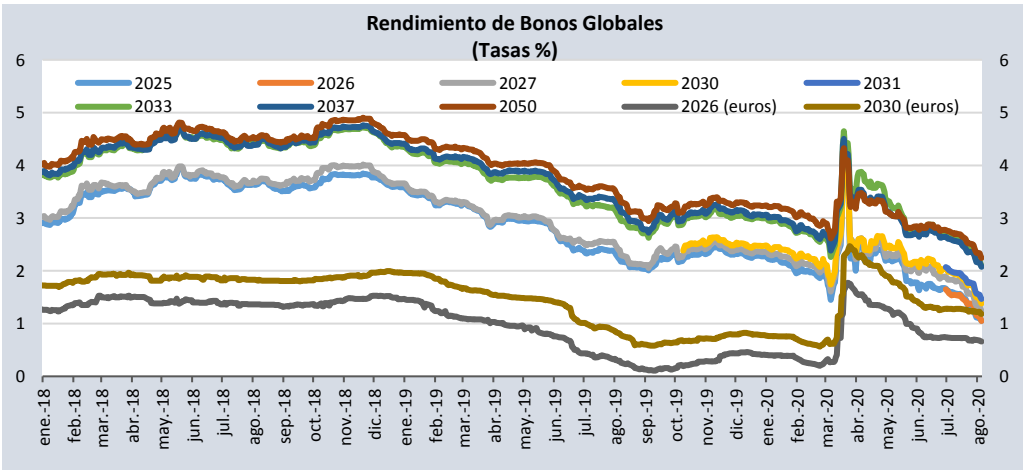
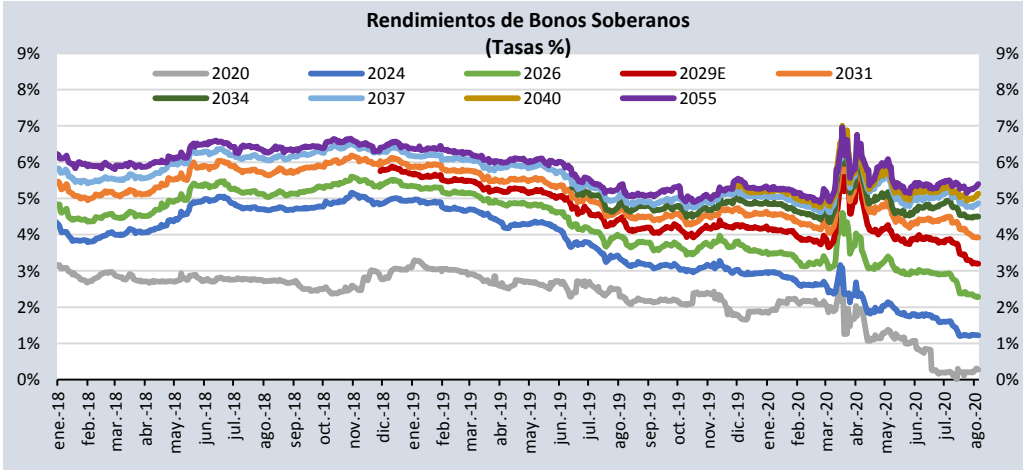




