



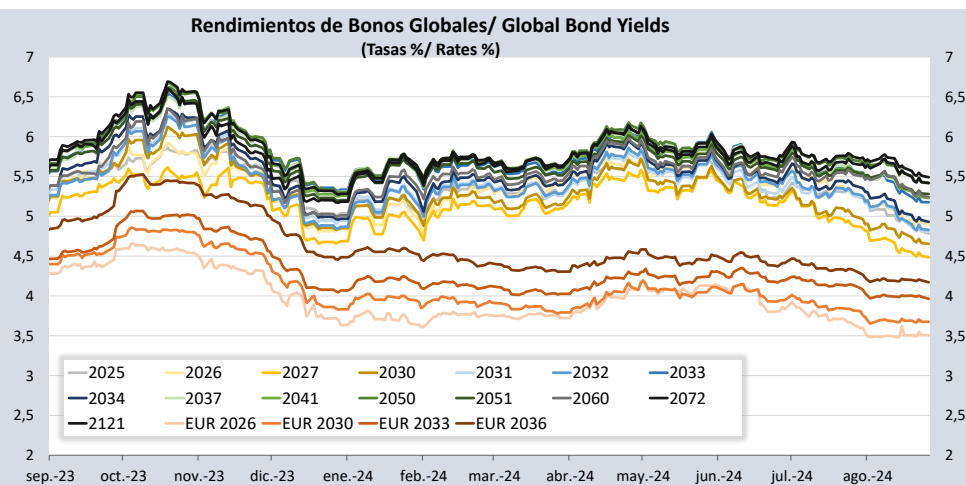
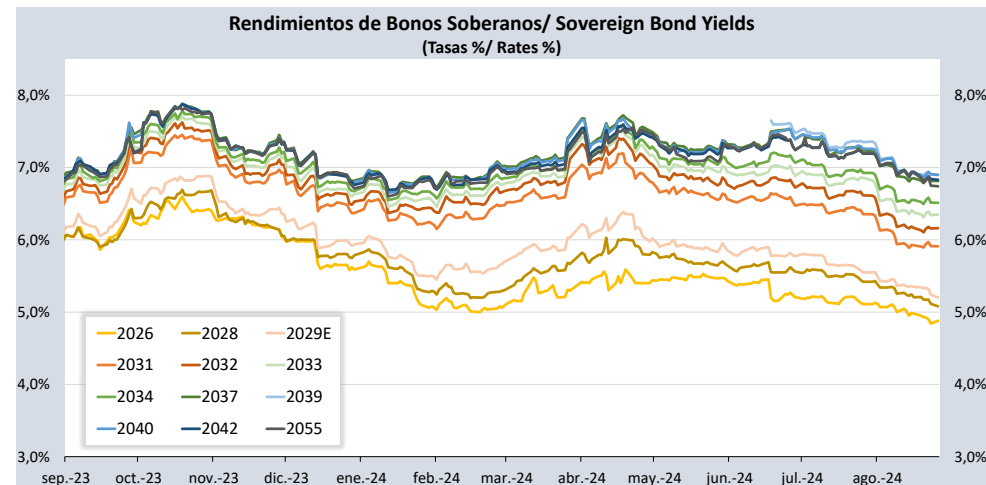
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

26/08/2024

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 / Descripción	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	0,31	3 937	8,200	106,0560	106,15	106,09	106,1185	4,90	4,85	4,88	4,8800	1	26-Ago-24	2	1,88	1,79	1,97
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,24	7 225	6,350	104,37	104,63	104,45	104,4632	5,10	5,03	5,08	5,0800	3	26-Ago-24	5	3,62	3,44	3,97
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,23	13 176	5,940	102,69	102,93	102,85	102,8507	5,24	5,18	5,20	5,2012	10	26-Ago-24	36	4,05	3,85	4,47
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,26	19 198	6,950	105,68	105,91	105,80	105,8565	5,94	5,90	5,92	5,9110	28	26-Ago-24	82	5,75	5,43	6,97
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,23	20 617	6,150	99,66	99,95	99,83	99,9406	6,21	6,16	6,18	6,1612	18	26-Ago-24	63	6,49	6,11	7,97
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,28	17 480	7,300	106,31	106,50	106,34	106,4406	6,37	6,34	6,37	6,3514	37	26-Ago-24	227	6,89	6,48	8,97
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,21	16 635	5,400	91,71	92,01	91,81	91,9966	6,56	6,51	6,54	6,5120	33	26-Ago-24	293	7,82	7,34	9,97
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,26	19 730	6,900	100,62	100,83	100,70	100,8527	6,84	6,82	6,83	6,8124	11	26-Ago-24	96	8,90	8,33	12,97
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,16	15 436	7,600	106,39	106,67	106,39	106,5959	6,92	6,89	6,92	6,8981	22	26-Ago-24	141	9,42	8,81	14,97
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,20	11 618	5,350	85,10	85,44	85,18	85,2709	6,92	6,88	6,91	6,8991	21	26-Ago-24	122	10,59	9,91	15,97
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,26	5 033	6,850	-	-	-	100,3079	-	-	-	6,8315	-	20-Ago-24	31	10,58	9,90	17,47
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,26	3 462	6,714	-	-	-	99,7988	-	-	-	6,7407	-	23-Ago-24	2	13,48	12,63	30,47
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,52	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,5686	-	-	-	2,4140	-	31-Oct-22	2	0,13	0,13	0,14
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,11	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,7580	-	-	-	2,9144	-	18-Ago-23	20	5,16	5,02	5,47
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,52	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,8511	-	-	-	3,9621	-	10-Jun-22	10	7,93	7,63	10,44
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,12	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,8917	-	-	-	4,2935	-	10-Ago-23	50	12,25	11,75	15,47
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,15	424	3,83% + VAC	-	-	-	94,5152	-	-	-	4,1973	-	21-Jul-22	2	15,01	14,41	21,97
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,12	383	3,26%+VAC	-	-	-	84,8388	-	-	-	4,1462	-	12-Ago-21	10	18,40	17,66	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, BLOOMBERG, DATATEC.

