



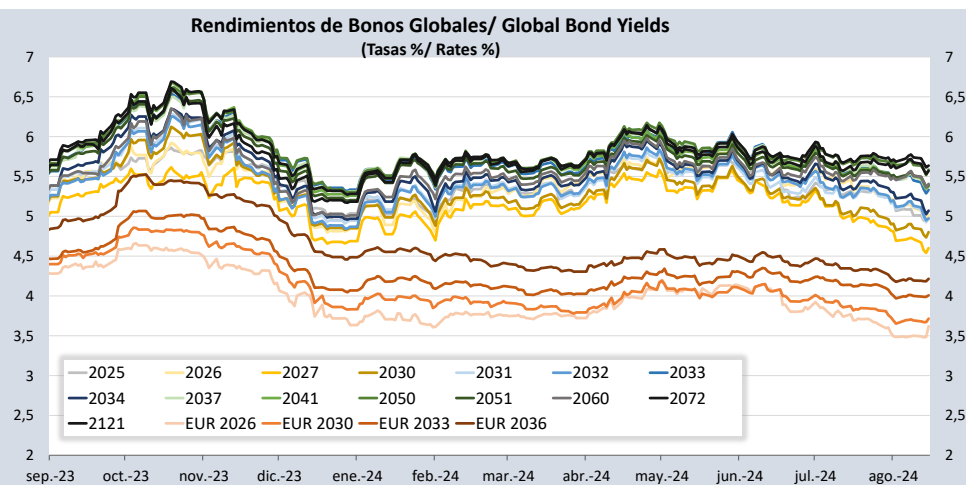
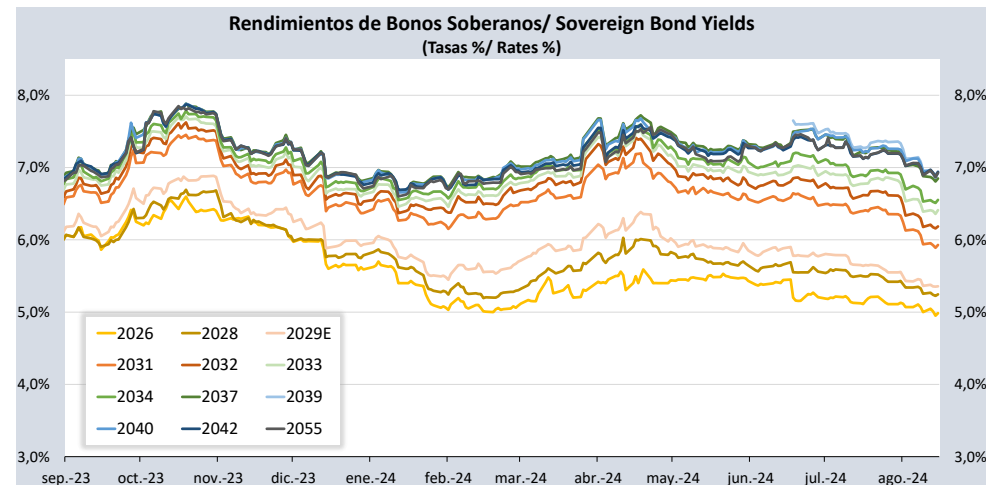
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

