



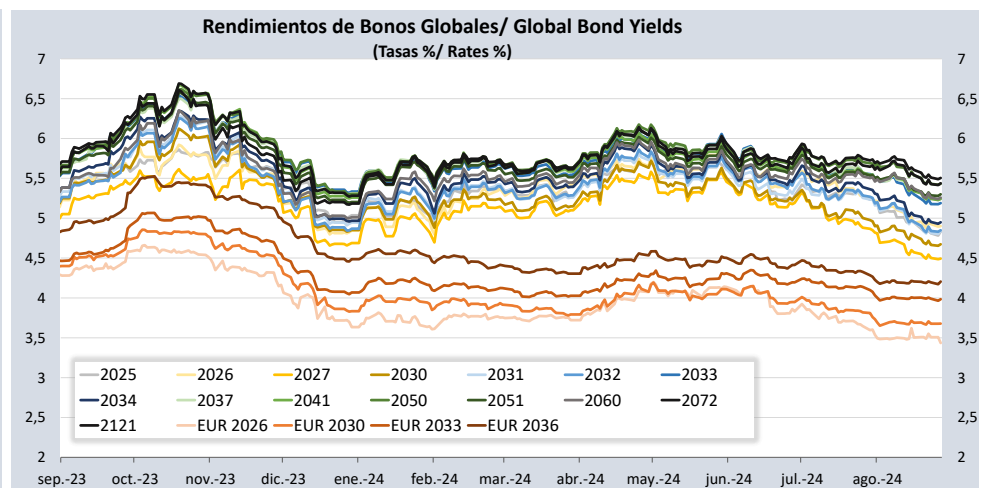
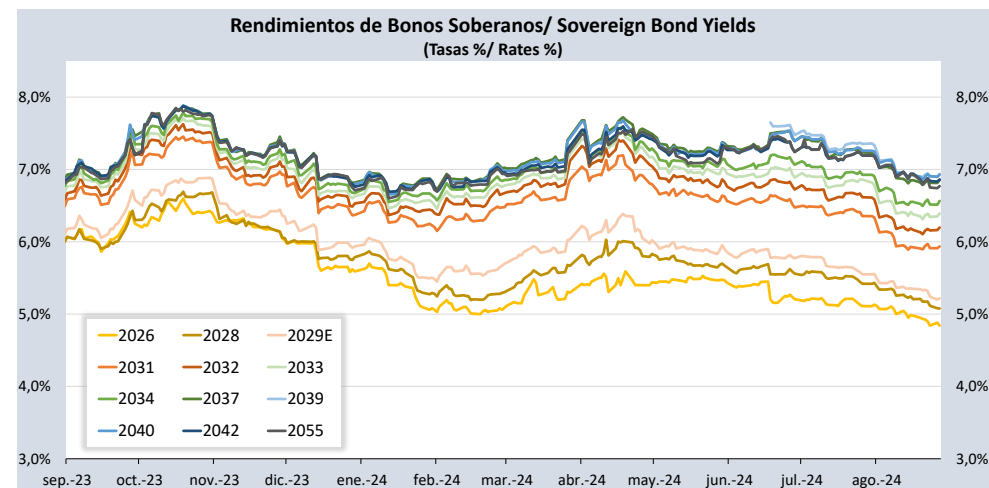
**PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT**

27/08/2024

**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	0,33	3 937	8,200	-	-	-	106,1864	-	-	-	4,8400	-	27-Ago-24	1	1,87	1,79	1,96
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,26	7 225	6,350	104,42	104,52	104,48	104,4708	5,09	5,06	5,07	5,0771	2	27-Ago-24	7	3,62	3,44	3,96
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,24	13 176	5,940	102,73	102,84	102,78	102,7869	5,23	5,20	5,22	5,2169	12	27-Ago-24	48	4,04	3,84	4,46
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,28	19 198	6,950	105,60	105,91	105,91	105,7124	5,95	5,90	5,90	5,9357	59	27-Ago-24	338	5,74	5,42	6,96
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,25	20 617	6,150	99,70	99,89	99,83	99,7203	6,20	6,17	6,18	6,1972	67	27-Ago-24	217	6,49	6,11	7,96
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,30	17 480	7,300	106,18	106,30	106,23	106,1623	6,39	6,37	6,38	6,3915	16	27-Ago-24	165	6,89	6,47	8,96
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,22	16 635	5,400	91,57	91,75	91,68	91,6462	6,58	6,55	6,56	6,5641	36	27-Ago-24	167	7,81	7,33	9,96
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,28	19 730	6,900	100,45	100,62	100,62	100,5114	6,86	6,84	6,84	6,8530	27	27-Ago-24	223	8,88	8,31	12,96
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,18	15 436	7,600	106,29	106,38	106,29	106,2335	6,93	6,92	6,93	6,9363	29	27-Ago-24	143	9,41	8,80	14,96
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,22	11 618	5,350	84,85	85,27	85,10	85,0247	6,95	6,90	6,92	6,9284	8	27-Ago-24	53	10,58	9,89	15,96
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,28	5 033	6,850	-	-	-	100,0166	-	-	-	6,8608	-	20-Ago-24	31	10,57	9,89	17,46
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,27	3 462	6,714	-	-	-	99,4295	-	-	-	6,7700	-	23-Ago-24	2	13,45	12,60	30,46
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,54	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,5643	-	-	-	2,3570	-	31-Oct-22	2	0,13	0,13	0,13
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,12	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,5870	-	-	-	2,9486	-	18-Ago-23	20	5,16	5,01	5,46
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,54	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,2087	-	-	-	4,0268	-	10-Jun-22	10	7,92	7,61	10,43
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,13	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,3993	-	-	-	4,3420	-	10-Ago-23	50	12,24	11,73	15,46
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,16	424	3,83% + VAC	-	-	-	93,9153	-	-	-	4,2415	-	21-Jul-22	2	14,98	14,37	21,96
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,13	383	3,26%+VAC	-	-	-	84,1798	-	-	-	4,1904	-	12-Ago-21	10	18,34	17,61	29,46

