



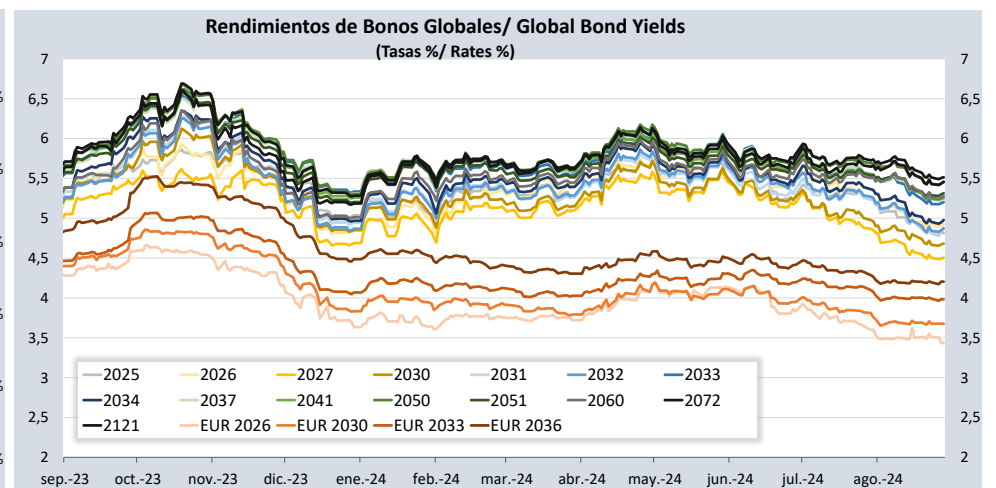
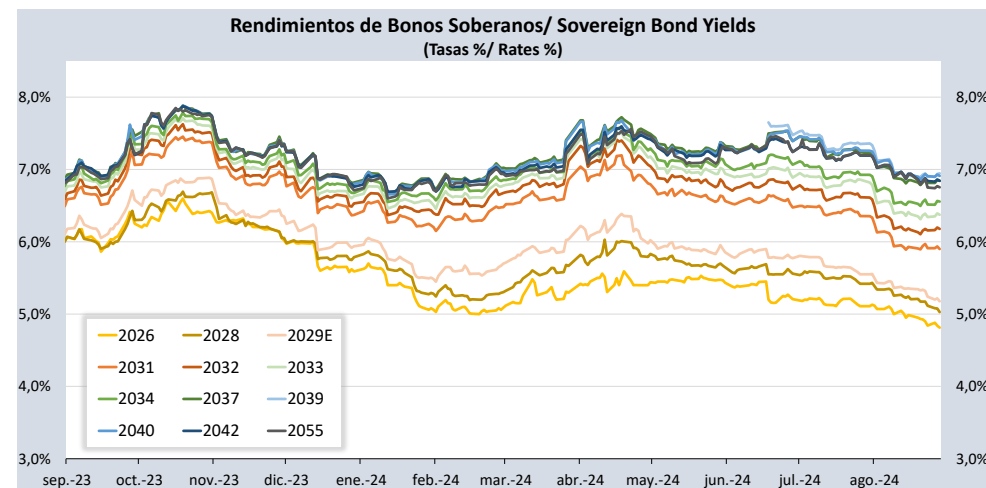
**PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT**

