



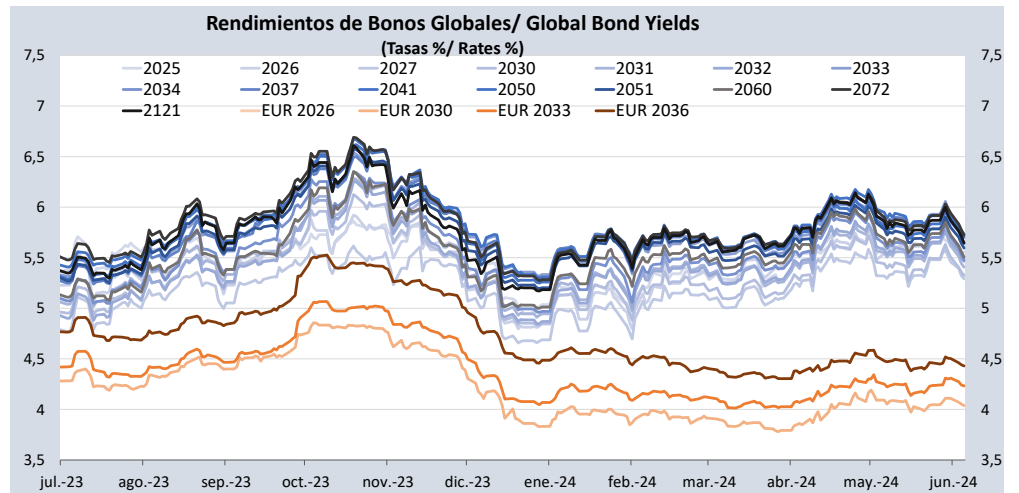
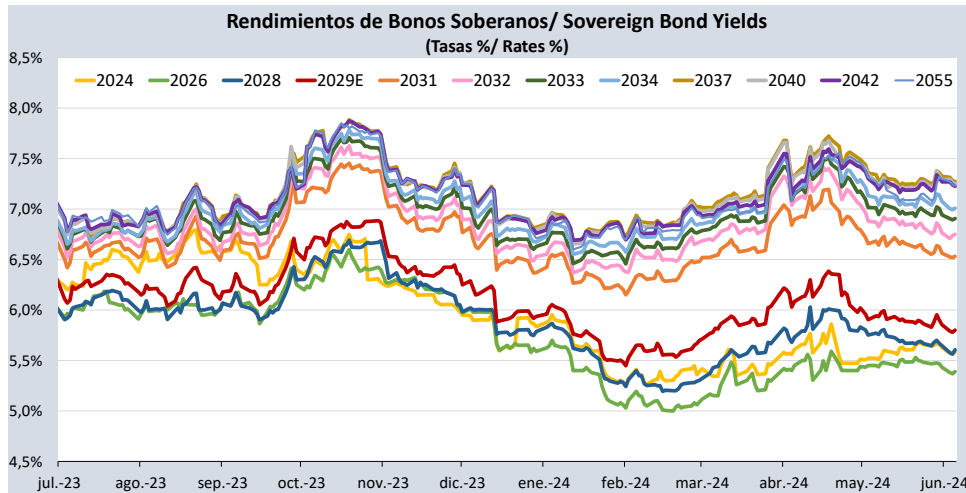
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

