



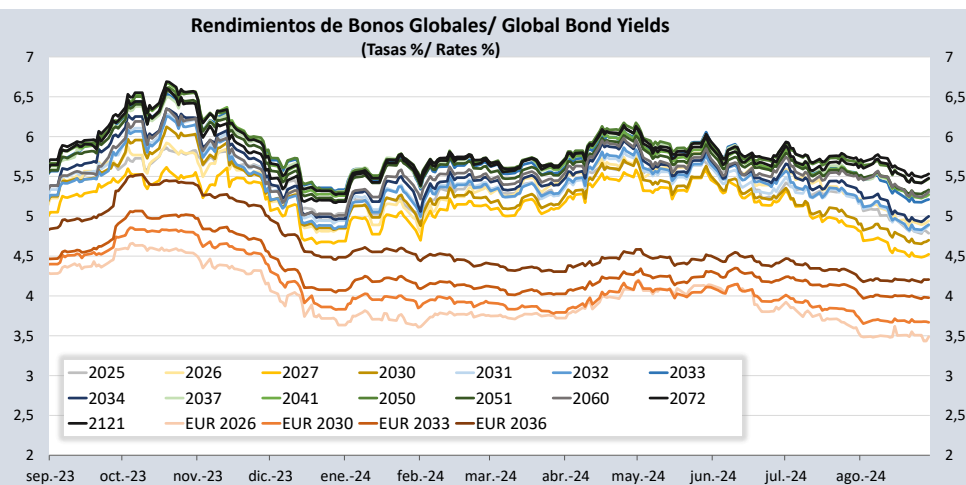
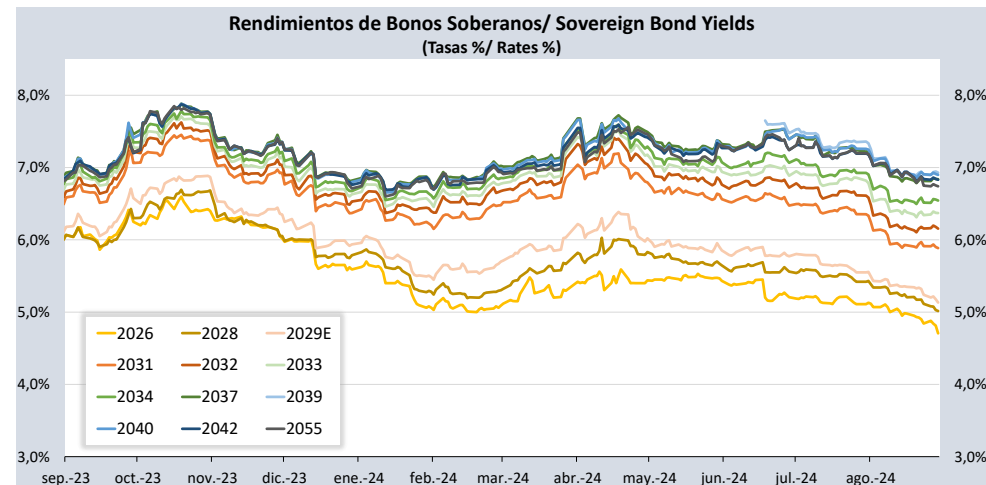
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

