

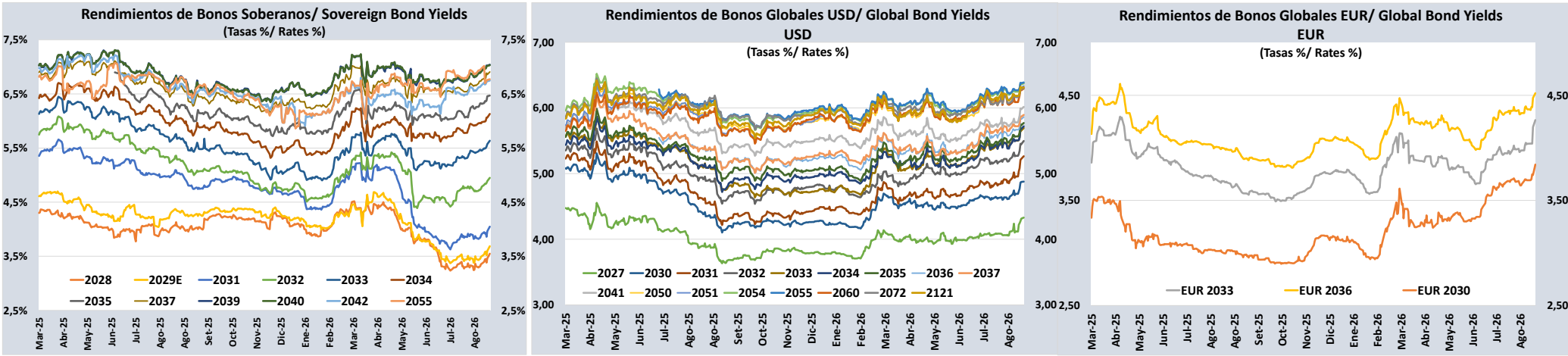


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			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											
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,57	2 804	6,350	-	-	-	105,0859	-	-	-	3,5476	-	8-Jul-26	2	1,85	1,79	1,92
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,53	8 025	5,940	-	-	-	105,0880	-	-	-	3,6848	-	11-Set-26	2	2,31	2,23	2,42
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,62	14 560	6,950	106,12	113,06	112,97	112,7137	5,50	3,97	3,99	4,0481	3	14-Set-26	31	4,33	4,16	4,92
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,55	22 072	6,150	-	-	-	106,0091	-	-	-	4,9500	-	11-Set-26	4	5,12	4,88	5,92
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,65	24 199	7,300	108,99	109,49	109,40	109,3736	5,70	5,62	5,63	5,6363	6	14-Set-26	19	5,67	5,37	6,92
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,48	24 259	5,400	95,25	95,59	95,60	95,4776	6,17	6,11	6,11	6,1307	7	14-Set-26	104	6,57	6,19	7,92
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,61	26 569	6,850	102,18	102,38	102,18	102,4683	6,53	6,50	6,53	6,4872	26	14-Set-26	94	6,90	6,48	8,92
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,62	24 043	6,900	99,35	100,10	100,06	100,0448	7,00	6,90	6,91	6,9068	38	14-Set-26	99	7,91	7,40	10,92
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,68	21 020	7,600	104,49	105,00	104,83	104,8201	7,08	7,02	7,04	7,0416	34	14-Set-26	124	8,63	8,06	12,92
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,48	12 836	5,350	85,17	85,52	85,45	85,3517	7,06	7,01	7,02	7,0314	5	14-Set-26	11	9,70	9,06	13,92
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,61	5 040	6,850	-	-	-	101,0625	-	-	-	6,7473	-	2-Set-26	0,2	9,87	9,25	15,42
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,60	3 543	6,714	-	-	-	99,3909	-	-	-	6,7733	-	8-Set-26	15,0	13,11	12,28	28,42
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,71	115	2,89%+VAC	-	-	-	103,2301	-	-	-	1,4595	-	18-Ago-23	20	3,32	3,27	3,42
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,90	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	125,7607	-	-	-	3,7524	-	17-Dic-24	1	6,69	6,45	8,39
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,86	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,0461	-	-	-	4,3526	-	8-May-26	7	10,97	10,52	13,42
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,34	1 335	3,83% + VAC	-	-	-	98,4361	-	-	-	3,9243	-	11-Oct-24	52	14,21	13,68	19,92
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,29	3 070	3,26%+VAC	-	-	-	91,2668	-	-	-	3,7606	-	4-Set-26	12	18,04	17,39	27,42

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).