28/08/2024

**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)			
				Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask												
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	0,36	3 937	8,200	106,1284	106,39	106,24	106,2285	4,84	4,70	4,78	4,8135	7	28-Ago-24	20	1,87	1,79	1,96
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,28	7 225	6,350	104,42	104,73	104,66	104,6451	5,09	5,00	5,02	5,0280	3	28-Ago-24	5	3,61	3,44	3,96
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,26	13 176	5,940	102,86	102,92	102,96	102,9410	5,20	5,18	5,17	5,1776	10	28-Ago-24	31	4,04	3,84	4,46
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,30	19 198	6,950	105,75	106,05	105,90	105,9159	5,93	5,87	5,90	5,9000	5	28-Ago-24	10	5,74	5,42	6,96
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,27	20 992	6,150	99,65	99,95	99,89	99,8352	6,21	6,16	6,17	6,1784	11	28-Ago-24	144	6,49	6,11	7,96
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,32	17 480	7,300	106,05	106,37	106,30	106,2828	6,41	6,36	6,37	6,3738	8	28-Ago-24	17	6,88	6,47	8,96
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,23	16 635	5,400	91,52	91,80	91,75	91,6997	6,59	6,54	6,55	6,5564	16	28-Ago-24	83	7,81	7,33	9,96
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,30	19 730	6,900	100,35	100,62	100,62	100,6026	6,87	6,84	6,84	6,8421	16	28-Ago-24	142	8,88	8,32	12,96
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,20	15 436	7,600	105,88	106,38	106,20	106,1516	6,97	6,92	6,94	6,9449	28	28-Ago-24	226	9,40	8,79	14,96
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,23	11 918	5,350	84,94	85,40	85,27	85,1729	6,94	6,89	6,90	6,9110	15	28-Ago-24	128	10,58	9,90	15,96
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,30	5 033	6,850	-	-	-	100,1892	-	-	-	6,8434	-	20-Ago-24	31	10,57	9,89	17,46
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,29	3 462	6,714	-	-	-	99,6484	-	-	-	6,7526	-	23-Ago-24	2	13,46	12,61	30,46
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,56	884	6,84% + VAC	-	-	-	100,5530	-	-	-	2,3512	-	31-Oct-22	2	0,13	0,12	0,13
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,13	77	2,89%+VAC	-	-	-	99,7722	-	-	-	2,9116	-	18-Ago-23	20	5,16	5,01	5,46
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,56	911	7,39% + VAC	-	-	-	128,2821	-	-	-	4,0187	-	10-Jun-22	10	7,92	7,61	10,43
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,14	228	3,14%+VAC	-	-	-	86,4457	-	-	-	4,3376	-	10-Ago-23	50	12,24	11,73	15,46
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,17	424	3,83% + VAC	-	-	-	94,1474	-	-	-	4,2244	-	21-Jul-22	2	14,99	14,38	21,96
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,14	383	3,26%+VAC	-	-	-	84,4349	-	-	-	4,1733	-	12-Ago-21	10	18,36	17,62	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

