



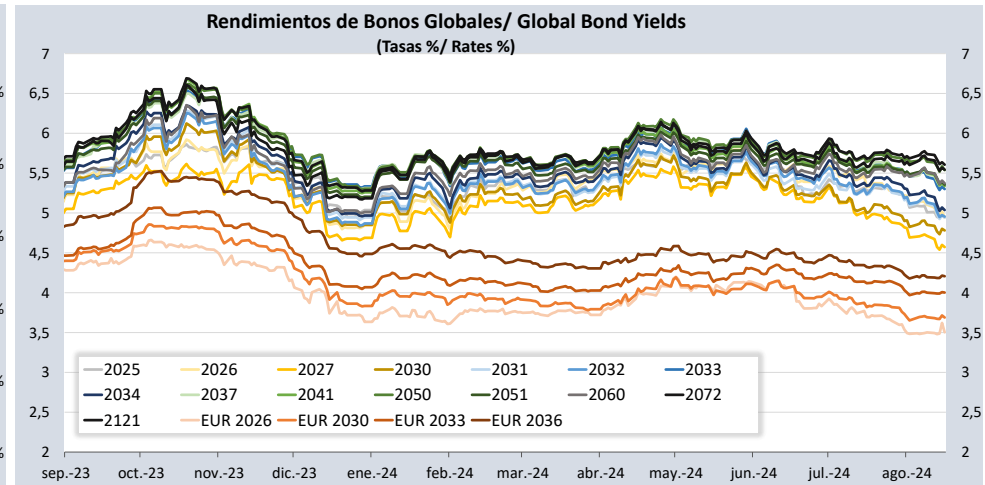
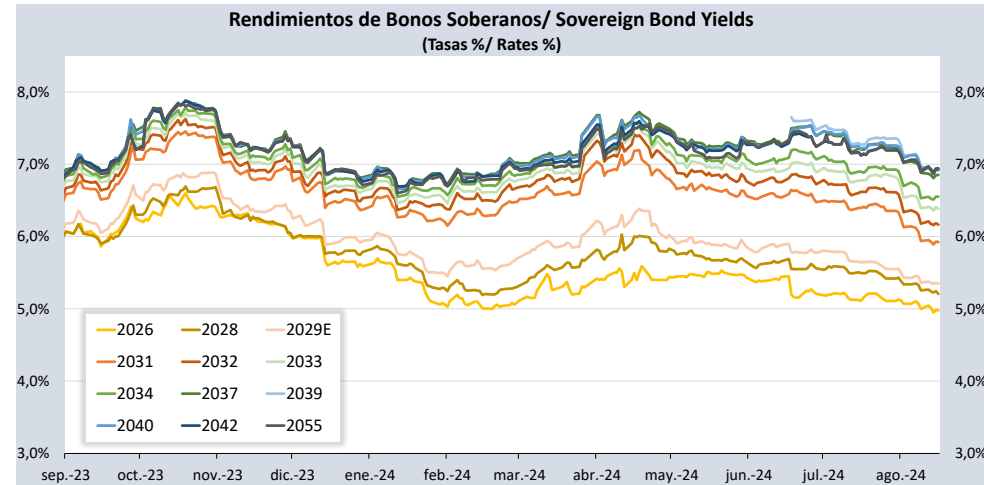
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

16/08/2024

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 / Description	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			
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,09	3 937	8,200	-	-	-	106,0109	-	-	-	4,9784	-	16-Ago-24	1	1,90	1,81	1,99
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,07	7 225	6,350	-	-	-	104,0395	-	-	-	5,2050	-	15-Ago-24	21	3,65	3,47	3,99
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,06	13 176	5,940	102,23	102,27	102,23	102,2763	5,36	5,35	5,36	5,3500	2	16-Ago-24	3	4,07	3,86	4,49
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,08	18 748	6,950	105,76	105,87	105,81	105,8017	5,93	5,91	5,92	5,9239	39	16-Ago-24	167	5,77	5,45	6,99
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,07	20 617	6,150	99,92	100,01	99,98	99,9206	6,17	6,15	6,16	6,1646	36	16-Ago-24	228	6,52	6,14	7,99
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,08	17 480	7,300	106,15	106,46	106,35	106,2503	6,40	6,35	6,37	6,3812	16	16-Ago-24	89	6,92	6,50	8,99
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,06	16 635	5,400	91,66	92,00	91,73	91,7138	6,56	6,51	6,55	6,5516	7	16-Ago-24	151	7,85	7,36	9,99
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,08	19 730	6,900	100,27	100,78	100,62	100,5221	6,88	6,82	6,84	6,8520	22	16-Ago-24	162	8,92	8,34	12,99
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,95	15 436	7,600	106,06	106,68	106,44	106,4832	6,96	6,89	6,92	6,9107	3	16-Ago-24	14	9,44	8,83	14,99
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,06	11 168	5,350	84,90	85,68	85,17	85,0204	6,94	6,85	6,91	6,9272	3	16-Ago-24	32	10,61	9,92	15,99
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,07	5 033	6,850	-	-	-	99,2150	-	-	-	6,9422	-	12-Ago-24	10	10,57	9,88	17,49
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,07	3 462	6,714	-	-	-	97,4269	-	-	-	6,9322	-	8-Ago-24	2	13,32	12,46	30,49
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,34	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6977	-	-	-	2,3495	-	31-Oct-22	2	0,16	0,16	0,16
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,03	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,0922	-	-	-	3,0470	-	18-Ago-23	20	5,19	5,04	5,49
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,32	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,1290	-	-	-	4,0416	-	10-Jun-22	10	7,95	7,64	10,46
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,03	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,2561	-	-	-	4,3543	-	10-Ago-23	50	12,27	11,75	15,49
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,04	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,1454	-	-	-	4,3736	-	21-Jul-22	2	14,94	14,31	21,99
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,04	383	3,26%+VAC	-	-	-	81,5911	-	-	-	4,3680	-	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.

