



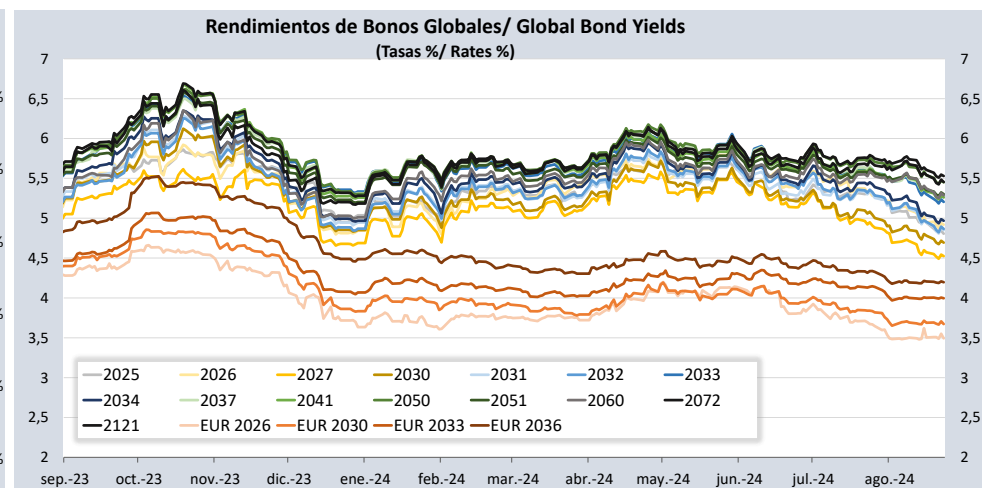
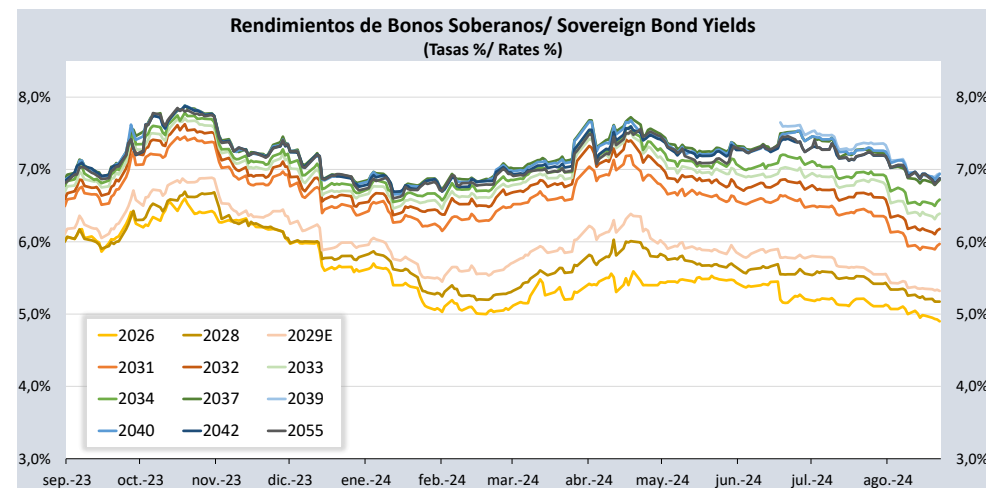
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

22/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

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	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. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
				Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask												
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,22	3 937	8,200	105,9963	106,13	106,07	106,1130	4,94	4,87	4,90	4,9000	3	22-Ago-24	14	1,89	1,80	1,98
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,17	7 225	6,350	103,96	104,28	104,14	104,1395	5,22	5,13	5,17	5,1729	4	22-Ago-24	35	3,63	3,45	3,98
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,16	13 176	5,940	102,24	102,50	102,46	102,3852	5,36	5,29	5,30	5,3204	6	22-Ago-24	25	4,06	3,85	4,48
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,19	19 198	6,950	105,34	105,90	105,63	105,5254	6,00	5,90	5,95	5,9699	38	22-Ago-24	393	5,76	5,43	6,98
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,17	20 617	6,150	99,70	100,03	99,83	99,8349	6,20	6,15	6,18	6,1785	35	22-Ago-24	208	6,50	6,12	7,98
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,20	17 480	7,300	105,90	106,57	106,24	106,1851	6,43	6,33	6,38	6,3893	42	22-Ago-24	373	6,90	6,49	8,98
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,15	16 635	5,400	91,23	91,84	91,51	91,5079	6,63	6,54	6,59	6,5835	16	22-Ago-24	30	7,83	7,34	9,98
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,19	19 730	6,900	100,37	100,94	100,44	100,4981	6,87	6,80	6,86	6,8547	20	22-Ago-24	327	8,90	8,33	12,98
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,07	15 436	7,600	106,20	106,51	106,25	106,1696	6,94	6,91	6,94	6,9434	15	22-Ago-24	151	9,42	8,81	14,98
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,15	11 618	5,350	84,45	85,27	84,88	84,9448	7,00	6,90	6,95	6,9371	10	22-Ago-24	322	10,59	9,90	15,98
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,19	5 033	6,850	-	-	-	99,8389	-	-	-	6,8788	-	20-Ago-24	31	10,57	9,89	17,48
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,18	3 462	6,714	-	-	-	98,2016	-	-	-	6,8688	-	8-Ago-24	2	13,37	12,51	30,48
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,45	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6426	-	-	-	2,2316	-	31-Oct-22	2	0,14	0,14	0,14
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,08	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,0912	-	-	-	3,0477	-	18-Ago-23	20	5,17	5,02	5,48
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,44	911	7,39% + VAC	-	-	-	127,8311	-	-	-	4,0684	-	10-Jun-22	10	7,93	7,62	10,44
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,09	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,0547	-	-	-	4,3752	-	10-Ago-23	50	12,24	11,73	15,48
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,10	424	3,83% + VAC	-	-	-	92,9686	-	-	-	4,3118	-	21-Jul-22	2	14,96	14,34	21,98
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,09	383	3,26%+VAC	-	-	-	82,4811	-	-	-	4,3062	-	12-Ago-21	10	18,23	17,48	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.