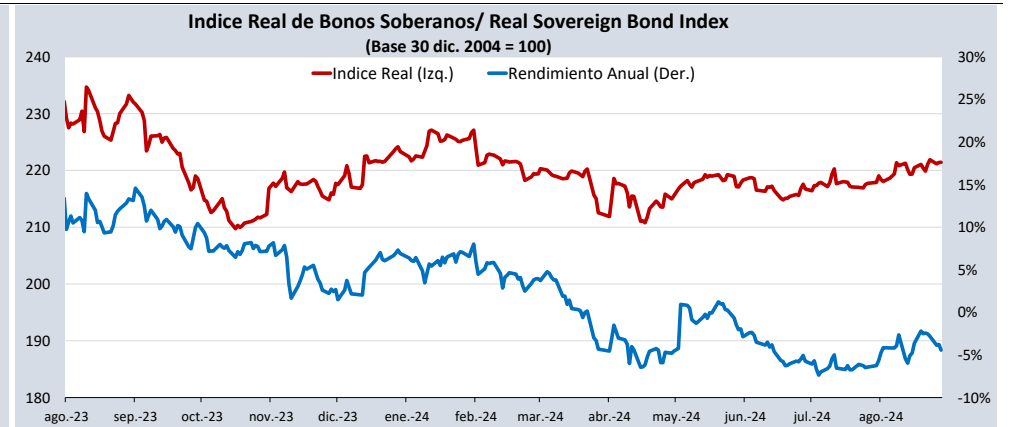
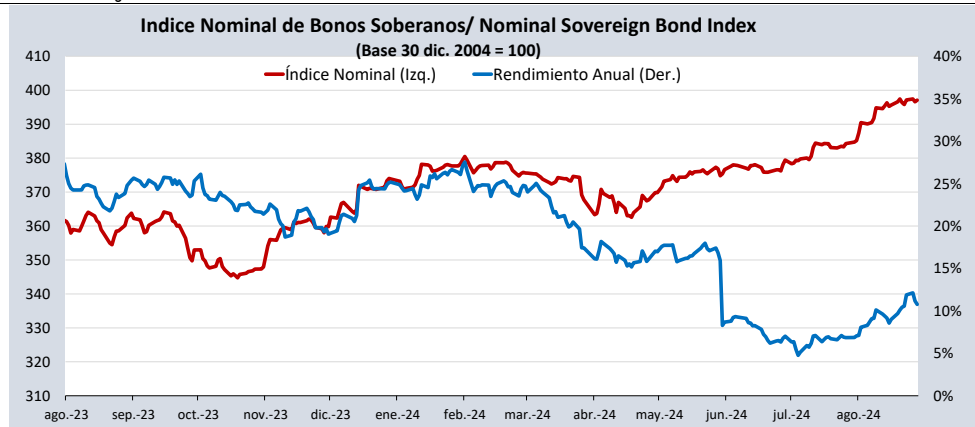
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- venta (pbs) / Yield spread bid-ask (bps)	Análisis 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	102,1880	0,01	-0,03	-0,43	4,8130	-2	-2	49	0,88	0,86	0,91
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,6180	-0,02	-0,01	-0,45	4,9200	2	4	34	1,38	1,35	1,43
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	99,0570	0,00	0,09	-0,76	3,4340	0	-5	56	1,40	1,38	1,44
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,9470	-0,03	-0,03	-0,49	4,5050	1	1	18	2,84	2,78	3,03
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,7470	-0,03	0,00	-0,50	4,6810	1	1	11	5,34	5,22	5,89
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3400	0,00	-0,06	-0,78	3,6770	0	1	16	4,94	4,85	5,50
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,7130	-0,08	-0,21	-0,54	4,8550	2	5	11	5,85	5,71	6,50
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,7270	-0,14	-0,26	-0,55	4,8740	2	5	9	7,56	7,38	8,38
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,7230	-0,12	-0,19	-0,94	5,2030	1	2	11	6,72	6,55	9,37
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,5580	0,02	0,10	-0,98	3,9820	0	-1	16	8,00	7,85	8,66
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,3340	-0,17	-0,24	-0,58	4,9760	3	4	9	8,10	7,90	9,52
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,0820	-0,07	0,05	-0,51	5,1150	1	-1	6	8,13	7,93	10,60
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7970	0,01	-0,11	-0,70	4,2040	0	2	9	10,65	10,43	12,40
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,8380	-0,07	-0,07	-0,81	5,2490	1	1	8	8,74	8,52	12,73
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,6020	-0,08	-0,11	-0,77	5,2520	1	1	8	12,08	11,77	16,78
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,3830	-0,28	-0,26	-0,56	5,4520	2	2	4	13,94	13,57	26,61
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	75,0840	-0,14	-0,38	-0,74	5,3120	1	3	6	15,50	15,10	26,92
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,6040	-0,02	0,21	-0,60	5,5570	0	-1	4	14,71	14,31	30,38
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,8250	-0,21	-0,27	-0,57	5,2780	2	2	5	18,66	18,18	36,79
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,9100	-0,12	-0,08	-0,74	5,5150	1	1	6	18,28	17,78	48,07
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,3930	-0,22	-0,38	-0,69	5,4580	2	3	6	18,93	18,42	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	10,76	-41	33	2,73	4,93	8,83	12,94	13,41	11,90	9,94	12,84	10,77	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	221	0	2	-4,43	-69	-201	29,57	2,49	38,06	6,40	12,97	10,51



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.