



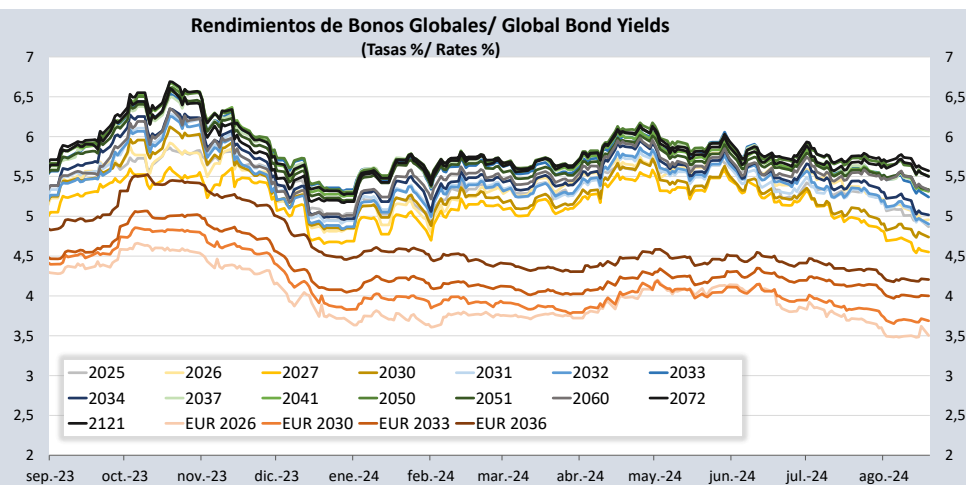
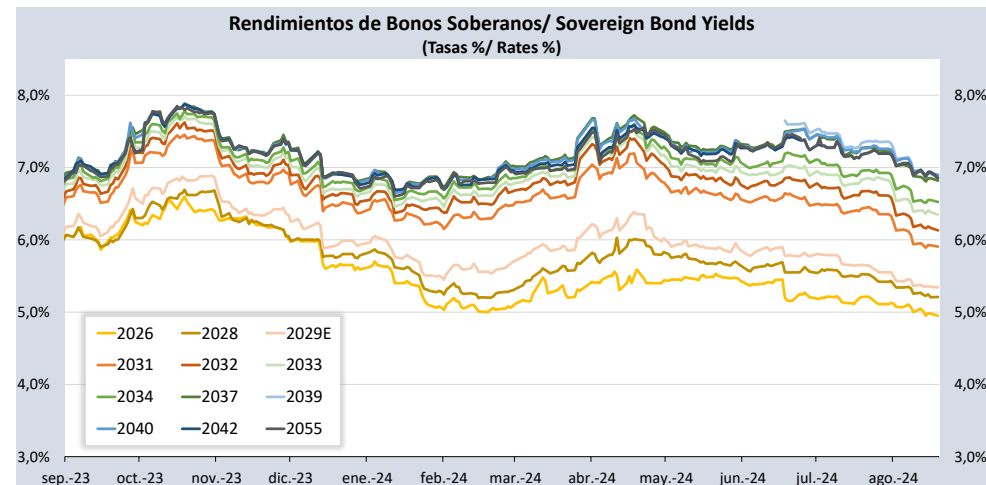
**PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT**

