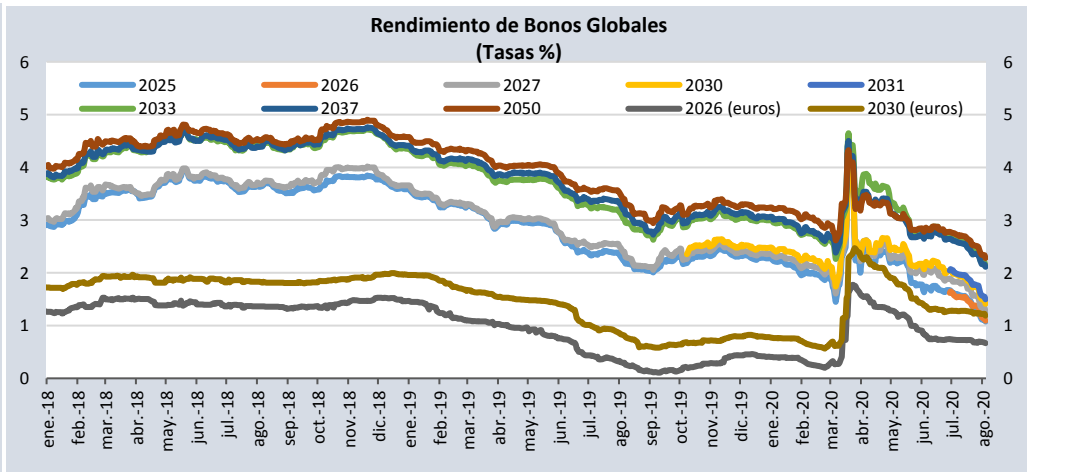
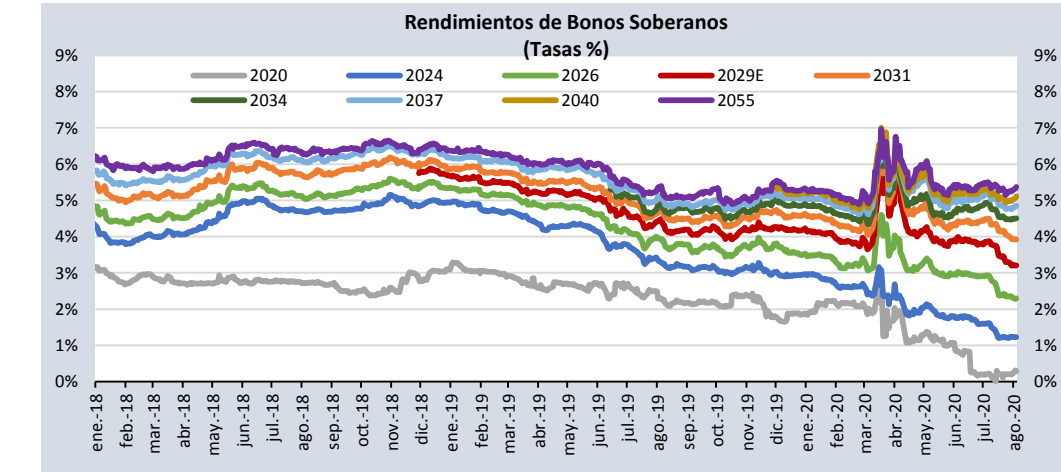




