



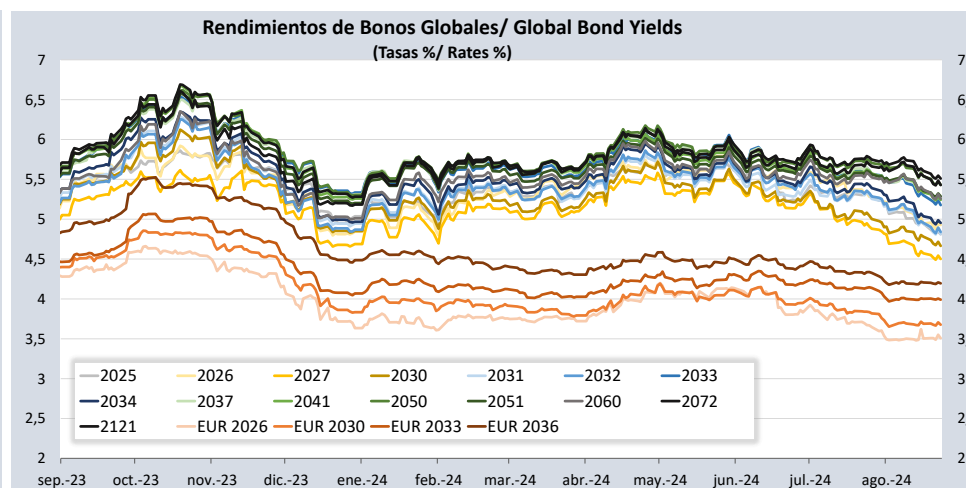
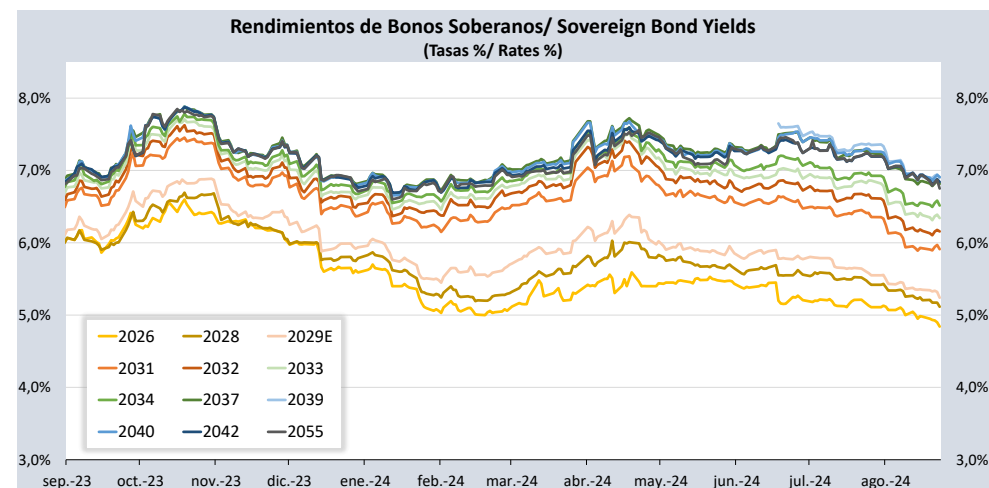
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

23/08/2024

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	0,25	3 937	8,200	-	-	-	106,2160	-	-	-	4,8419	-	22-Ago-24	14	1,88	1,80	1,97
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,19	7 225	6,350	104,21	104,44	104,39	104,3461	5,15	5,09	5,10	5,1148	11	23-Ago-24	20	3,63	3,45	3,97
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,18	13 176	5,940	102,46	102,79	102,73	102,7017	5,30	5,22	5,23	5,2400	4	23-Ago-24	8	4,05	3,85	4,47
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,21	19 198	6,950	105,60	105,86	105,74	105,8566	5,96	5,91	5,93	5,9120	9	23-Ago-24	45	5,76	5,43	6,97
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,18	20 617	6,150	99,83	100,10	99,95	99,9702	6,18	6,14	6,16	6,1564	13	23-Ago-24	39	6,50	6,12	7,97
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,22	17 480	7,300	106,24	106,65	106,45	106,5105	6,38	6,32	6,35	6,3420	18	23-Ago-24	51	6,90	6,49	8,97
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,16	16 635	5,400	91,70	92,08	91,88	91,9691	6,56	6,50	6,53	6,5154	46	23-Ago-24	219	7,83	7,35	9,97
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,21	19 730	6,900	100,66	101,04	100,87	100,8340	6,84	6,79	6,81	6,8147	21	23-Ago-24	91	8,90	8,34	12,97
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,09	15 436	7,600	106,39	106,48	106,48	106,5676	6,92	6,91	6,91	6,9013	17	23-Ago-24	111	9,43	8,82	14,97
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,16	11 618	5,350	84,87	85,18	85,18	85,1883	6,95	6,91	6,91	6,9084	17	23-Ago-24	111	10,59	9,91	15,97
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,20	5 033	6,850	-	-	-	100,2158	-	-	-	6,8408	-	20-Ago-24	31	10,58	9,91	17,47
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,20	3 462	6,714	-	-	99,68	99,6817	-	-	6,75	6,7500	1	23-Ago-24	2	13,48	12,63	30,47
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,47	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,6384	-	-	-	2,1748	-	31-Oct-22	2	0,14	0,14	0,14
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,09	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,4392	-	-	-	2,9780	-	18-Ago-23	20	5,17	5,02	5,47
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,46	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,4349	-	-	-	4,0062	-	10-Jun-22	10	7,93	7,63	10,44
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,09	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,4068	-	-	-	4,3406	-	10-Ago-23	50	12,25	11,74	15,47
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,11	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,8338	-	-	-	4,2474	-	21-Jul-22	2	14,99	14,38	21,97
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,10	383	3,26%+VAC	-	-	-	84,0893	-	-	-	4,1963	-	12-Ago-21	10	18,35	17,61	29,47

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).