29/08/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Descripción / Descripción	Bonos* / Bonds			Saldo vigente Millones S./ / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average			
	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	0,38	3 937	8,200	106,1955	106,50	106,50	106,50	106,50	106,4236	4,80	4,64	4,64	4,7066	24	29-Ago-24	152	1,87	1,78	1,96	
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,29	7 225	6,350	104,47	104,83	104,80	104,80	104,6865	5,07	4,97	4,98	5,0157	23	29-Ago-24	58	3,61	3,44	3,96		
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,27	13 176	5,940	103,02	103,40	103,32	103,32	103,1170	5,16	5,06	5,08	5,1328	40	29-Ago-24	110	4,04	3,84	4,46		
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,32	19 198	6,950	105,79	106,13	106,07	106,07	105,9997	5,92	5,86	5,87	5,8851	21	29-Ago-24	69	5,74	5,42	6,96		
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,28	20 992	6,150	99,70	100,13	100,07	100,07	99,9752	6,20	6,13	6,14	6,1555	47	29-Ago-24	149	6,48	6,11	7,96		
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,34	17 480	7,300	106,20	106,44	106,37	106,37	106,3075	6,39	6,35	6,36	6,3700	26	29-Ago-24	119	6,88	6,47	8,96		
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,25	16 635	5,400	91,72	92,02	91,82	91,7929	91,7929	6,56	6,51	6,54	6,5428	46	29-Ago-24	224	7,81	7,33	9,96		
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,32	19 730	6,900	100,40	100,70	100,70	100,70	100,6351	6,87	6,83	6,83	6,8382	27	29-Ago-24	159	8,88	8,31	12,96		
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,22	15 436	7,600	106,29	106,34	106,19	106,19	106,2946	6,93	6,93	6,94	6,9297	49	29-Ago-24	443	9,40	8,79	14,96		
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,25	11 918	5,350	85,28	85,28	85,28	85,28	85,2723	6,90	6,90	6,90	6,8994	22	29-Ago-24	74	10,58	9,90	15,96		
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,32	5 033	6,850	-	-	-	-	100,3045	-	-	-	6,8318	-	20-Ago-24	31	10,57	9,90	17,46		
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,31	3 462	6,714	-	-	-	-	99,7947	-	-	-	6,7410	-	23-Ago-24	2	13,47	12,62	30,46		
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	2,58	884	6,84% + VAC	-	-	-	-	100,5648	-	-	-	2,1620	-	31-Oct-22	2	0,13	0,12	0,13		
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,13	77	2,89%+VAC	-	-	-	-	99,9321	-	-	-	2,8797	-	18-Ago-23	20	5,15	5,01	5,46		
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,58	911	7,39% + VAC	-	-	-	-	128,3910	-	-	-	4,0070	-	10-Jun-22	10	7,92	7,61	10,43		
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,15	228	3,14%+VAC	-	-	-	-	86,5795	-	-	-	4,3246	-	10-Ago-23	50	12,24	11,73	15,46		
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,18	424	3,83% + VAC	-	-	-	-	94,2999	-	-	-	4,2132	-	21-Jul-22	2	15,00	14,39	21,96		
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,15	383	3,26%+VAC	-	-	-	-	84,6028	-	-	-	4,1621	-	12-Ago-21	10	18,37	17,64	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.