Perú: Reporte Diario / Daily Report
04/08/2020

Bonos soberanos / Sovereign bonds																			
Letras y bonos* / T-bills and bonds				Saldo vigente	Cupón % / Coupon %	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº 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	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
19-ago-20	PEP01000T848	LTP19AGO20	-	30	-	-	-	-	99,9985	-	-	-	0,0358	-	28-ago-19	32	0,04	0,04	0,04
16-sep-20	PEP01000T855	LTP16SEP20	-	30	-	-	-	-	99,9952	-	-	-	0,0401	-	26-sep-19	1	0,12	0,12	0,12
18-nov-20	PEP01000T871	LTP18NOV20	-	6	-	-	-	-	99,9853	-	-	-	0,0500	-	27-nov-19	5	0,29	0,29	0,29
12-ago-20	PEP01000CY33	SB12AGO20	37,48	157	7,840	-	-	-	100,1657	-	-	-	0,2845	-	18-jun-20	9	0,15	0,15	0,02
12-sep-20	PEP01000C4N3	SB12SEP23	20,49	1 309	5,200	-	-	-	114,1403	-	-	-	0,5905	-	16-jul-20	2	2,94	2,92	3,11
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	27,25	6 739	5,700	117,35	117,44	117,44	117,4247	1,24	1,22	1,22	1,2305	11	04-ago-20	37	3,65	3,61	4,02
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	39,20	12 515	8,200	132,76	132,83	132,89	132,9094	2,31	2,30	2,29	2,2937	43	04-ago-20	268	4,97	4,86	6,02
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	30,35	14 471	6,350	122,85	122,89	122,89	122,6428	3,09	3,08	3,08	3,1138	43	04-ago-20	151	6,52	6,33	8,02
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	283,95	14 267	5,940	120,05	120,09	120,09	120,0390	3,21	3,20	3,20	3,2083	36	04-ago-20	102	6,91	6,70	8,52
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	33,22	14 448	6,950	126,49	126,69	126,69	126,6989	3,94	3,92	3,92	3,9210	10	04-ago-20	71	8,18	7,87	11,02
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	29,40	13 627	6,150	118,73	118,78	118,78	118,5717	4,14	4,13	4,13	4,1514	13	04-ago-20	66	8,89	8,54	12,02
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	25,81	10 051	5,400	109,00	109,10	109,10	109,0382	4,51	4,50	4,50	4,5065	25	04-ago-20	149	10,11	9,68	14,02
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	32,98	14 699	6,900	122,99	123,12	123,25	123,2574	4,88	4,87	4,86	4,8603	17	04-ago-20	97	10,85	10,34	17,02
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	35,83	8 261	5,350	102,72	103,09	102,84	102,8430	5,12	5,09	5,11	5,1100	5	04-ago-20	9	12,37	11,77	20,02
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	32,74	4 443	6,850	-	-	-	120,3289	-	-	-	5,2506	-	23-jul-20	114	12,33	11,72	21,52
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	32,10	2 272	6,714	-	-	-	120,7916	-	-	-	5,3737	-	27-jul-20	3	15,43	14,66	34,52
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	32,32	1 335	6,84% + VAC	-	-	-	132,8844	-	-	-	-0,8361	-	05-mar-18	5	3,78	3,82	4,19
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	15,97	87	2,89%+VAC	-	-	-	114,1371	-	-	-	1,2905	-	31-may-16	27	8,50	8,40	9,52
31-ene-35	PEP01000C8V5	SB31ENE35	1,23	1 371	7,39% + VAC	-	-	-	161,4696	-	-	-	2,3362	-	16-jun-20	51	10,50	10,26	14,49
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	17,37	260	3,14%+VAC	-	-	-	104,2793	-	-	-	2,8320	-	14-ene-19	80	14,86	14,45	19,52
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	27,15	620	3,83% + VAC	-	-	-	113,4822	-	-	-	3,0520	-	24-may-18	15	17,30	16,78	26,02
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	18,11	438	3,26%+VAC	-	-	-	102,5495	-	-	-	3,1215	-	03-feb-17	1	20,77	20,15	33,52