Perú: Reporte Diario / Daily Report
05/08/2020

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	-	-	-	-	99,9991	-	-	-	0,0221	-	28-ago-19	32	0,04	0,04	0,04
16-sep-20	PEP01000T855	LTP16SEP20	-	30	-	-	-	-	99,9969	-	-	-	0,0264	-	26-sep-19	1	0,12	0,12	0,12
18-nov-20	PEP01000T871	LTP18NOV20	-	6	-	-	-	-	99,9894	-	-	-	0,0363	-	27-nov-19	5	0,29	0,29	0,29
12-ago-20	PEP01000CY33	SB12AGO20	37,69	157	7,840	-	-	-	100,1452	-	-	-	0,2745	-	18-jun-20	9	0,15	0,15	0,02
12-sep-20	PEP01000C4N3	SB12SEP23	20,63	1 309	5,200	-	-	-	114,1742	-	-	-	0,5768	-	16-jul-20	2	2,94	2,92	3,10
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	27,40	6 739	5,700	-	-	-	117,4370	-	-	-	1,2250	-	04-ago-20	37	3,65	3,61	4,02
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	39,42	12 515	8,200	132,85	132,92	132,92	132,9867	2,29	2,28	2,28	2,2800	18	05-ago-20	63	4,97	4,86	6,02
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	30,53	14 471	6,350	122,87	122,95	122,87	122,9450	3,08	3,07	3,08	3,0750	8	05-ago-20	16	6,52	6,33	8,02
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	285,58	14 267	5,940	119,99	120,07	120,12	120,1514	3,21	3,20	3,20	3,1940	23	05-ago-20	108	6,91	6,70	8,52
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	33,41	14 448	6,950	126,70	126,78	126,68	126,6712	3,92	3,91	3,92	3,9232	15	05-ago-20	40	8,17	7,87	11,02
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	29,57	13 627	6,150	118,67	118,88	118,77	118,7907	4,14	4,12	4,13	4,1300	2	05-ago-20	4	8,89	8,54	12,02
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	25,96	10 051	5,400	109,10	109,32	109,21	109,1938	4,50	4,48	4,49	4,4920	13	05-ago-20	45	10,11	9,68	14,02
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	33,17	14 699	6,900	122,86	123,12	123,05	123,1165	4,89	4,87	4,88	4,8709	4	05-ago-20	6	10,84	10,34	17,02
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	35,98	8 261	5,350	102,34	102,59	102,41	102,6002	5,15	5,13	5,15	5,1294	4	05-ago-20	8	12,36	11,76	20,02
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	32,93	4 443	6,850	-	-	-	120,0482	-	-	-	5,2700	-	23-jul-20	114	12,33	11,72	21,52
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	32,28	2 272	6,714	-	-	-	120,4440	-	-	-	5,3931	-	27-jul-20	3	15,43	14,66	34,52
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	32,61	1 335	6,84% + VAC	-	-	-	132,8943	-	-	-	-0,8422	-	05-mar-18	5	3,78	3,81	4,19
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	16,06	87	2,89%+VAC	-	-	-	114,2074	-	-	-	1,2828	-	31-may-16	27	8,50	8,39	9,52
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,53	1 371	7,39% + VAC	154,0099	160,41	168,89	168,9050	2,80	2,40	1,90	1,9000	2	05-ago-20	124	10,60	10,40	14,49
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	17,48	260	3,14%+VAC	-	-	-	104,0127	-	-	-	2,8494	-	14-ene-19	80	14,85	14,44	19,52
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	27,31	620	3,83% + VAC	-	-	-	113,1167	-	-	-	3,0709	-	24-may-18	15	17,28	16,76	26,02
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	18,21	438	3,26%+VAC	-	-	-	102,1545	-	-	-	3,1404	-	03-feb-17	1	20,74	20,11	33,52