05/06/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente Millones S. / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración / Duración	Vida media / Average	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			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													
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	1,79	4 238	5,700	-	-	-	-	100,0145	-	-	-	5,5849	-	9-May-24	12	0,19	0,18	0,19
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,57	7 042	8,200	105,54	105,75	105,68	105,68	105,7040	5,45	5,35	5,38	5,3900	2	5-Jun-24	4	2,03	1,93	2,19
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,99	11 519	6,350	102,62	102,84	102,69	102,69	102,7149	5,63	5,57	5,61	5,6060	5	5-Jun-24	10	3,73	3,53	4,19
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,86	17 934	5,940	100,35	100,61	100,49	100,49	100,5292	5,84	5,78	5,81	5,8006	8	5-Jun-24	16	4,15	3,92	4,69
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,18	18 748	6,950	102,25	102,36	102,36	102,36	102,4126	6,56	6,54	6,54	6,5317	32	5-Jun-24	378	5,76	5,41	7,19
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,93	20 117	6,150	96,28	96,34	96,34	96,34	96,3327	6,76	6,75	6,75	6,7503	14	5-Jun-24	37	6,48	6,07	8,19
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,29	17 180	7,300	102,64	102,81	102,64	102,64	102,7365	6,92	6,90	6,92	6,9060	21	5-Jun-24	101	6,84	6,40	9,19
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,69	16 211	5,400	88,47	89,13	88,53	88,53	88,5331	7,02	6,92	7,01	7,0083	25	5-Jun-24	85	7,77	7,26	10,19
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,16	19 580	6,900	96,84	97,22	97,04	97,04	97,0226	7,30	7,25	7,27	7,2747	40	5-Jun-24	432	8,73	8,14	13,19
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,68	11 068	5,350	82,00	82,65	82,24	82,24	82,2322	7,28	7,20	7,25	7,2500	5	5-Jun-24	11	10,38	9,68	16,19
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,15	5 033	6,850	-	-	-	-	96,4663	-	-	-	7,2251	-	27-May-24	5	10,30	9,61	17,69
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,10	3 387	6,714	-	-	-	-	93,9088	-	-	-	7,2290	-	3-Jun-24	6	12,79	11,93	30,69
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	0,99	884	6,84% + VAC	-	-	-	-	101,3296	-	-	-	3,0051	-	31-Oct-22	2	0,36	0,35	0,36
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,90	77	2,89%+VAC	-	-	-	-	101,3296	-	-	-	3,3404	-	18-Ago-23	20	5,31	5,14	5,69
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,56	911	7,39% + VAC	-	-	-	-	126,2716	-	-	-	4,2725	-	10-Jun-22	10	7,90	7,57	10,66
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,98	228	3,14%+VAC	-	-	-	-	84,9462	-	-	-	4,4713	-	10-Ago-23	50	12,21	11,69	15,69
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,20	424	3,83% + VAC	-	-	-	-	91,1689	-	-	-	4,4444	-	21-Jul-22	2	14,79	14,16	22,19
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,02	383	3,26%+VAC	-	-	-	-	80,4193	-	-	-	4,4466	-	12-Ago-21	10	17,93	17,16	29,69

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.

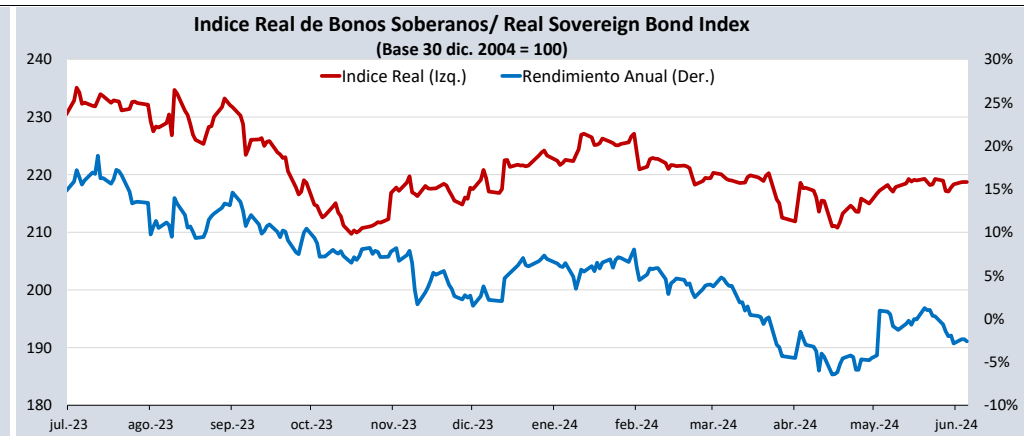
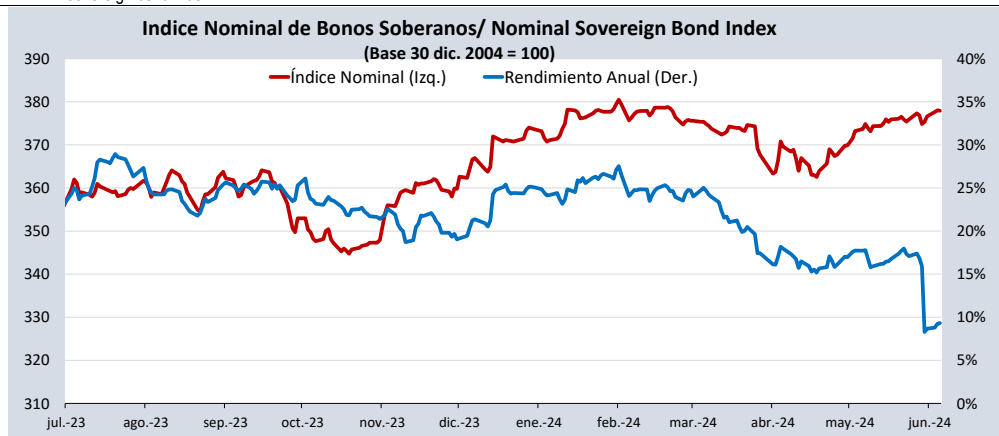
Bonos globales**** / Global bonds

