



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

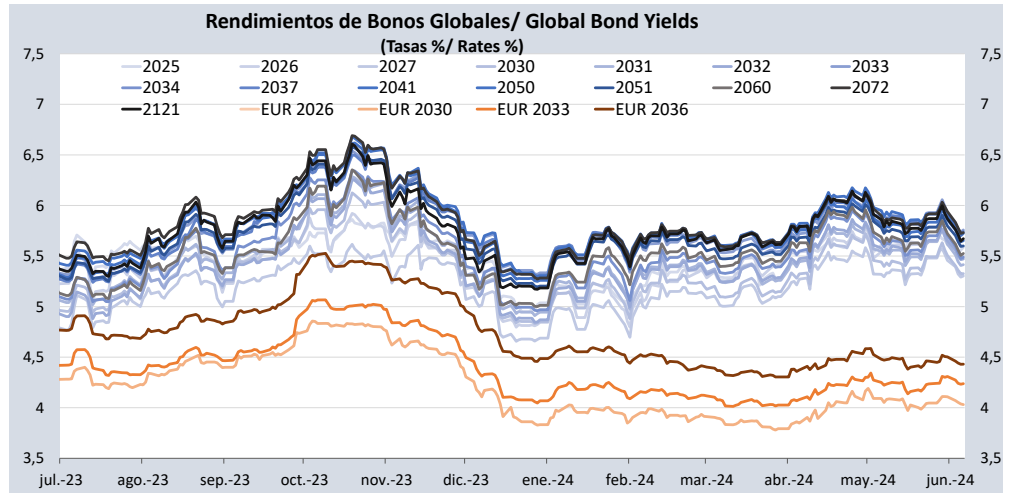
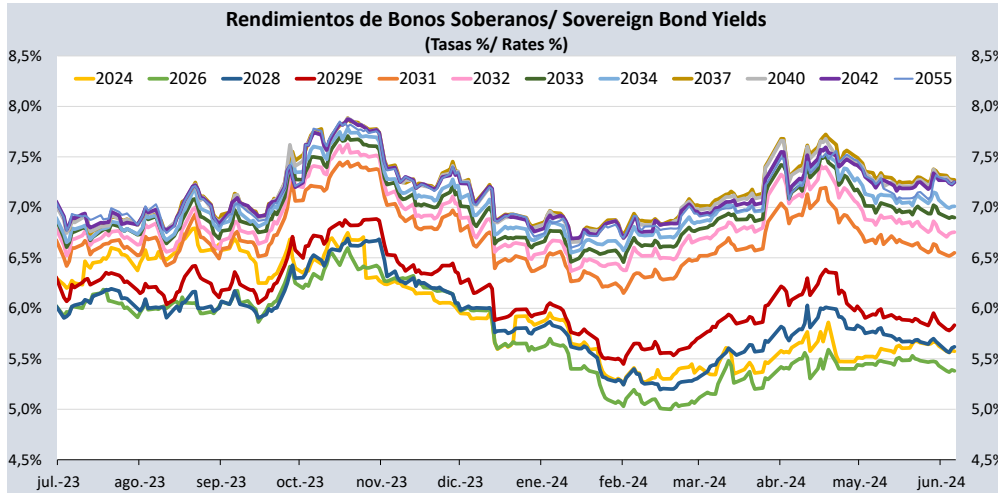
06/06/2024

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 Años / Years	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average Años / Years
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)			
				Compra / Bid	Venta / Ask	Compra / Bid	Venta / Ask												
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	1,80	4 238	5,700	-	-	-	100,0160	-	-	-	5,5749	-	9-May-24	12	0,19	0,18	0,19
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,59	7 042	8,200	105,53	105,72	105,68	105,7181	5,45	5,36	5,38	5,3800	1	6-Jun-24	2	2,03	1,93	2,19
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,01	11 519	6,350	102,60	102,76	102,69	102,6656	5,64	5,59	5,61	5,6189	12	6-Jun-24	27	3,73	3,53	4,19
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,88	17 934	5,940	100,34	100,53	100,41	100,4010	5,85	5,80	5,83	5,8325	55	6-Jun-24	331	4,15	3,92	4,69
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,20	18 748	6,950	102,39	102,47	102,42	102,3074	6,54	6,52	6,53	6,5502	24	6-Jun-24	128	5,76	5,40	7,19
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,94	20 117	6,150	96,34	96,52	96,46	96,3128	6,75	6,72	6,73	6,7538	31	6-Jun-24	171	6,48	6,07	8,19
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,31	17 180	7,300	102,97	103,24	103,04	102,7843	6,87	6,83	6,86	6,8988	29	6-Jun-24	191	6,84	6,39	9,19
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,71	16 211	5,400	88,47	88,73	88,67	88,5241	7,02	6,98	6,99	7,0100	38	6-Jun-24	301	7,77	7,26	10,19
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,18	19 580	6,900	96,78	97,22	97,14	97,0439	7,31	7,25	7,26	7,2721	66	6-Jun-24	311	8,73	8,13	13,19
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,69	11 068	5,350	81,76	82,57	82,41	82,2810	7,31	7,21	7,23	7,2442	12	6-Jun-24	24	10,38	9,68	16,19
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,16	5 033	6,850	96,23	96,61	96,23	96,2311	7,25	7,21	7,25	7,2500	1	6-Jun-24	2	10,29	9,59	17,69
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,12	3 387	6,714	-	-	-	93,6245	-	-	-	7,2539	-	3-Jun-24	6	12,77	11,90	30,69
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,01	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,3228	-	-	-	2,9955	-	31-Oct-22	2	0,36	0,35	0,36
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,91	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,3228	-	-	-	3,3663	-	18-Ago-23	20	5,31	5,13	5,69
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,58	911	7,39% + VAC	-	-	-	126,2556	-	-	-	4,2736	-	10-Jun-22	10	7,89	7,57	10,66
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,99	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,9983	-	-	-	4,4663	-	10-Ago-23	50	12,21	11,69	15,69
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,21	424	3,83% + VAC	-	-	-	90,8525	-	-	-	4,4687	-	21-Jul-22	2	14,77	14,14	22,19
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,03	383	3,26%+VAC	-	-	-	80,0815	-	-	-	4,4709	-	12-Ago-21	10	17,90	17,13	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.