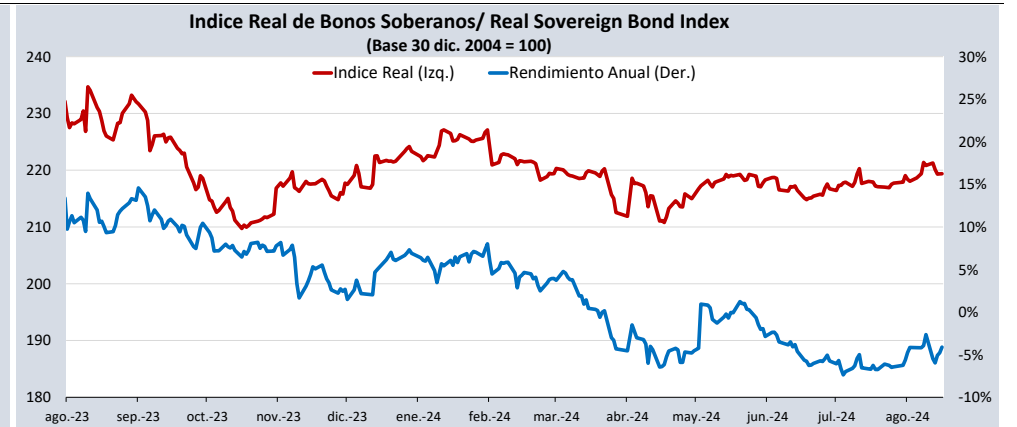
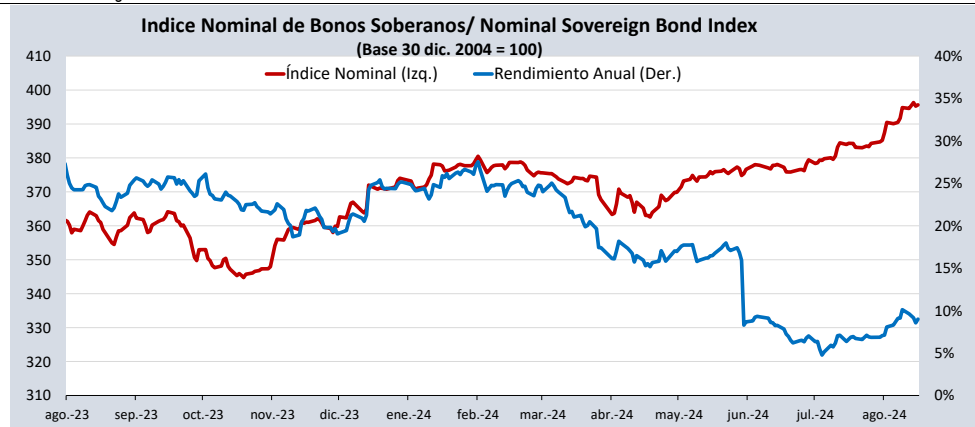
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,1360	0,00	0,01	-0,51	4,9460	-2	-6	57	0,91	0,89	0,94
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5200	0,12	0,26	-0,53	4,9450	-7	-16	40	1,42	1,38	1,46
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9450	0,16	0,01	-0,54	3,5030	-12	0	39	1,44	1,41	1,48
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,7520	0,08	0,40	-0,51	4,5720	-3	-14	19	2,82	2,76	3,07
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,2310	0,11	0,36	-0,52	4,7810	-2	-7	11	5,37	5,25	5,93
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2860	0,13	0,02	-0,64	3,6880	-3	0	13	4,98	4,89	5,54
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,2220	0,16	0,91	-0,55	4,9440	-3	-18	11	5,89	5,74	6,53
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,1890	0,13	1,08	-0,80	4,9550	-2	-18	14	7,59	7,41	8,41
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	124,9670	0,24	1,20	-1,04	5,3000	-3	-15	12	6,74	6,57	9,40
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,3890	0,05	0,03	-0,96	4,0010	-1	0	15	8,04	7,88	8,69
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,8930	0,24	1,27	-0,61	5,0360	-3	-19	9	8,12	7,93	9,55
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	101,0130	0,22	0,84	-0,50	5,2480	-3	-11	6	8,15	7,94	10,63
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7460	0,08	-0,07	-0,70	4,2060	-1	1	9	10,68	10,46	12,43
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,8340	0,32	1,25	-0,89	5,3540	-3	-13	9	8,75	8,53	12,76
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,7710	0,32	1,55	-0,81	5,3380	-3	-17	9	12,08	11,77	16,81
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	101,1910	0,67	1,47	-0,70	5,5380	-5	-11	5	13,90	13,53	26,64
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	74,5580	0,42	1,75	-0,72	5,3560	-4	-15	6	15,49	15,08	26,95
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	102,9230	0,62	2,18	-0,52	5,6710	-4	-15	4	14,62	14,22	30,41
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	58,8000	0,38	1,41	-0,87	5,3720	-4	-13	8	18,54	18,05	36,82
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	66,8180	0,36	1,54	-0,77	5,6060	-3	-13	7	18,11	17,61	48,11
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	58,4750	0,27	1,38	-0,86	5,5430	-3	-13	8	18,68	18,17	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	396	0	1	9,00	44	-111	2,72	4,91	8,79	12,95	13,44	11,91	9,96	12,85	10,81	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	-1	-4,11	67	-146	29,79	2,49	38,27	6,43	12,78	10,23



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.