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
21-jul-25	US715638AS19	888	7,350	101,9200	-0,03	0,10	-0,42	5,5570	2	-11	38	1,08	1,05	1,14
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,2090	0,07	0,54	-0,43	5,5020	-4	-33	28	1,60	1,55	1,66
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,9320	0,05	0,11	-0,65	4,0650	-3	-5	42	1,61	1,58	1,68
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,5840	0,10	0,83	-0,46	5,2910	-3	-28	16	3,01	2,93	3,27
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,3300	0,17	1,47	-0,51	5,3250	-4	-31	11	5,47	5,33	6,13
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,5400	0,08	0,37	-0,77	4,0380	-1	-7	15	5,08	4,98	5,74
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,5380	0,19	1,80	-0,52	5,4070	-4	-36	10	5,98	5,82	6,73
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,8000	0,22	1,75	-0,52	5,4640	-4	-30	9	7,77	7,57	8,61
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,7560	0,23	2,56	-1,00	5,7370	-3	-32	12	6,90	6,71	9,60
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,5460	0,07	0,53	-0,97	4,2320	-1	-8	16	8,23	8,06	8,89
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,6940	0,39	2,40	-0,65	5,4750	-6	-37	10	8,15	7,93	9,75
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,6490	0,10	0,74	-0,89	4,4300	-1	-9	11	10,85	10,62	12,63
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,3750	0,36	2,78	-0,86	5,7270	-4	-30	9	8,88	8,63	12,96
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,8360	0,52	2,85	-0,76	5,6400	-6	-32	9	12,18	11,84	17,01
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,9710	0,50	4,08	-0,80	5,7010	-4	-31	6	13,96	13,58	26,84
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,7960	0,53	3,27	-0,84	5,5950	-5	-31	8	15,46	15,04	27,15
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,3170	0,56	3,41	-0,75	5,5060	-5	-35	7	18,51	18,01	37,02
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,4300	0,62	3,38	-0,79	5,7230	-5	-31	7	17,57	17,08	48,31
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,3910	0,67	3,39	-0,72	5,6460	-7	-35	7	18,04	17,54	98,56

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-24	12-Ago-26	12-Ago-28	12-Feb-29	12-Ago-31	12-Ago-32	12-Ago-33	12-Ago-34	12-Ago-37	12-Ago-40	12-Feb-42	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	378	0	3	9,33	11	-660	-	5,19	8,21	12,51	13,36	13,46	12,29	9,96	13,18	6,33	3,38	2,13

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 / Real sovereign bond index	219	0	2	-2,61	-25	-58	29,63	2,48	38,43	6,42	12,83	10,22



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