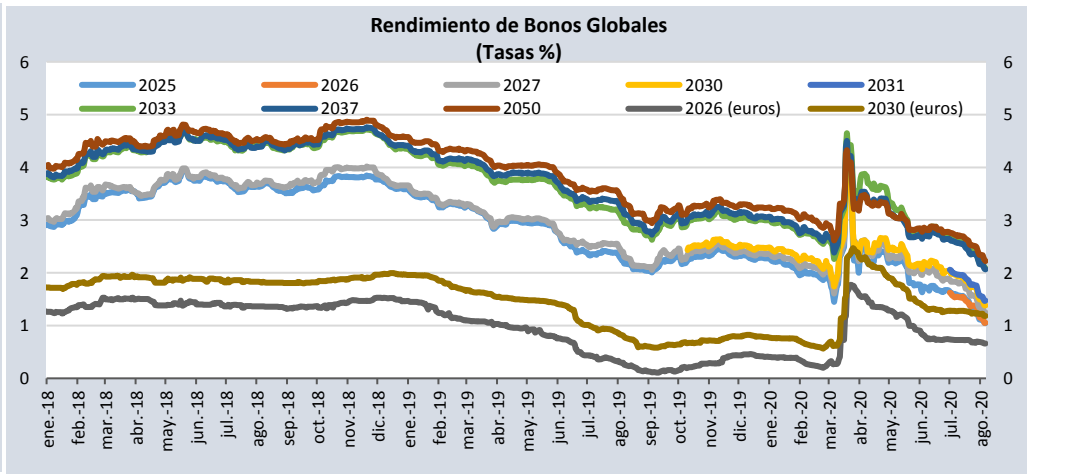
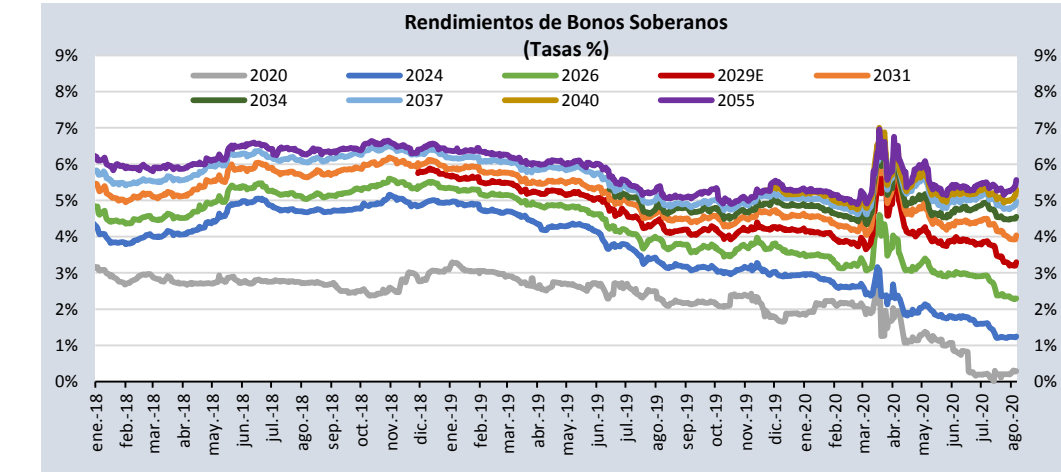