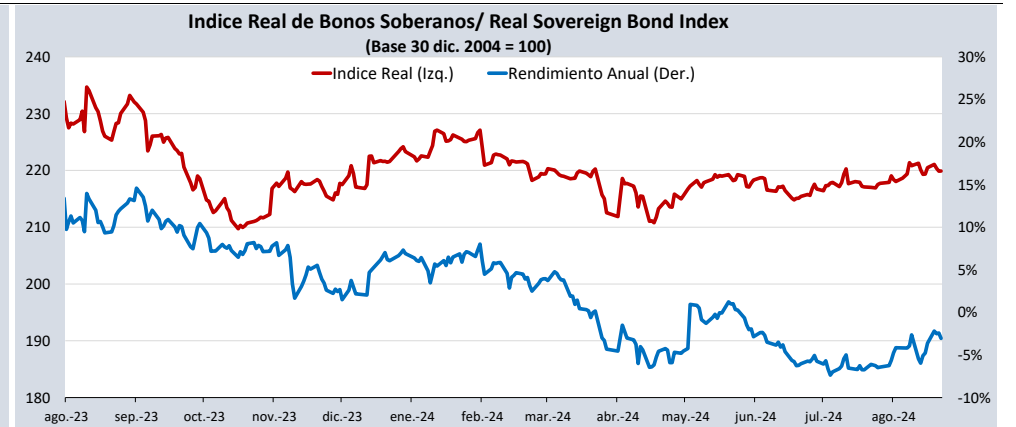
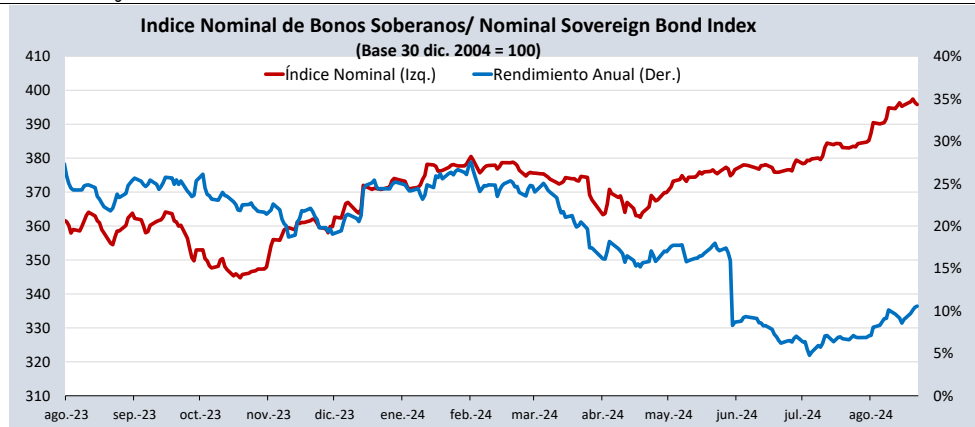
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,2010	-0,02	0,07	-0,49	4,8440	1	-12	55	0,90	0,88	0,93
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5550	-0,08	0,15	-0,50	4,9380	6	-8	38	1,40	1,37	1,44
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,8910	-0,08	0,11	-0,53	3,5510	6	-7	39	1,42	1,39	1,46
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,8360	-0,14	0,16	-0,50	4,5440	5	-6	18	2,80	2,74	3,05
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,5530	-0,20	0,43	-0,51	4,7170	4	-9	11	5,36	5,23	5,91
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,2000	-0,20	0,04	-0,69	3,7060	4	-1	14	4,96	4,87	5,52
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,5660	-0,36	0,50	-0,52	4,8790	7	-9	10	5,87	5,73	6,51
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,5720	-0,41	0,51	-0,57	4,8940	7	-8	10	7,58	7,40	8,40
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,4760	-0,44	0,75	-1,03	5,2360	5	-10	12	6,73	6,56	9,38
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4010	-0,06	0,06	-0,95	4,0040	1	0	15	8,02	7,86	8,68
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,2370	-0,34	0,58	-0,59	4,9870	5	-8	9	8,11	7,91	9,54
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	101,6670	-0,36	0,88	-0,50	5,1660	4	-11	6	8,14	7,94	10,62
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7570	-0,15	0,09	-0,67	4,2070	2	-1	8	10,66	10,44	12,42
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,4190	-0,49	0,91	-0,84	5,2930	5	-9	9	8,75	8,52	12,74
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,3040	-0,41	0,85	-0,74	5,2820	4	-9	8	12,08	11,77	16,79
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,0980	-0,55	1,57	-0,57	5,4730	4	-11	4	13,94	13,57	26,62
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	74,9510	-0,52	0,82	-0,77	5,3230	5	-7	7	15,50	15,10	26,93
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	103,7920	-0,60	1,49	-0,60	5,6120	4	-10	4	14,67	14,27	30,40
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,4300	-0,66	1,01	-0,68	5,3140	6	-9	6	18,62	18,14	36,81
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,5170	-0,47	1,06	-0,80	5,5470	4	-9	7	18,22	17,73	48,09
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,1070	-0,66	0,90	-0,77	5,4850	6	-8	7	18,85	18,35	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	1	10,56	13	200	2,73	4,91	8,81	12,92	13,44	11,91	9,94	12,85	10,79	6,19	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	220	0	1	-3,05	-63	172	29,75	2,49	38,14	6,41	12,88	10,33



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.