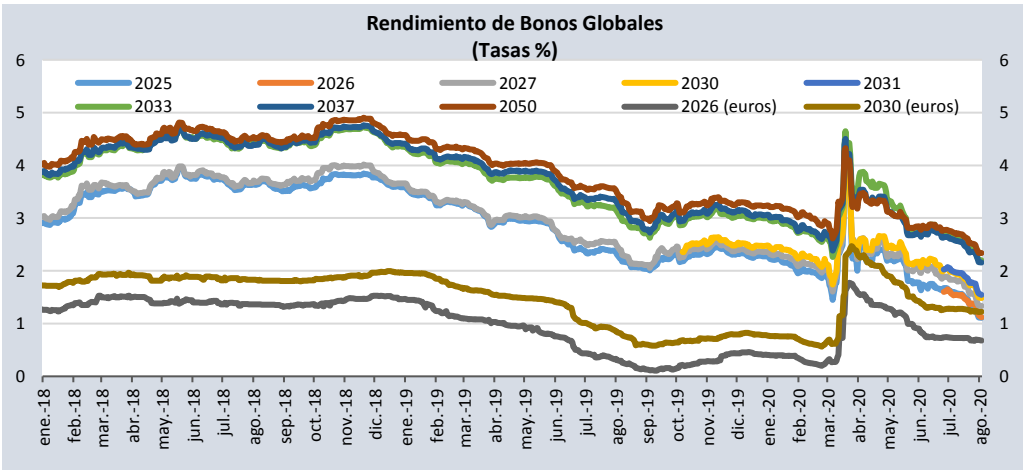
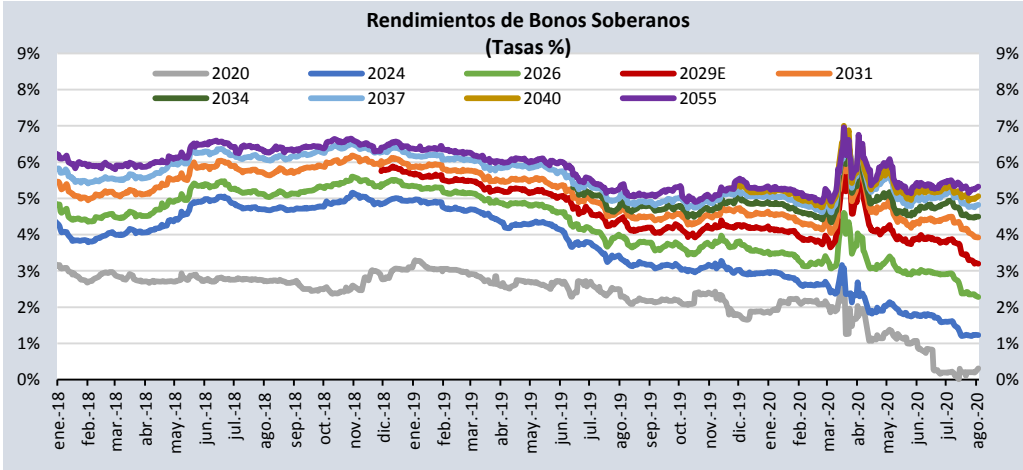