19/08/2024

**Bonos soberanos / Sovereign bonds**

Descripción / Description	Bonos* / Bonds			Saldo vigente Millones S./ / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration Años / Years	Duración Modificada Años / Years	Vida media / Average Años / Years
	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			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-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,16	3 937	8,200	106,0174	106,07	106,02	106,0415	4,95	4,92	4,95	4,9500	1	19-Ago-24	2	1,90	1,81	1,99
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,12	7 225	6,350	103,81	104,28	104,01	104,0137	5,27	5,14	5,21	5,2100	2	19-Ago-24	16	3,64	3,46	3,99
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,11	13 176	5,940	102,11	102,43	102,27	102,2968	5,39	5,31	5,35	5,3438	5	19-Ago-24	21	4,06	3,86	4,49
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,13	18 748	6,950	105,64	106,16	105,87	105,8939	5,95	5,86	5,91	5,9069	31	19-Ago-24	69	5,77	5,45	6,99
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,12	20 617	6,150	99,92	100,36	100,16	100,1286	6,17	6,09	6,13	6,1307	24	19-Ago-24	65	6,51	6,14	7,99
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,14	17 480	7,300	106,25	106,82	106,39	106,4566	6,38	6,30	6,36	6,3507	7	19-Ago-24	14	6,91	6,50	8,99
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,10	16 635	5,400	91,90	91,94	91,87	91,9049	6,53	6,52	6,53	6,5240	69	19-Ago-24	157	7,84	7,36	9,99
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,13	19 730	6,900	100,54	101,17	100,79	100,7980	6,85	6,78	6,82	6,8191	9	19-Ago-24	104	8,91	8,34	12,99
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,01	15 436	7,600	106,49	106,58	106,58	106,5741	6,91	6,90	6,90	6,9009	33	19-Ago-24	220	9,44	8,83	14,99
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,10	11 168	5,350	85,00	85,60	85,39	85,2822	6,93	6,86	6,89	6,8967	16	19-Ago-24	43	10,61	9,92	15,99
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,13	5 033	6,850	98,6500	101,63	100,03	100,0257	7,00	6,70	6,86	6,8600	2	19-Ago-24	32	10,59	9,91	17,49
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,13	3 462	6,714	-	-	-	98,4337	-	-	-	6,8500	-	8-Ago-24	2	13,40	12,54	30,49
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,39	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6728	-	-	-	2,2767	-	31-Oct-22	2	0,15	0,15	0,16
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,05	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,2207	-	-	-	3,0215	-	18-Ago-23	20	5,18	5,03	5,49
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,38	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,5348	-	-	-	3,9985	-	10-Jun-22	10	7,95	7,64	10,46
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,06	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,6179	-	-	-	4,3192	-	10-Ago-23	50	12,27	11,76	15,49
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,07	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,4210	-	-	-	4,2779	-	21-Jul-22	2	14,99	14,37	21,99
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,06	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,9700	-	-	-	4,2723	-	12-Ago-21	10	18,27	17,53	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.

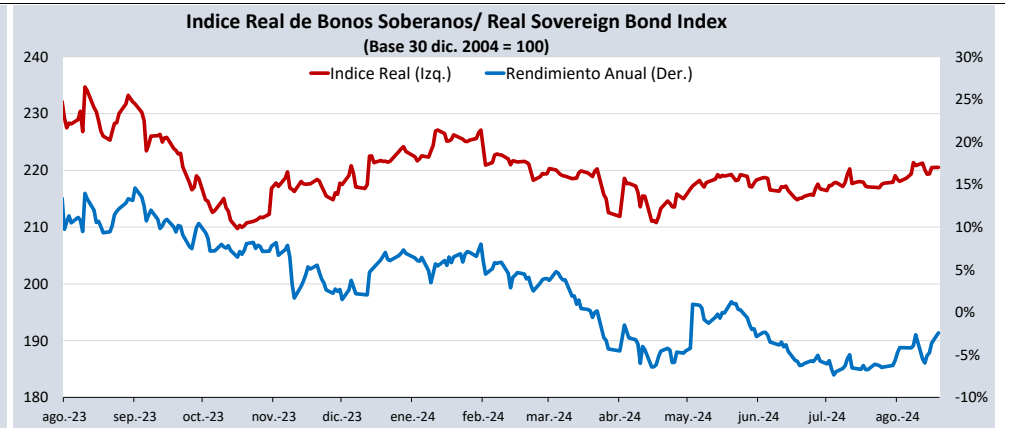
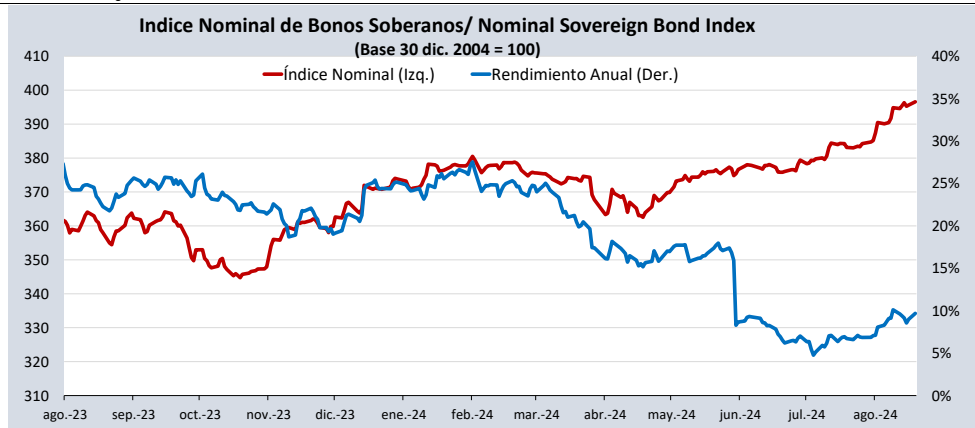
Bonos globales\*\*\*\* / Global bonds

