



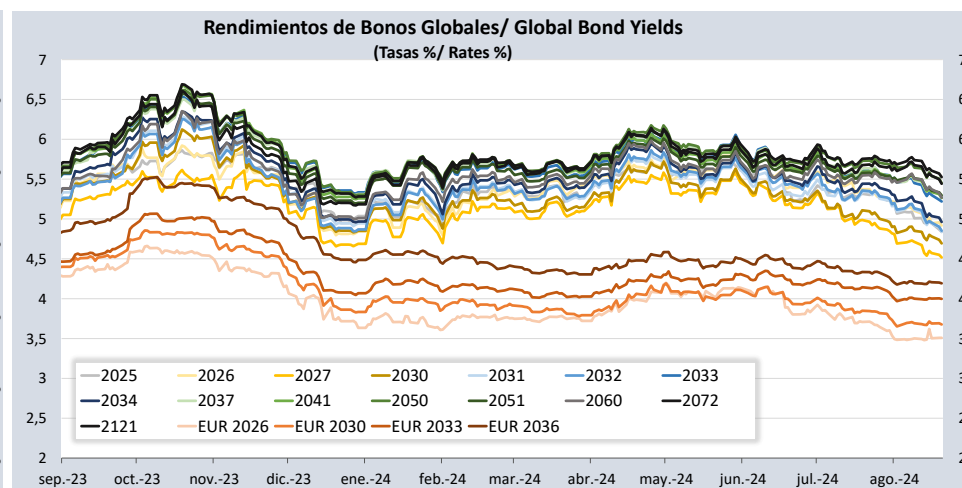
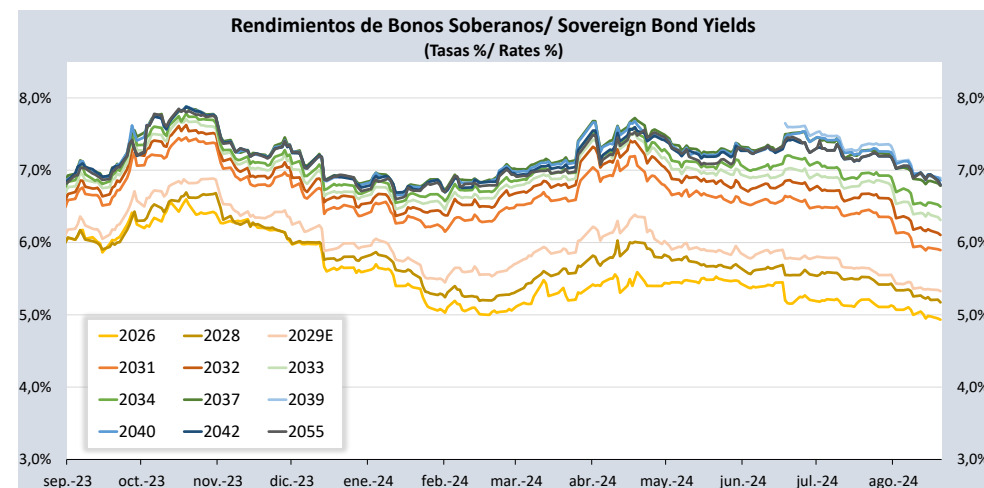
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

20/08/2024

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 (%)			Miles / 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	0,18	3 937	8,200	106,0094	106,04	106,05	106,0666	4,95	4,94	4,93	4,9327	4	20-Ago-24	15	1,89	1,80	1,98
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,14	7 225	6,350	104,00	104,40	104,08	104,1466	5,21	5,10	5,19	5,1724	2	20-Ago-24	17	3,63	3,46	3,98
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,13	13 176	5,940	102,27	102,39	102,31	102,3571	5,35	5,32	5,34	5,3282	23	20-Ago-24	71	4,06	3,86	4,48
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,15	19 198	6,950	105,87	106,04	105,81	105,9652	5,91	5,88	5,92	5,8942	29	20-Ago-24	196	5,76	5,44	6,98
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,13	20 617	6,150	100,30	100,19	100,13	100,2946	6,10	6,12	6,13	6,1037	48	20-Ago-24	275	6,51	6,14	7,98
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,16	17 480	7,300	106,39	106,84	106,52	106,7249	6,36	6,30	6,34	6,3118	24	20-Ago-24	53	6,91	6,50	8,98
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,12	16 635	5,400	91,80	92,14	91,87	92,1037	6,54	6,49	6,53	6,4949	39	20-Ago-24	157	7,84	7,36	9,98
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,15	19 730	6,900	100,62	100,92	101,13	101,0871	6,84	6,81	6,78	6,7848	13	20-Ago-24	171	8,92	8,35	12,98
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,03	15 436	7,600	106,39	106,72	106,49	106,6514	6,92	6,89	6,91	6,8927	29	20-Ago-24	64	9,44	8,83	14,98
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,12	11 618	5,350	85,34	85,64	85,34	85,6047	6,89	6,86	6,89	6,8589	29	20-Ago-24	105	10,62	9,94	15,98
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,15	5 033	6,850	98,6499	101,63	100,42	100,6175	7,00	6,70	6,82	6,8006	2	20-Ago-24	31	10,61	9,93	17,48
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,15	3 462	6,714	-	-	-	99,1721	-	-	-	6,7906	-	8-Ago-24	2	13,45	12,59	30,48
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,41	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6580	-	-	-	2,2932	-	31-Oct-22	2	0,15	0,15	0,15
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,06	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,2150	-	-	-	3,0227	-	18-Ago-23	20	5,18	5,03	5,48
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,40	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,6637	-	-	-	3,9848	-	10-Jun-22	10	7,94	7,64	10,45
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,07	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,6909	-	-	-	4,3122	-	10-Ago-23	50	12,26	11,76	15,48
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,08	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,9935	-	-	-	4,2355	-	21-Jul-22	2	15,01	14,40	21,98
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,07	383	3,26%+VAC	-	-	-	83,5925	-	-	-	4,2298	-	12-Ago-21	10	18,32	17,58	29,48

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.

