



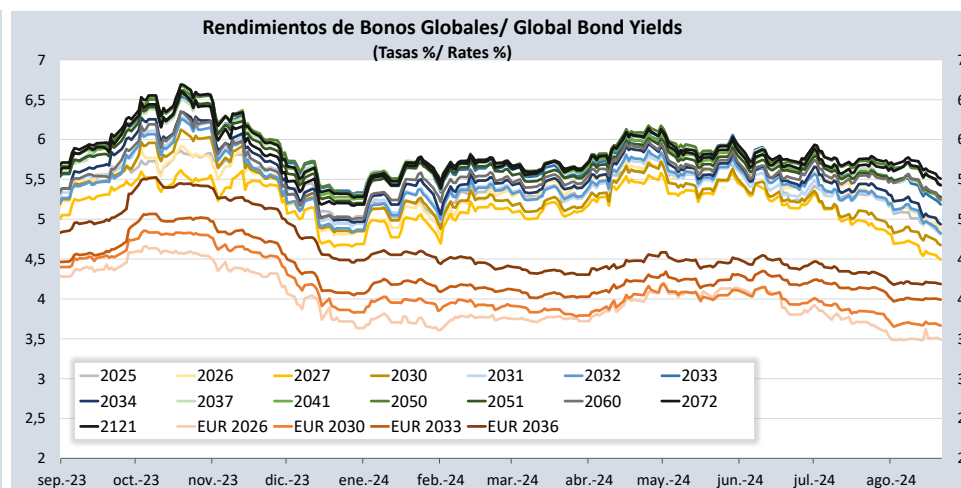
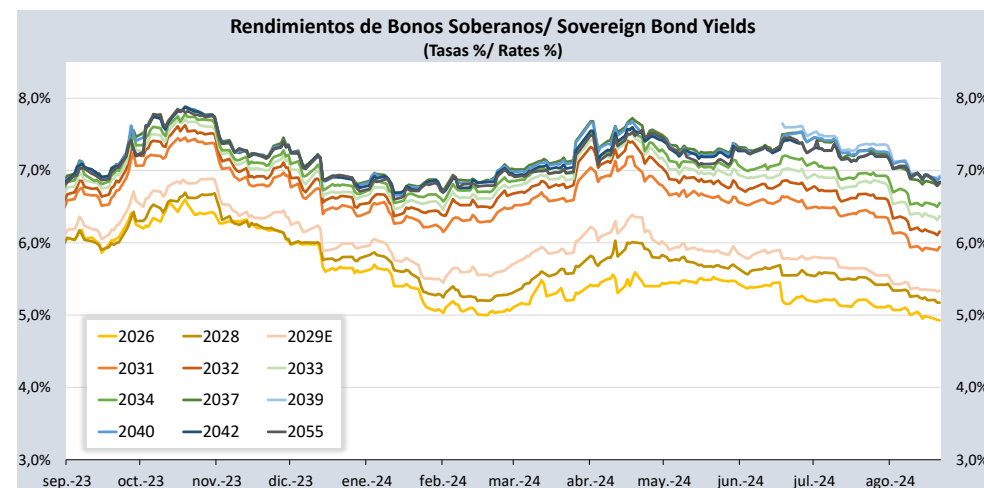
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

21/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente Millones \$ / Millions PEN	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 (%)			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. \$) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask												
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,20	3 937	8,200	105,9854	106,12	106,10	106,0727	4,95	4,88	4,89	4,9253	5	21-Ago-24	17	1,89	1,80	1,98
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,16	7 225	6,350	104,00	104,28	104,21	104,1447	5,21	5,13	5,15	5,1722	13	21-Ago-24	46	3,63	3,45	3,98
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,15	13 176	5,940	102,24	102,57	102,46	102,3214	5,36	5,27	5,30	5,3369	29	21-Ago-24	83	4,06	3,85	4,48
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,17	19 198	6,950	105,52	105,95	105,80	105,6796	5,97	5,90	5,92	5,9434	27	21-Ago-24	236	5,76	5,44	6,98
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,15	20 617	6,150	99,83	100,07	100,07	99,9809	6,18	6,14	6,14	6,1547	34	21-Ago-24	180	6,51	6,13	7,98
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,18	17 480	7,300	106,17	106,45	106,45	106,3407	6,39	6,35	6,35	6,3670	17	21-Ago-24	99	6,90	6,49	8,98
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,13	16 635	5,400	91,71	91,98	91,74	91,7233	6,56	6,52	6,55	6,5513	34	21-Ago-24	80	7,83	7,35	9,98
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,17	19 730	6,900	100,33	101,04	100,79	100,7848	6,88	6,79	6,82	6,8206	13	21-Ago-24	29	8,91	8,34	12,98
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,05	15 436	7,600	105,82	106,39	106,44	106,3168	6,98	6,92	6,92	6,9279	35	21-Ago-24	337	9,42	8,81	14,98
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,13	11 618	5,350	84,93	85,65	85,35	85,2518	6,94	6,86	6,89	6,9006	19	21-Ago-24	37	10,60	9,92	15,98
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,17	5 033	6,850	-	-	-	100,2012	-	-	-	6,8423	-	20-Ago-24	31	10,59	9,91	17,48
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,16	3 462	6,714	-	-	-	98,6526	-	-	-	6,8323	-	8-Ago-24	2	13,41	12,55	30,48
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,43	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6479	-	-	-	2,2795	-	31-Oct-22	2	0,15	0,14	0,15
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,07	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,0943	-	-	-	3,0470	-	18-Ago-23	20	5,18	5,02	5,48
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,42	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,1483	-	-	-	4,0366	-	10-Jun-22	10	7,94	7,63	10,45
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,08	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,3111	-	-	-	4,3497	-	10-Ago-23	50	12,25	11,74	15,48
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,09	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,4462	-	-	-	4,2761	-	21-Jul-22	2	14,98	14,37	21,98
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,08	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,9977	-	-	-	4,2705	-	12-Ago-21	10	18,27	17,52	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, BLOMBERG, DATATEC.