Perú: Reporte Diario / Daily Report
03/08/2020

Bonos soberanos / Sovereign bonds																			
Letras y bonos* / T-bills and bonds				Saldo vigente	Cupón % / Coupon %	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada / Modified Duration	Vida media / Average life
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos SI / Accrued Interest PEN			Millones SI / Millions PEN	Postura / Position		Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average	Postura / Position		Última neg. / Last trading day		Prom. ponderado / Weighted average	Día / Date			
				Compra / Bid	Venta / Ask		Compra / Bid	Venta / Ask											
19-ago-20	PEP01000T848	LTP19AGO20	-	30	-	-	-	-	99,9984	-	-	-	0,0353	-	28-ago-19	32	0,04	0,04	0,04
16-sep-20	PEP01000T855	LTP16SEP20	-	30	-	-	-	-	99,9952	-	-	-	0,0396	-	26-sep-19	1	0,12	0,12	0,12
18-nov-20	PEP01000T871	LTP18NOV20	-	6	-	-	-	-	99,9853	-	-	-	0,0495	-	27-nov-19	5	0,30	0,30	0,30
12-ago-20	PEP01000CY33	SB12AGO20	37,26	157	7,840	-	-	-	100,1859	-	-	-	0,3075	-	18-jun-20	9	0,15	0,15	0,03
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	20,35	1 309	5,200	-	-	-	114,1543	-	-	-	0,5900	-	16-jul-20	2	2,94	2,92	3,11
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	27,09	6 739	5,700	117,36	117,45	117,40	117,4385	1,24	1,22	1,23	1,2300	11	03-ago-20	58	3,66	3,61	4,03
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	38,97	12 515	8,200	132,91	132,97	132,97	133,0126	2,29	2,28	2,28	2,2803	17	03-ago-20	125	4,98	4,86	6,03
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	30,18	14 471	6,350	122,82	122,90	122,82	122,8096	3,09	3,08	3,09	3,0937	45	03-ago-20	145	6,53	6,33	8,03
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	282,31	14 267	5,940	120,10	120,18	120,10	120,1428	3,20	3,19	3,20	3,1964	34	03-ago-20	77	6,92	6,70	8,53
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	33,03	14 448	6,950	126,60	126,70	126,70	126,6969	3,93	3,92	3,92	3,9217	17	03-ago-20	70	8,18	7,87	11,03
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	29,23	13 627	6,150	118,79	118,79	118,79	118,7992	4,13	4,13	4,13	4,1298	21	03-ago-20	82	8,90	8,54	12,03
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	25,67	10 051	5,400	109,11	109,11	109,11	109,1702	4,50	4,50	4,50	4,4944	18	03-ago-20	197	10,12	9,68	14,03
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	32,79	14 699	6,900	123,52	123,65	123,78	123,7520	4,84	4,83	4,82	4,8228	25	03-ago-20	129	10,86	10,36	17,03
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	35,69	8 261	5,350	103,60	103,85	103,35	103,4311	5,05	5,03	5,07	5,0633	3	03-ago-20	6	12,40	11,80	20,03
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	32,56	4 443	6,850	-	-	-	121,0068	-	-	-	5,2039	-	23-jul-20	114	12,33	11,72	21,53
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	31,91	2 272	6,714	-	-	-	121,6346	-	-	-	5,3270	-	27-jul-20	3	15,43	14,66	34,53
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	32,01	1 335	6,84%+ VAC	-	-	-	132,8401	-	-	-	-0,8232	-	05-mar-18	5	3,79	3,82	4,19
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	15,87	87	2,89%+VAC	-	-	-	114,0635	-	-	-	1,2985	-	31-may-16	27	8,51	8,40	9,53
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,92	1 371	7,39%+ VAC	-	-	-	161,4940	-	-	-	2,3353	-	16-jun-20	51	10,50	10,26	14,49
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	17,27	260	3,14%+VAC	-	-	-	104,7287	-	-	-	2,8027	-	14-ene-19	80	14,87	14,47	19,53
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	26,98	620	3,83%+ VAC	-	-	-	114,0805	-	-	-	3,0213	-	24-may-18	15	17,32	16,82	26,03
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	17,99	438	3,26%+VAC	-	-	-	103,1973	-	-	-	3,0908	-	03-feb-17	1	20,82	20,20	33,53

Nota: Tasa del SB12AGO20 calculado en base a las posturas brindadas por Santander.