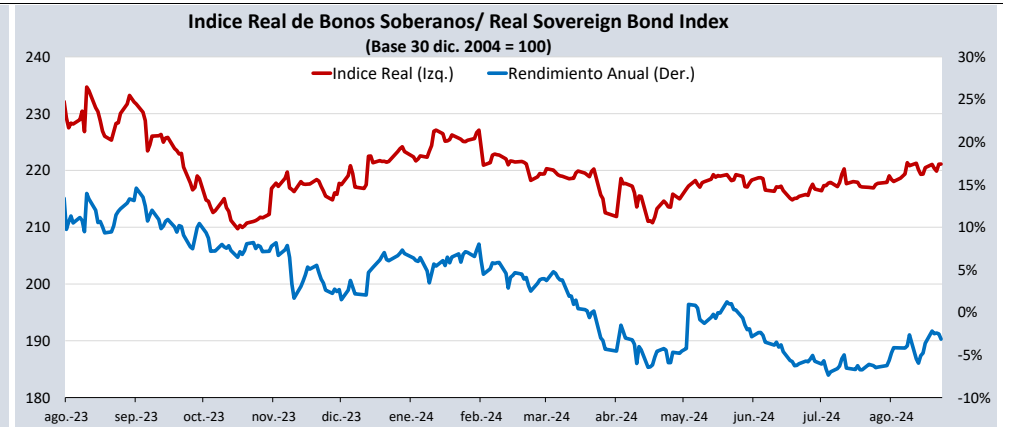
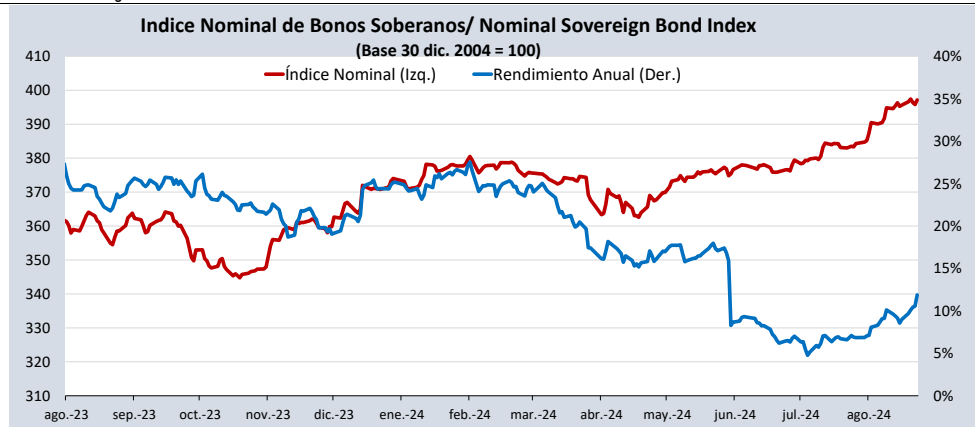
Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOMBERG, DATATEC.

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	102,2100	0,01	0,07	-0,48	4,8110	-3	-14	54	0,89	0,87	0,92
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5890	0,03	0,07	-0,49	4,9270	-1	-2	37	1,40	1,37	1,44
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9530	0,06	0,01	-0,48	3,5070	-4	0	35	1,42	1,39	1,46
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9560	0,12	0,20	-0,51	4,5010	-4	-7	19	2,80	2,74	3,05
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,8100	0,26	0,58	-0,52	4,6650	-5	-12	11	5,36	5,23	5,91
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3460	0,15	0,06	-0,60	3,6760	-3	-1	12	4,96	4,87	5,52
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,9100	0,34	0,69	-0,51	4,8140	-6	-13	10	5,87	5,73	6,51
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,9100	0,34	0,72	-0,50	4,8400	-5	-12	8	7,58	7,40	8,39
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,9450	0,47	0,98	-0,98	5,1780	-6	-12	12	6,74	6,57	9,38
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,4940	0,09	0,11	-0,97	3,9900	-1	-1	15	8,02	7,86	8,67
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,4740	0,24	0,58	-0,60	4,9530	-3	-8	9	8,11	7,91	9,53
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,0110	0,34	1,00	-0,47	5,1240	-4	-12	6	8,14	7,94	10,61
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,8550	0,10	0,11	-0,68	4,1960	-1	-1	8	10,66	10,44	12,41
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,8420	0,42	1,01	-0,93	5,2490	-4	-11	9	8,76	8,53	12,74
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,6790	0,38	0,91	-0,74	5,2430	-4	-9	8	12,09	11,78	16,79
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,6870	0,59	1,50	-0,59	5,4310	-4	-11	4	13,98	13,61	26,62
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,3840	0,43	0,83	-0,76	5,2860	-4	-7	6	15,53	15,13	26,93
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,3640	0,57	1,44	-0,63	5,5730	-4	-10	4	14,71	14,31	30,39
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,0390	0,61	1,24	-0,74	5,2580	-6	-11	7	18,71	18,23	36,80
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,9520	0,44	1,13	-0,77	5,5110	-4	-9	6	18,30	17,81	48,09
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,7150	0,61	1,24	-0,74	5,4290	-6	-11	7	19,04	18,54	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	397	1	2	11,88	131	288	2,72	4,91	8,81	12,92	13,41	11,91	9,96	12,85	10,80	6,19	3,28	2,25
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	-3,14	-62	48	29,59	2,48	38,12	6,40	12,93	10,47						



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.