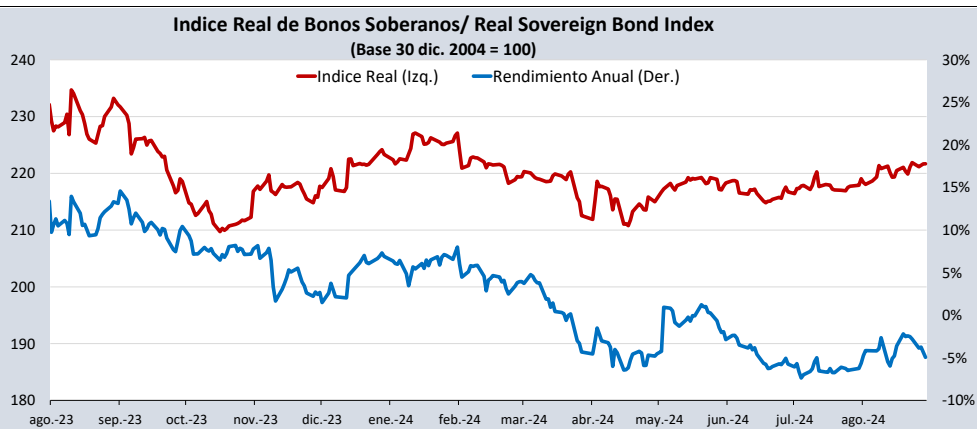
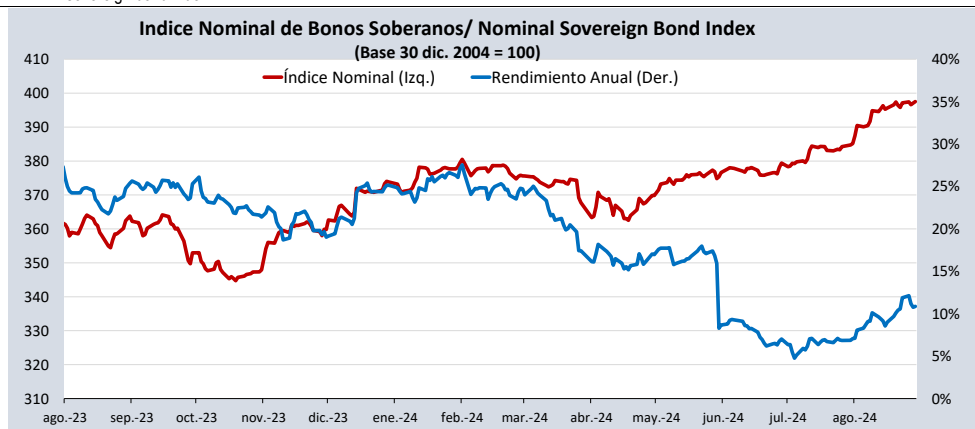
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,2050	0,02	0,00	-0,45	4,7860	-3	-6	52	0,88	0,86	0,91
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	96,5940	-0,02	0,04	-0,44	4,9430	2	0	34	1,38	1,35	1,42
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	98,9900	-0,07	0,10	-0,48	3,4880	5	-6	35	1,40	1,38	1,44
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	98,8990	-0,05	0,06	-0,48	4,5230	2	-2	17	2,84	2,78	3,03
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,6610	-0,09	0,11	-0,51	4,7000	2	-2	11	5,34	5,22	5,89
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	100,3790	0,04	0,18	-0,60	3,6690	-1	-4	12	4,94	4,85	5,50
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,5620	-0,15	0,00	-0,53	4,8860	3	1	10	5,85	5,71	6,49
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,6120	-0,12	0,04	-0,54	4,8940	2	0	9	7,56	7,38	8,38
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,6440	-0,08	0,17	-0,99	5,2110	1	-2	12	6,72	6,55	9,36
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	80,6070	0,05	0,21	-0,98	3,9770	-1	-3	16	8,00	7,84	8,66
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,1730	-0,16	-0,06	-0,59	5,0000	2	1	9	8,09	7,89	9,52
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	101,8640	-0,22	0,20	-0,51	5,1420	3	-2	6	8,13	7,92	10,60
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,7920	0,00	0,03	-0,71	4,2060	0	0	9	10,64	10,43	12,40
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	111,6630	-0,17	0,24	-0,79	5,2670	2	-3	8	8,74	8,51	12,72
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	78,4000	-0,20	0,10	-0,76	5,2740	2	-1	8	12,07	11,76	16,77
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	102,1180	-0,27	0,02	-0,60	5,4710	2	0	4	13,92	13,55	26,60
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	74,8630	-0,22	-0,09	-0,74	5,3310	2	1	6	15,48	15,07	26,91
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	104,4730	-0,13	0,68	-0,56	5,5660	1	-5	4	14,70	14,30	30,38
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	59,4950	-0,33	0,06	-0,61	5,3080	3	-1	6	18,61	18,13	36,79
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	67,6900	-0,22	0,17	-0,74	5,5330	2	-1	6	18,23	17,74	48,07
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	59,1790	-0,21	0,07	-0,68	5,4780	2	-1	6	18,86	18,35	98,32

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	398	0	2	10,86	10	30	2,69	4,86	8,73	13,08	13,49	11,94	9,81	12,76	10,63	6,53	3,25	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	222	0	1	-4,95	-62	-243	29,54	2,49	38,06	6,41	12,98	10,52



Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOMBERG, 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.