Perú: Reporte Diario / Daily Report
06/08/2020

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	-	-	-	0,0406	-	28-ago-19	32	0,04	0,04	0,04	
16-sep-20	PEP01000T855	LTP16SEP20	-	30	-	-	-	99,9949	-	-	-	0,0449	-	26-sep-19	1	0,11	0,11	0,11	
18-nov-20	PEP01000T871	LTP18NOV20	-	6	-	-	-	99,9842	-	-	-	0,0548	-	27-nov-19	5	0,29	0,29	0,29	
12-ago-20	PEP01000CY33	SB12AGO20	37,91	157	7,840	-	-	-	100,1242	-	-	-	0,2930	-	18-jun-20	9	0,15	0,15	0,02
12-sep-23	PEP01000C4N3	SB12SEP23	20,77	1 309	5,200	-	-	-	114,0998	-	-	-	0,5953	-	16-jul-20	2	2,94	2,92	3,10
12-ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	27,56	6 739	5,700	-	-	-	117,3453	-	-	-	1,2435	-	04-ago-20	37	3,65	3,60	4,02
12-ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	39,65	12 515	8,200	132,44	132,77	132,70	132,8497	2,35	2,30	2,31	2,2985	21	06-ago-20	125	4,97	4,86	6,02
12-ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	30,70	14 471	6,350	121,44	121,52	121,91	122,3722	3,26	3,25	3,20	3,1462	54	06-ago-20	197	6,52	6,32	8,02
12-feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	287,21	14 267	5,940	119,00	119,25	119,17	119,3245	3,33	3,30	3,31	3,2940	72	06-ago-20	307	6,90	6,68	8,52
12-ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	33,60	14 448	6,950	124,55	124,65	125,35	125,4692	4,13	4,12	4,05	4,0410	87	06-ago-20	183	8,15	7,84	11,02
12-ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	29,74	13 627	6,150	116,82	116,92	117,33	117,4504	4,32	4,31	4,27	4,2596	20	06-ago-20	57	8,87	8,50	12,02
12-ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	26,11	10 051	5,400	107,50	108,03	108,03	108,6062	4,65	4,60	4,60	4,5464	10	06-ago-20	90	10,10	9,66	14,02
12-ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	33,36	14 699	6,900	120,79	121,43	120,79	121,8106	5,05	5,00	5,05	4,9714	14	06-ago-20	22	10,80	10,29	17,02
12-ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	36,13	8 261	5,350	100,62	102,59	100,50	100,4980	5,29	5,13	5,30	5,3000	4	06-ago-20	5	12,27	11,65	20,02
12-feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	33,12	4 443	6,850	-	-	-	117,6297	-	-	-	5,4406	-	23-jul-20	114	12,33	11,72	21,52
12-feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	32,46	2 272	6,714	-	-	-	117,4581	-	-	-	5,5637	-	27-jul-20	3	15,43	14,66	34,52
13-oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	32,90	1 335	6,84% + VAC	-	-	-	132,7793	-	-	-	-0,8241	-	05-mar-18	5	3,78	3,81	4,19
12-feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	16,15	87	2,89%+VAC	-	-	-	113,1919	-	-	-	1,3877	-	31-may-16	27	8,49	8,38	9,52
31-ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,84	1 371	7,39% + VAC	-	-	-	160,6271	-	-	-	2,3861	-	05-ago-20	124	10,48	10,24	14,49
12-feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	17,58	260	3,14%+VAC	-	-	-	101,6763	-	-	-	3,0049	-	14-ene-19	80	14,78	14,35	19,52
12-ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	27,47	620	3,83% + VAC	-	-	-	109,9590	-	-	-	3,2379	-	24-may-18	15	17,13	16,59	26,02
12-feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	18,32	438	3,26%+VAC	-	-	-	98,7518	-	-	-	3,3074	-	03-feb-17	1	20,50	19,84	33,52