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

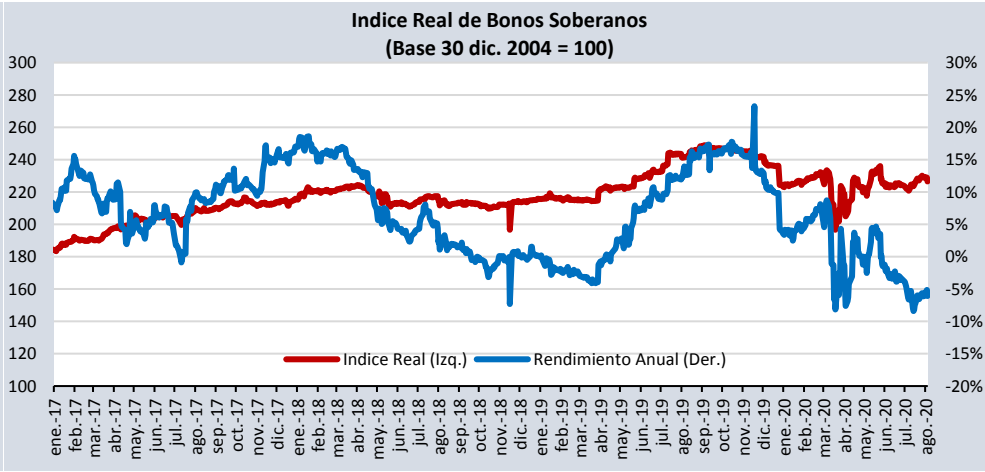
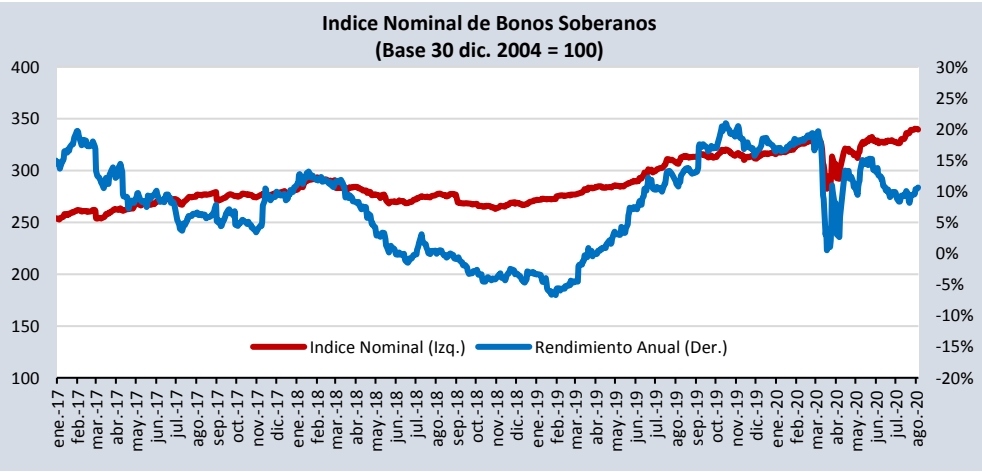




Bonos globales**** / Global bonds													
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Precio diferencial compra-venta / Price spread bid-ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Análisis de sensibilidad / Sensitivity 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	130,2120	0,17	1,24	-0,55	1,0760	-3	-24	4,34	4,32	5,03
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	106,8670	0,14	0,14	-0,70	1,0940	-3	-27	5,17	5,14	5,55
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	111,1880	0,09	0,13	-0,97	0,6650	-2	-3	5,15	5,14	5,57
Perú Global 27	US715638BU55	1 062	4,125	119,1950	0,47	1,78	-0,55	1,2710	-6	-25	5,40	5,36	6,14
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	113,1380	0,69	2,68	-0,49	1,4130	-7	-28	8,74	8,68	10,02
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	123,0250	0,38	0,45	-1,00	1,1890	-4	-5	8,24	8,19	9,63
Perú Global 31	US715638DF60	2 000	2,783	112,3990	0,47	2,61	-0,63	1,4980	-5	-26	9,24	9,17	10,62
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	176,1560	0,99	4,08	-0,93	2,1370	-6	-26	9,36	9,27	13,49
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	161,8410	0,81	4,12	-1,00	2,1140	-4	-23	11,61	11,49	16,85
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	172,8290	1,75	6,31	-1,03	2,2810	-6	-21	18,39	18,18	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	339	-1	0	10,60	16	111	0,00	5,64	11,94	12,68	12,23	13,09	11,54	7,98	12,97	6,13	3,83	1,96

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	227	-2	-4	-6,06	-94	-44	30,68	2,28	37,85	6,23	12,64	10,32



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.