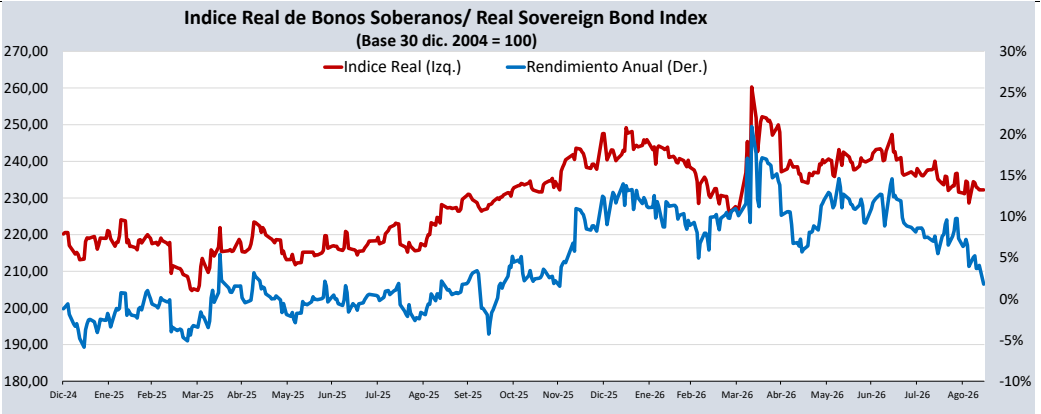
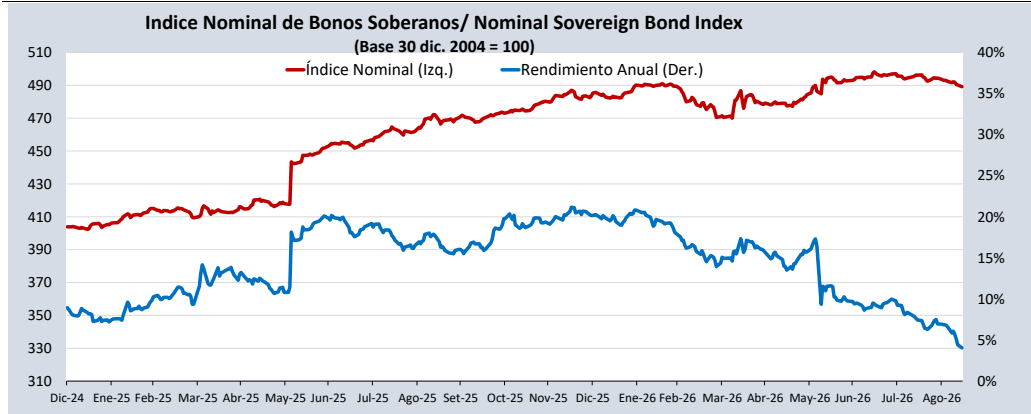


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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
25-ago-27	US715638BU55	449	4,125	99,8110	-0,01	-0,19	-0,48	4,3290	2	21	52	0,94	0,92	0,95
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,0780	-0,01	-0,58	-0,44	4,8780	0	19	14	3,57	3,48	3,77
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,6940	-0,31	-0,47	-0,52	3,8410	10	15	16	3,30	3,23	3,54
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,4510	-0,15	-1,09	-0,44	5,2640	4	31	12	4,10	4,00	4,36
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	81,0850	-0,23	-1,01	-0,42	5,4970	5	23	9	5,81	5,66	6,21
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,8140	-0,24	-1,28	-0,65	5,6920	4	19	10	5,51	5,36	7,19
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	83,2340	-0,33	-1,08	-0,75	4,2640	7	22	15	6,23	6,10	6,49
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,8950	-0,20	-1,12	-0,44	5,7190	4	21	8	6,52	6,34	7,34
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,3890	-0,22	-1,34	-0,45	5,7710	4	21	7	6,81	6,62	8,40
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,3900	-0,23	-1,38	-0,17	5,8610	3	19	3	7,33	7,12	9,54
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4040	-0,31	-1,05	-1,02	4,5200	4	15	15	9,06	8,86	10,18
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,0910	-0,21	-1,39	-0,69	5,8930	3	17	9	7,83	7,61	10,50
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	73,9850	-0,27	-1,89	-0,66	6,0150	3	24	8	11,06	10,74	14,49
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,5780	-0,24	-1,56	-0,63	6,3080	2	13	5	12,76	12,37	24,18
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,5920	-0,21	-1,36	-0,58	6,3340	2	15	6	14,45	14,01	24,49
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	93,5330	-0,18	-1,58	-0,62	6,3730	2	13	5	13,51	13,09	27,90
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	97,5330	-0,14	-1,54	-0,22	6,3880	1	12	2	13,42	13,00	28,79
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,8650	-0,23	-1,76	-0,66	6,2940	3	20	8	16,77	16,26	34,21
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,6500	-0,25	-1,39	-0,70	6,3060	3	14	7	16,51	16,00	45,34
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,2670	-0,16	-1,12	-0,73	6,3160	2	13	9	16,36	15,86	94,87

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-28	12-Feb-29	12-Ago-31	12-Ago-32	12-Ago-33	12-Ago-34	12-Ago-35	12-Ago-37	12-Ago-39	12-Ago-40	12-Feb-42	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	489	-1,0	-2,4	4,04	-39	-182	1,53	4,37	8,50	12,12	13,72	12,00	13,88	12,40	11,35	5,68	2,64	1,83

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-Feb-30				31-Ene-35		12-Feb-40		12-Feb-46		12-Feb-54	
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	232	0,02	-2,25	1,76	-228	-326	2,02				28,98		8,96		17,22		42,82	



Fuente/Source: 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 4:30 pm.