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	102,1990	0,06	0,08	-0,47	4,8690	-8	-14	52	0,90	0,88	0,93
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5100	-0,01	0,20	-0,50	4,9570	1	-11	38	1,41	1,38	1,45
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9450	0,16	0,01	-0,54	3,5030	-12	0	39	1,43	1,40	1,47
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,8130	0,06	0,34	-0,50	4,5510	-2	-12	18	2,81	2,75	3,06
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,4350	0,20	0,50	-0,52	4,7390	-4	-10	11	5,37	5,24	5,92
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2860	0,13	0,02	-0,64	3,6880	-3	0	13	4,97	4,88	5,53
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,4740	0,25	1,00	-0,53	4,8950	-5	-19	10	5,88	5,74	6,52
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,5060	0,32	1,26	-0,52	4,9030	-5	-21	9	7,59	7,41	8,41
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,4500	0,48	1,50	-1,14	5,2420	-6	-18	14	6,74	6,57	9,39
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,3890	0,05	0,03	-0,95	4,0010	-1	0	15	8,03	7,87	8,68
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,0260	0,13	1,24	-0,61	5,0170	-2	-18	9	8,12	7,92	9,54
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	101,3850	0,37	1,09	-0,60	5,2010	-5	-14	8	8,15	7,94	10,63
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7460	0,08	-0,07	-0,69	4,2060	-1	1	8	10,67	10,45	12,43
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,1880	0,35	1,44	-0,88	5,3170	-4	-15	9	8,75	8,53	12,75
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,0180	0,25	1,58	-0,76	5,3120	-3	-17	8	12,08	11,77	16,80
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	101,6240	0,43	1,77	-0,66	5,5070	-3	-13	5	13,92	13,55	26,63
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	74,8040	0,25	1,83	-0,78	5,3350	-2	-16	7	15,50	15,10	26,94
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	103,3830	0,46	2,59	-0,57	5,6400	-3	-18	4	14,65	14,25	30,41
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,2660	0,47	1,78	-0,73	5,3280	-4	-17	7	18,60	18,12	36,81
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,2260	0,41	1,83	-0,79	5,5710	-4	-16	7	18,18	17,68	48,10
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	58,9590	0,48	1,70	-0,70	5,4980	-4	-16	6	18,82	18,31	98,35

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	397	1	2	9,69	69	6	2,72	4,89	8,78	12,93	13,44	11,91	9,96	12,86	10,80	6,20	3,28	2,22

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	-1	-2,43	119	304	29,64	2,48	38,20	6,43	12,90	10,35



Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOMBERG, 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.