15/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds			Saldo vigente	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	Cupón / Coupon (%)	Postura / Position		Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Postura / Position		Última neg. / Last trading day		Prom. ponderado / Weighted average (%)	Día / Date			
			Compra / Bid				Venta / Ask	Compra / Bid			Venta / Ask								
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,07	3 937	8,200	105,9378	106,13	105,98	106,0058	5,00	4,90	4,98	4,9852	11	15-Ago-24	48	1,91	1,82	1,99
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,05	7 225	6,350	103,90	104,23	103,90	103,8985	5,24	5,15	5,24	5,2448	3	15-Ago-24	21	3,65	3,47	3,99
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,05	13 176	5,940	102,11	102,31	102,19	102,2507	5,39	5,34	5,37	5,3568	20	15-Ago-24	56	4,07	3,87	4,49
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,06	18 748	6,950	105,70	105,59	105,87	105,7713	5,94	5,96	5,91	5,9295	36	15-Ago-24	167	5,78	5,45	6,99
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,05	20 617	6,150	99,76	99,95	99,95	99,7986	6,19	6,16	6,16	6,1845	20	15-Ago-24	120	6,52	6,14	7,99
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,06	17 480	7,300	106,05	106,25	106,25	106,0433	6,41	6,38	6,38	6,4114	46	15-Ago-24	241	6,92	6,50	8,99
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,04	16 635	5,400	91,60	91,87	91,73	91,7055	6,57	6,53	6,55	6,5526	35	15-Ago-24	157	7,85	7,37	9,99
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,06	19 730	6,900	100,37	100,71	100,54	100,5400	6,87	6,83	6,85	6,8499	12	15-Ago-24	77	8,92	8,35	12,99
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,93	15 436	7,600	106,11	106,49	106,49	106,1808	6,95	6,91	6,91	6,9427	7	15-Ago-24	52	9,44	8,82	14,99
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,04	11 168	5,350	85,00	85,26	85,17	85,0470	6,93	6,90	6,91	6,9239	10	15-Ago-24	102	10,61	9,92	15,99
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,06	5 033	6,850	-	-	-	99,2475	-	-	-	6,9389	-	12-Ago-24	10	10,57	9,88	17,49
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,05	3 462	6,714	-	-	-	97,4671	-	-	-	6,9289	-	8-Ago-24	2	13,33	12,47	30,49
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,32	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,7135	-	-	-	2,3267	-	31-Oct-22	2	0,16	0,16	0,16
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,02	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,0604	-	-	-	3,0533	-	18-Ago-23	20	5,19	5,04	5,49
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,30	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,1291	-	-	-	4,0422	-	10-Jun-22	10	7,95	7,64	10,46
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,03	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,1115	-	-	-	4,3684	-	10-Ago-23	50	12,26	11,75	15,49
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,03	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,1857	-	-	-	4,3705	-	21-Jul-22	2	14,94	14,32	21,99
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,03	383	3,26%+VAC	-	-	-	81,6358	-	-	-	4,3648	-	12-Ago-21	10	18,18	17,42	29,49

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.