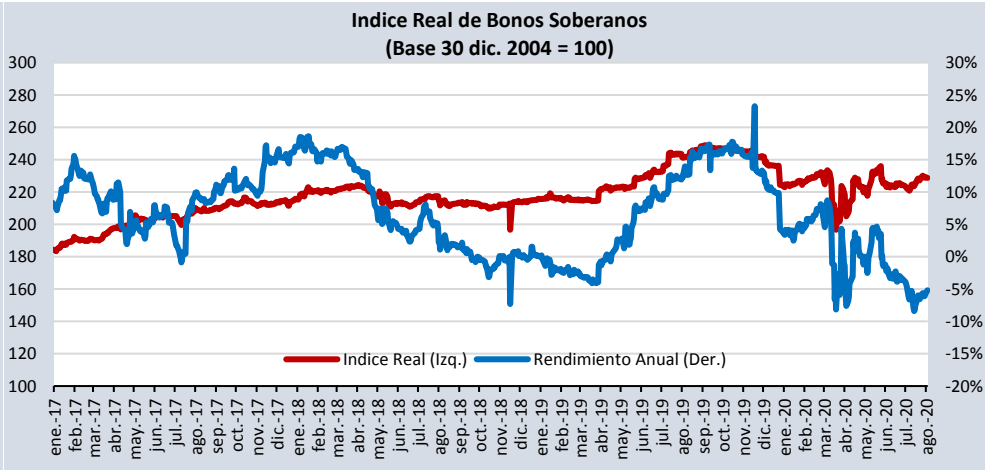
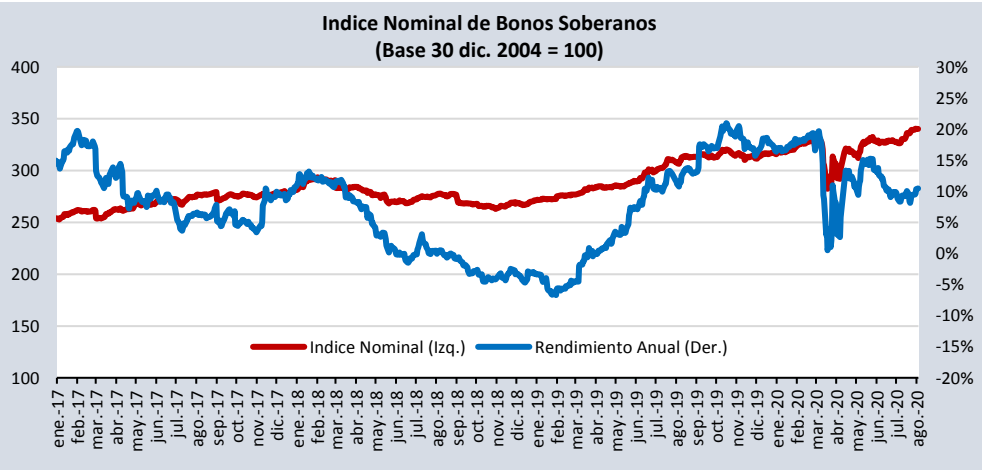




Bonos globales**** / Global bonds													
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Precio diferencial compra-venta / Price spread bid-ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Análisis de sensibilidad / Sensitivity Analysis		
					Diario / Daily	Semanal / Weekly			Diario / Daily	Semanal / Weekly	Duración / Duration	Duración modificada / Modified duration	Vida media / Average life
Perú Global 25	US715638AS19	1 646	7,350	130,0400	0,03	1,11	-0,55	1,1100	-1	-22	4,34	4,32	5,04
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	106,7270	0,20	0,20	-0,66	1,1200	-4	-25	5,17	5,14	5,55
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	111,1000	0,06	-0,08	-0,97	0,6810	-1	1	5,16	5,14	5,57
Perú Global 27	US715638BU55	1 062	4,125	118,7290	0,04	1,59	-0,62	1,3350	-1	-22	5,40	5,36	6,15
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	112,4530	0,13	2,27	-0,48	1,4840	-1	-24	8,74	8,68	10,02
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	122,6500	-0,09	-0,05	-1,13	1,2260	1	0	8,24	8,19	9,63
Perú Global 31	US715638DF60	2 000	2,783	111,9330	0,26	2,19	-0,70	1,5440	-3	-22	9,24	9,17	10,63
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	175,1660	0,20	3,36	-1,01	2,1980	-1	-21	9,36	9,25	13,49
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	161,0270	0,18	3,58	-1,18	2,1580	-1	-20	11,60	11,48	16,85
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	171,0770	0,20	5,02	-1,29	2,3370	-1	-17	18,33	18,11	30,73

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-sep- 23	12-ago- 24	12-ago- 26	12-ago- 28	12-feb- 29	12-ago- 31	12-ago- 32	12-ago- 34	12-ago- 37	12-ago- 40	12-feb- 42	12-feb- 55
Índice de bonos soberanos nominal / Sovereign nominal bond index	340	0	1	10,44	10	95	0,00	5,63	11,92	12,67	12,22	13,07	11,54	7,98	12,99	6,15	3,84	1,97

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 / Sovereign real bond index	229	-1	-1	-5,17	63	45	30,36	2,25	38,28	6,20	12,60	10,31



Fuente: 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 4:00 pm.