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

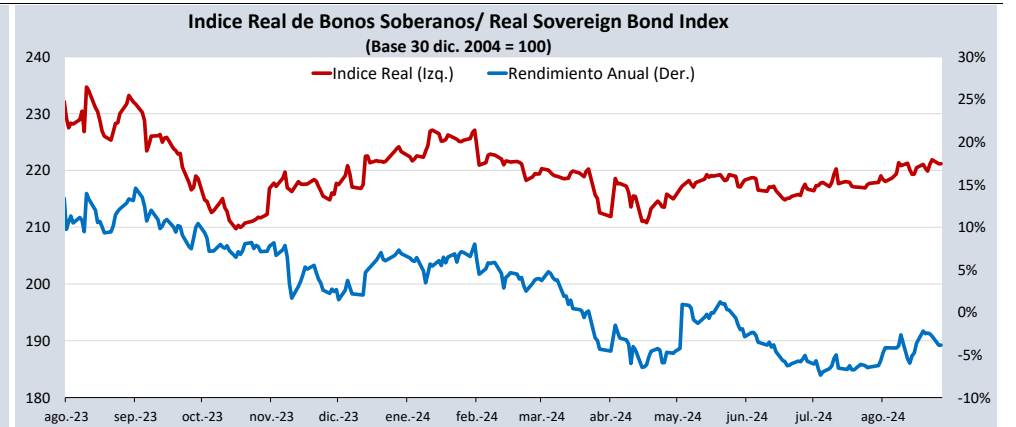
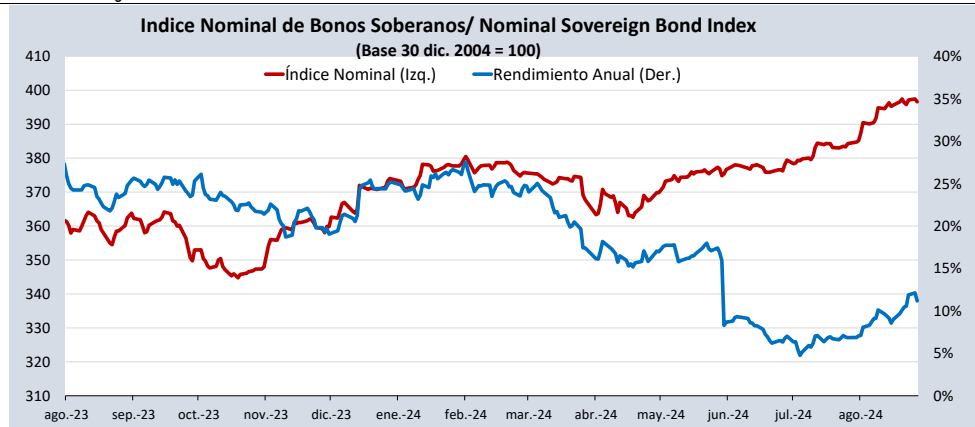
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	102,1770	-0,05	-0,04	-0,45	4,8330	5	-1	51	0,88	0,86	0,91
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,6350	0,00	0,07	-0,47	4,9020	1	-2	36	1,39	1,35	1,43
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,0560	0,10	0,11	-0,76	3,4340	-7	-7	56	1,40	1,38	1,45
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9810	-0,02	0,07	-0,49	4,4930	1	-2	18	2,85	2,78	3,04
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,7760	-0,09	0,12	-0,54	4,6740	2	-2	11	5,34	5,22	5,90
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3380	-0,01	-0,01	-0,78	3,6780	0	0	16	4,95	4,86	5,51
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,7900	-0,18	0,02	-0,57	4,8390	4	0	11	5,86	5,72	6,50
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,8630	-0,11	0,05	-0,55	4,8500	2	0	9	7,57	7,39	8,38
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,8460	-0,11	0,22	-0,99	5,1890	1	-3	12	6,72	6,55	9,37
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,5430	-0,12	0,12	-0,97	3,9840	2	-1	16	8,01	7,85	8,66
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,5090	-0,13	0,11	-0,60	4,9490	2	-1	9	8,10	7,90	9,52
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,1530	-0,05	0,31	-0,51	5,1060	1	-4	6	8,13	7,93	10,60
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7850	-0,26	-0,07	-0,73	4,2050	3	1	9	10,65	10,43	12,40
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,9120	-0,11	0,22	-0,90	5,2420	1	-2	9	8,75	8,52	12,73
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,6830	-0,14	0,20	-0,76	5,2430	2	-2	8	12,08	11,77	16,78
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,6640	-0,19	0,25	-0,40	5,4330	1	-2	3	13,96	13,59	26,61
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,2200	-0,23	-0,04	-0,77	5,3000	2	0	7	15,51	15,11	26,92
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,6270	-0,11	0,52	-0,58	5,5560	1	-4	4	14,71	14,31	30,38
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	60,0340	-0,20	0,11	-0,63	5,2590	2	-1	6	18,70	18,22	36,79
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	68,0270	-0,19	0,25	-0,75	5,5050	1	-2	6	18,30	17,81	48,08
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,6160	-0,25	0,04	-0,71	5,4380	2	0	6	19,00	18,49	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	-1	-1	11,17	-95	108	2,73	4,92	8,83	12,93	13,41	11,90	9,94	12,84	10,79	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	-3,85	1	-134	29,60	2,49	38,07	6,40	12,95	10,49



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.