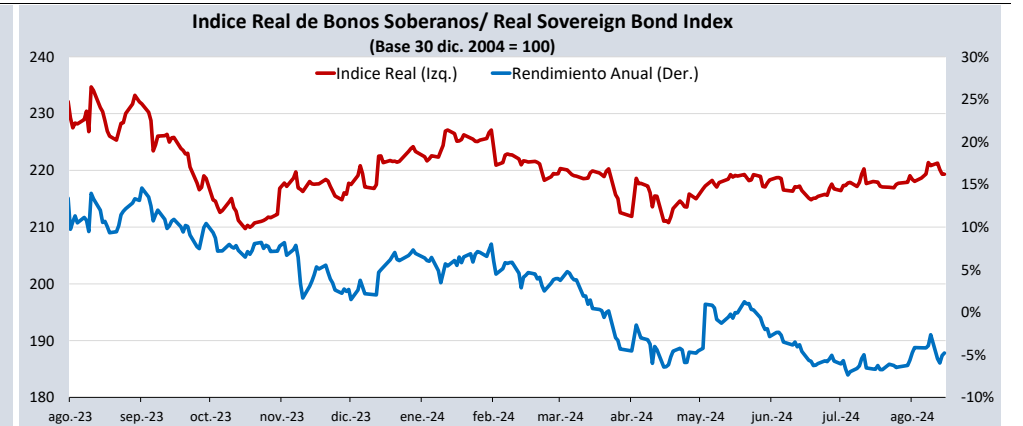
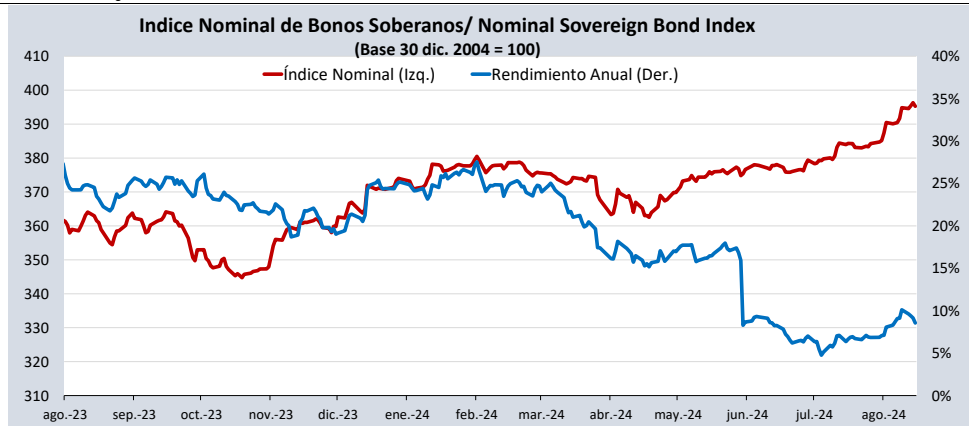
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,1350	-0,03	0,07	-0,49	4,9680	2	-12	54	0,92	0,89	0,94
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,4040	-0,06	0,21	-0,50	5,0170	5	-12	37	1,42	1,39	1,46
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,7820	-0,18	-0,16	-0,63	3,6200	13	13	46	1,44	1,41	1,48
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,6730	-0,16	0,38	-0,47	4,6000	6	-13	17	2,82	2,76	3,07
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,1190	-0,32	0,51	-0,52	4,8020	7	-10	11	5,38	5,25	5,93
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,1570	-0,22	-0,04	-0,81	3,7150	4	1	17	4,98	4,89	5,54
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,0630	-0,25	1,11	-0,55	4,9730	5	-21	11	5,89	5,74	6,53
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,0620	-0,14	1,30	-0,57	4,9740	3	-22	10	7,60	7,41	8,42
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	124,7240	-0,37	1,46	-0,98	5,3310	4	-18	12	6,74	6,57	9,40
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,3430	-0,10	0,06	-0,96	4,0070	2	0	15	8,04	7,88	8,69
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,6530	-0,29	1,44	-0,63	5,0700	4	-21	9	8,13	7,92	9,56
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	100,7910	-0,30	0,93	-0,48	5,2760	4	-12	6	8,15	7,94	10,64
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,6690	-0,24	0,04	-0,71	4,2150	3	0	9	10,68	10,46	12,44
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,5110	-0,42	1,42	-0,92	5,3880	4	-15	10	8,75	8,52	12,76
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,4500	-0,23	1,67	-0,75	5,3720	2	-18	8	12,07	11,76	16,81
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	100,5250	-0,93	1,60	-0,33	5,5860	7	-12	2	13,87	13,49	26,64
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	74,1340	-0,28	1,88	-0,74	5,3930	2	-17	7	15,46	15,05	26,95
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	102,3020	-0,42	1,92	-0,65	5,7140	3	-13	4	14,58	14,18	30,42
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,4160	-0,44	1,69	-0,71	5,4070	4	-16	7	18,48	17,99	36,83
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,4560	-0,27	1,60	-0,72	5,6360	2	-14	6	18,04	17,55	48,11
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	58,2040	-0,42	1,55	-0,68	5,5690	4	-15	6	18,60	18,09	98,36

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	4	8,56	-59	-56	2,73	4,90	8,80	12,95	13,44	11,90	9,96	12,86	10,79	6,20	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	219	0	-2	-4,78	30	-85	29,80	2,49	38,27	6,42	12,79	10,24



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.