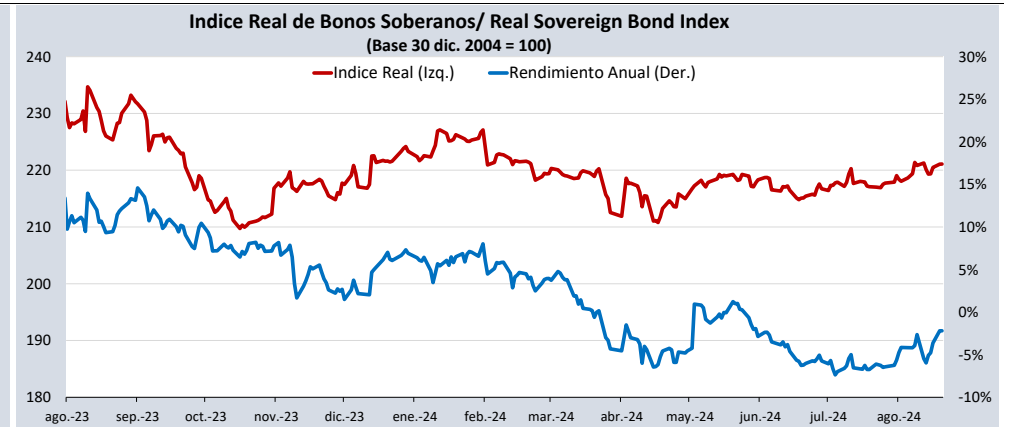
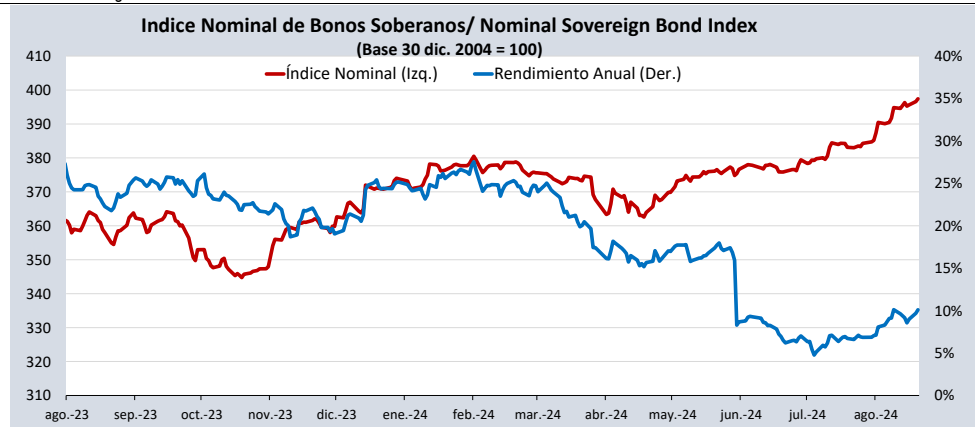
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,2190	0,02	0,05	-0,48	4,8390	-3	-11	54	0,90	0,88	0,93
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5690	0,06	0,13	-0,46	4,9180	-4	-6	35	1,41	1,37	1,45
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9410	0,00	-0,03	-0,48	3,5080	0	3	35	1,42	1,40	1,47
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9080	0,09	0,17	-0,49	4,5170	-3	-6	18	2,81	2,75	3,06
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,6530	0,22	0,38	-0,54	4,6940	-4	-7	11	5,36	5,24	5,92
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3460	0,07	-0,02	-0,60	3,6760	-1	0	12	4,97	4,88	5,53
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,7730	0,30	0,75	-0,53	4,8370	-6	-14	10	5,88	5,74	6,52
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,8110	0,31	0,99	-0,54	4,8520	-5	-16	9	7,59	7,41	8,40
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,6230	0,17	0,97	-0,90	5,2200	-2	-12	11	6,74	6,57	9,39
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4250	0,05	-0,02	-0,97	3,9970	-1	1	15	8,03	7,87	8,68
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,3950	0,37	0,96	-0,59	4,9630	-5	-14	9	8,12	7,92	9,54
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	101,8430	0,46	1,10	-0,48	5,1450	-6	-14	6	8,15	7,95	10,62
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,8550	0,07	-0,05	-0,69	4,1930	-1	1	9	10,67	10,45	12,42
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,6970	0,51	1,28	-0,94	5,2650	-5	-13	10	8,76	8,54	12,75
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,4820	0,46	1,44	-0,73	5,2630	-5	-15	8	12,09	11,78	16,80
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,4110	0,79	1,91	-0,64	5,4510	-6	-14	4	13,97	13,60	26,63
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,2600	0,46	1,59	-0,74	5,2960	-4	-14	6	15,53	15,13	26,94
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,1040	0,72	2,67	-0,60	5,5910	-5	-18	4	14,70	14,30	30,40
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,9240	0,66	1,78	-0,74	5,2680	-6	-17	7	18,70	18,22	36,81
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,7760	0,55	1,71	-0,76	5,5260	-4	-14	6	18,27	17,78	48,09
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,5770	0,62	1,59	-0,70	5,4420	-6	-15	6	19,00	18,50	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	10,09	41	70	2,72	4,89	8,77	12,91	13,44	11,92	9,96	12,87	10,79	6,21	3,29	2,23

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	-2,19	1	377	29,58	2,48	38,16	6,42	12,95	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.