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

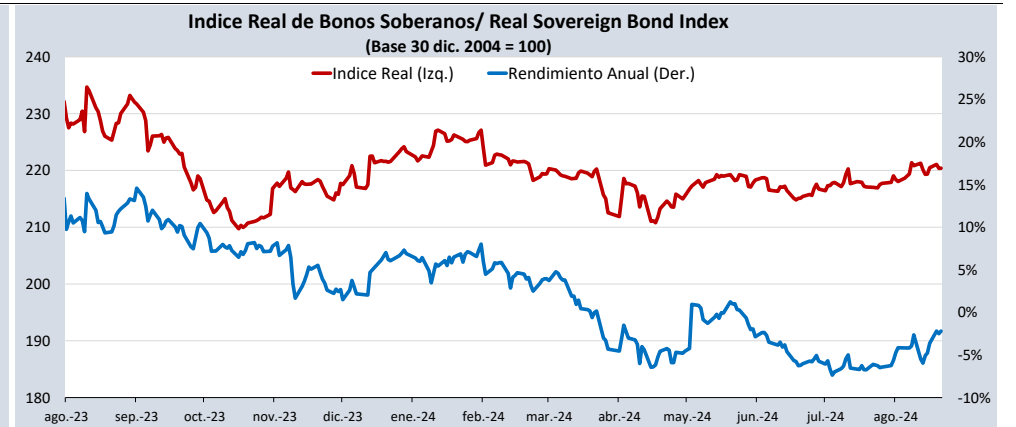
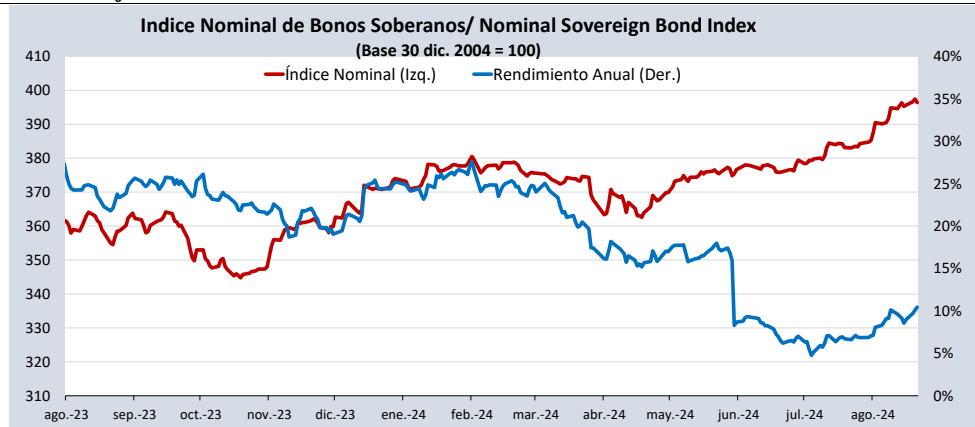
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	102,2200	0,00	0,06	-0,49	4,8310	-1	-11	54	0,90	0,88	0,93
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,6310	0,06	0,17	-0,51	4,8760	-4	-9	39	1,40	1,37	1,44
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9710	0,03	0,01	-0,54	3,4880	-2	0	40	1,42	1,40	1,46
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9770	0,07	0,14	-0,52	4,4920	-3	-5	19	2,80	2,74	3,05
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,7480	0,09	0,31	-0,55	4,6750	-2	-6	11	5,36	5,24	5,91
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3980	0,05	0,02	-0,64	3,6660	-1	0	13	4,96	4,87	5,52
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,9230	0,15	0,61	-0,53	4,8090	-3	-12	10	5,87	5,74	6,52
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,9840	0,17	0,78	-0,57	4,8240	-3	-13	10	7,59	7,41	8,40
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,9160	0,29	0,82	-0,99	5,1850	-4	-10	12	6,74	6,57	9,39
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4590	0,03	0,01	-0,97	3,9920	0	0	16	8,02	7,87	8,68
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,5790	0,18	0,64	-0,60	4,9360	-3	-9	9	8,12	7,92	9,54
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,0310	0,19	0,94	-0,55	5,1220	-2	-12	7	8,15	7,95	10,62
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,9070	0,05	-0,01	-0,70	4,1870	-1	0	9	10,67	10,45	12,42
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,9110	0,21	0,98	-0,91	5,2430	-2	-10	9	8,76	8,54	12,74
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,7170	0,23	1,04	-0,79	5,2380	-2	-11	8	12,10	11,79	16,79
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,6460	0,23	1,19	-0,63	5,4340	-2	-8	4	13,98	13,61	26,63
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,4670	0,21	1,06	-0,75	5,2780	-2	-9	6	15,55	15,15	26,94
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,3920	0,29	1,67	-0,60	5,5720	-2	-11	4	14,71	14,31	30,40
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,0910	0,17	1,23	-0,73	5,2530	-1	-11	7	18,72	18,24	36,81
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,9860	0,21	1,26	-0,78	5,5090	-2	-10	6	18,31	17,82	48,09
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,7680	0,19	1,15	-0,74	5,4250	-2	-11	7	19,06	18,55	98,34

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	-1	0	10,43	33	127	2,72	4,91	8,79	12,92	13,44	11,91	9,95	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	220	0	1	-2,19	31	289	29,68	2,48	38,14	6,41	12,92	10,37



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](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.