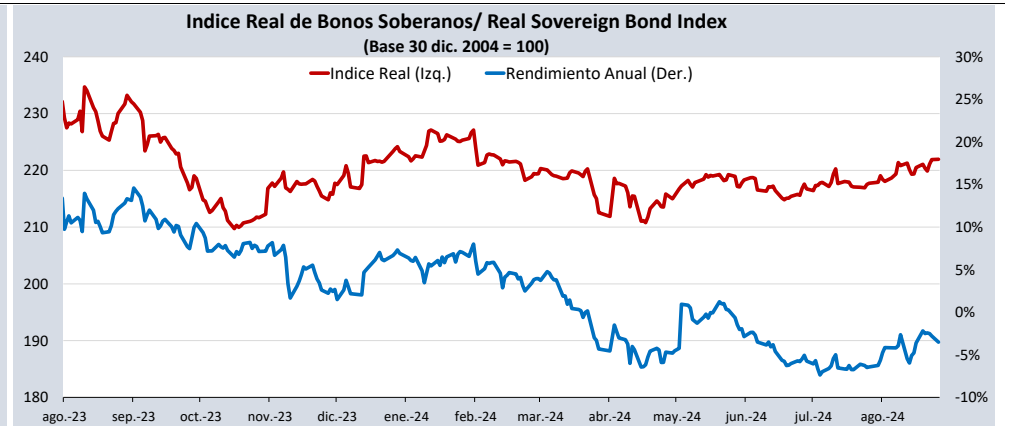
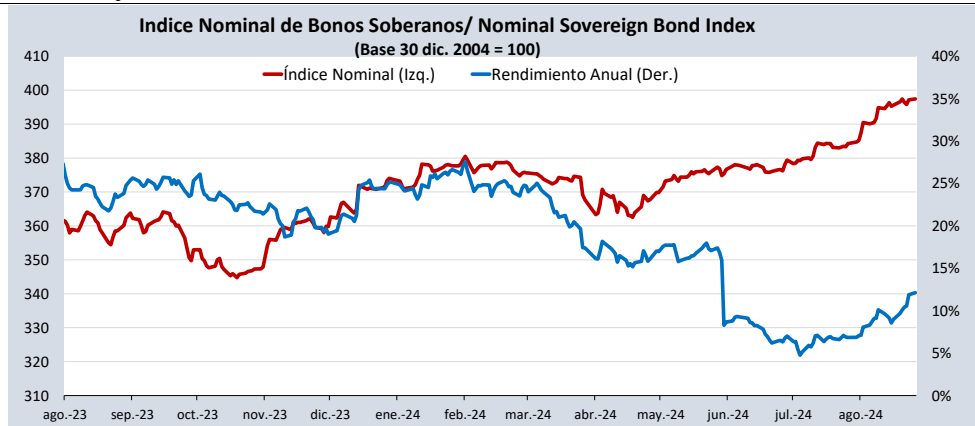
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,2290	0,02	0,03	-0,47	4,7820	-3	-9	53	0,89	0,86	0,91
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,6380	0,05	0,13	-0,49	4,8950	-3	-6	37	1,39	1,36	1,43
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9530	0,00	0,01	-0,48	3,5070	0	0	35	1,41	1,38	1,45
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9990	0,04	0,19	-0,50	4,4860	-2	-7	18	2,85	2,79	3,04
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,8680	0,06	0,43	-0,50	4,6540	-1	-9	11	5,35	5,23	5,90
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3460	0,00	0,07	-0,60	3,6760	0	-1	12	4,95	4,86	5,51
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,9710	0,06	0,50	-0,48	4,8030	-1	-9	9	5,86	5,72	6,50
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,9760	0,07	0,47	-0,49	4,8300	-1	-7	8	7,57	7,39	8,39
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,9570	0,01	0,51	-0,97	5,1760	0	-7	12	6,73	6,56	9,37
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,6640	0,17	0,29	-0,84	3,9640	-3	-4	13	8,01	7,85	8,66
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,6340	0,16	0,61	-0,59	4,9300	-2	-9	9	8,10	7,91	9,53
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,2080	0,20	0,82	-0,51	5,0990	-2	-10	6	8,14	7,94	10,61
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,0490	0,19	0,27	-0,73	4,1720	-2	-3	9	10,66	10,44	12,41
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	112,0230	0,18	0,83	-0,90	5,2310	-2	-9	9	8,75	8,53	12,73
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,8240	0,14	0,81	-0,75	5,2280	-2	-8	8	12,09	11,78	16,78
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,8490	0,16	1,23	-0,62	5,4200	-1	-9	4	13,98	13,61	26,61
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,4520	0,07	0,65	-0,74	5,2800	-1	-5	6	15,53	15,13	26,92
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,7330	0,37	1,35	-0,57	5,5490	-2	-9	4	14,72	14,32	30,39
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,2380	0,20	0,97	-0,68	5,2410	-2	-9	6	18,73	18,25	36,79
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	68,2170	0,27	0,99	-0,75	5,4900	-2	-8	6	18,34	17,85	48,08
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,8660	0,15	0,91	-0,71	5,4160	-1	-8	6	19,08	18,57	98,33

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	0	1	12,12	24	243	2,72	4,91	8,82	12,91	13,41	11,90	9,96	12,85	10,80	6,20	3,29	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	222	0	1	-3,52	-72	-132	29,48	2,48	38,11	6,42	12,98	10,53



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.