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

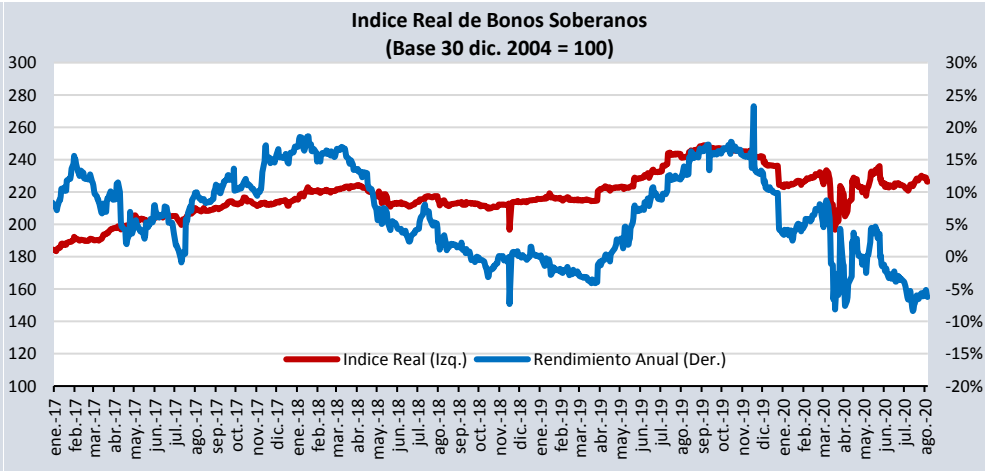
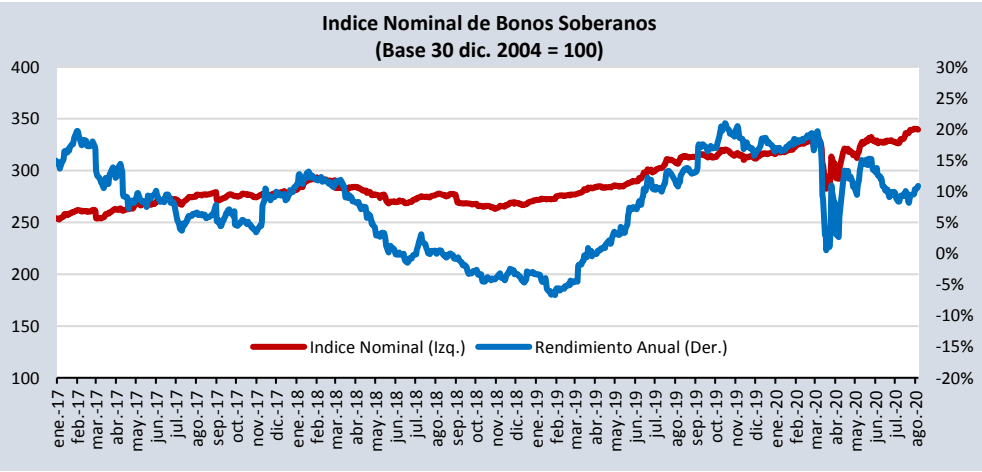




Bonos globales**** / Global bonds													
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Precio diferencial compra-venta / Price spread bid-ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Análisis de sensibilidad / Sensitivity 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	130,3370	0,13	0,94	-0,49	1,0510	-3	-19	4,34	4,32	5,03
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	107,1120	0,24	0,24	-0,66	1,0490	-5	-23	5,17	5,14	5,55
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	111,2260	0,04	0,17	-0,97	0,6580	-1	-4	5,15	5,13	5,57
Perú Global 27	US715638BU55	1 062	4,125	119,3810	0,19	1,47	-0,63	1,2450	-3	-21	5,39	5,36	6,14
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	113,4500	0,31	2,23	-0,50	1,3810	-3	-23	8,74	8,68	10,02
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	123,0630	0,04	0,46	-1,00	1,1840	-1	-5	8,23	8,18	9,63
Perú Global 31	US715638DF60	2 000	2,783	112,7230	0,32	2,13	-0,68	1,4670	-3	-21	9,24	9,17	10,62
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	176,9010	0,75	3,57	-0,91	2,0910	-5	-22	9,37	9,27	13,49
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	162,5640	0,72	3,89	-0,95	2,0760	-4	-21	11,62	11,50	16,85
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	173,9900	1,16	5,73	-0,83	2,2440	-4	-19	18,42	18,22	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	0	10,88	28	140	0,00	5,64	11,94	12,70	12,24	13,09	11,56	7,99	12,95	6,11	3,82	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	226	0	-3	-6,21	-14	-6	30,74	2,28	37,90	6,21	12,59	10,28



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.