890	0	0	16	8,05	7,89	8,70
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,4310	0,64	0,95	-0,64	5,1020	-10	-14	10	8,13	7,93	9,56
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,7390	0,45	0,53	-0,52	5,2820	-6	-7	7	8,15	7,94	10,64
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,9020	0,05	0,09	-0,74	4,1850	-1	-1	9	10,69	10,47	12,44
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,4170	0,67	0,75	-0,87	5,3980	-7	-8	9	8,75	8,52	12,77
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,0460	0,61	0,81	-0,77	5,4150	-7	-9	8	12,06	11,75	16,82
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	100,5060	0,66	1,03	-0,44	5,5870	-5	-8	3	13,87	13,49	26,65
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	73,6730	0,70	0,92	-0,74	5,4340	-6	-8	7	15,42	15,02	26,96
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	101,4300	0,64	0,40	-0,57	5,7740	-4	-3	4	14,53	14,12	30,42
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,1450	0,66	0,72	-0,72	5,4330	-6	-7	7	18,44	17,95	36,83
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,0620	0,67	0,65	-0,78	5,6700	-6	-6	7	17,97	17,48	48,11
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,9920	0,73	0,75	-0,70	5,5890	-7	-7	7	18,54	18,03	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	1	5	9,39	-23	109	2,72	4,90	8,79	12,94	13,44	11,90	9,98	12,85	10,80	6,21	3,26	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	221	0	3	-5,46	1	-129	29,52	2,51	38,05	6,51	13,00	10,41



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.