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

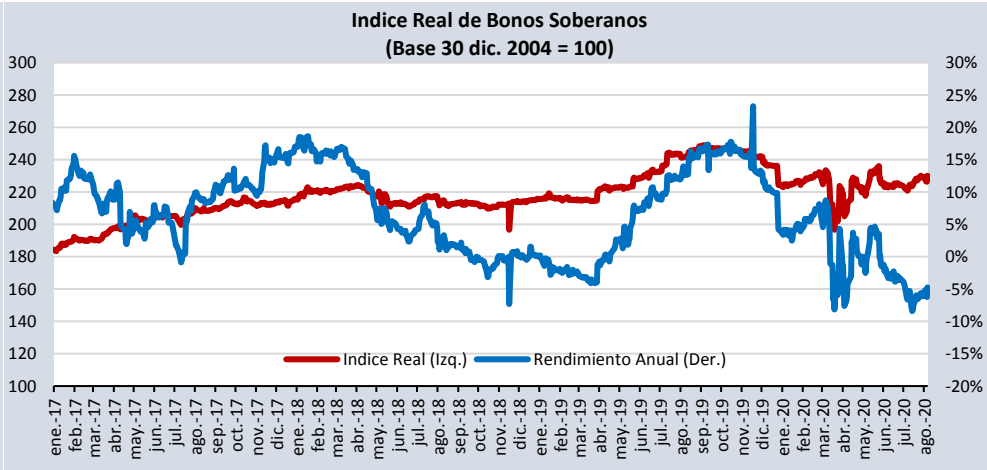
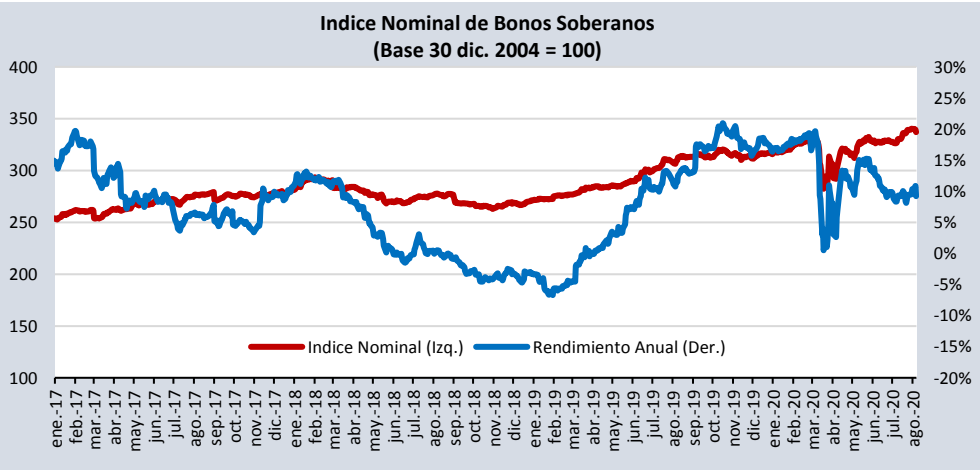




Bonos globales**** / Global bonds													
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Precio diferencial compra-venta / Price spread bid-ask	Rendimiento % / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Análisis de sensibilidad / Sensitivity 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	130,3140	-0,02	0,53	-0,49	1,0460	0	-12	4,34	4,31	5,03
Perú Global 26	US715638DE95	1 000	2,392	107,0590	-0,05	-0,05	-0,59	1,0560	1	-17	5,16	5,14	5,54
Perú Global 26	XS1315181708	€1 097	2,750	111,1880	-0,04	0,11	-0,85	0,6610	0	-3	5,15	5,13	5,56
Perú Global 27	US715638BU55	1 062	4,125	119,3320	-0,05	0,86	-0,55	1,2490	0	-12	5,39	5,36	6,14
Perú Global 30	US715638DA73	750	2,844	113,4380	-0,01	1,44	-0,44	1,3820	0	-15	8,74	8,68	10,01
Perú Global 30	XS1373156618	€998	3,750	123,0880	0,02	0,42	-1,13	1,1800	0	-5	8,23	8,18	9,62
Perú Global 31	US715638DF60	2 000	2,783	112,6140	-0,11	1,33	-0,62	1,4760	1	-13	9,23	9,17	10,62
Perú Global 33	US715638AP79	2 152	8,750	176,9840	0,08	2,49	-1,03	2,0840	-1	-16	9,37	9,27	13,49
Perú Global 37	US715638AU64	1 130	6,550	162,7230	0,16	2,93	-0,86	2,0660	-1	-16	11,62	11,50	16,84
Perú Global 50	US715638BM30	2 545	5,625	174,6530	0,66	4,76	-0,87	2,2230	-2	-15	18,44	18,24	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	337	-3	-3	9,23	-165	-42	0,00	5,69	12,03	12,75	12,26	13,07	11,53	8,02	12,92	6,04	3,77	1,93

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	230	4	1	-4,72	149	138	30,24	2,25	39,00	6,09	12,35	10,07



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.