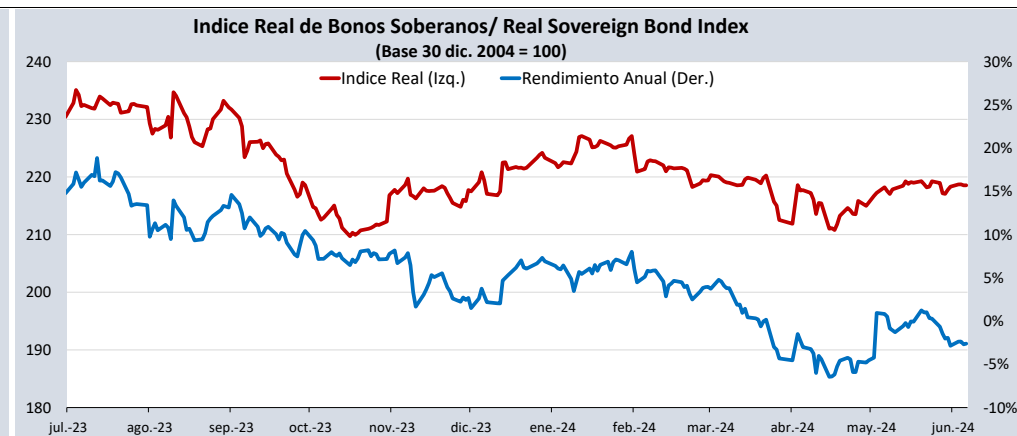
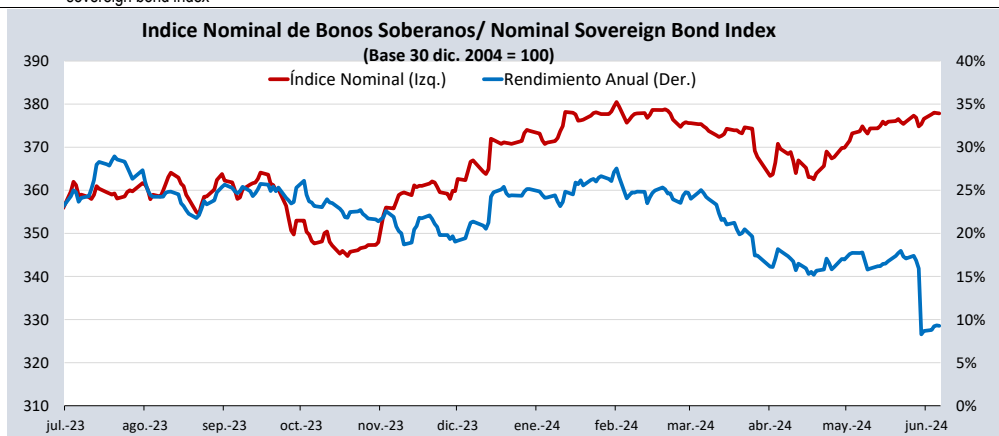
Bonos globales**** / Global bonds

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
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,2190	0,01	0,45	-0,45	5,5010	0	-26	31	1,59	1,55	1,66
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,9690	0,04	0,17	-0,77	4,0470	-2	-10	50	1,61	1,58	1,68
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,5500	-0,03	0,63	-0,47	5,3030	1	-21	16	3,01	2,93	3,26
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,3270	0,00	1,13	-0,53	5,3260	0	-23	11	5,47	5,33	6,13
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,5750	0,03	0,40	-0,88	4,0310	-1	-8	18	5,07	4,97	5,73
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,5020	-0,04	1,39	-0,54	5,4150	1	-27	11	5,98	5,82	6,73
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,7630	-0,04	1,35	-0,57	5,4710	1	-23	10	7,77	7,56	8,61
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,5770	-0,18	1,84	-0,98	5,7580	2	-23	12	6,89	6,70	9,60
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,5240	-0,02	0,43	-0,95	4,2380	1	-6	15	8,22	8,05	8,89
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,6120	-0,08	1,85	-0,59	5,4880	1	-28	9	8,14	7,93	9,75
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,6500	0,00	0,62	-0,88	4,4310	0	-8	11	10,85	10,62	12,63
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,2260	-0,15	2,11	-0,93	5,7420	1	-23	10	8,87	8,63	12,96
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,7340	-0,10	2,26	-0,72	5,6520	1	-26	8	12,17	11,84	17,01
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,6690	-0,30	2,91	-0,73	5,7230	2	-22	5	13,94	13,56	26,84
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,7600	-0,05	2,65	-0,80	5,5990	0	-25	7	15,46	15,04	27,15
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,1160	-0,20	2,52	-0,66	5,5250	2	-25	6	18,47	17,98	37,02
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,3400	-0,09	2,79	-0,75	5,7310	1	-25	7	17,55	17,06	48,30
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,1360	-0,25	2,42	-0,72	5,6710	3	-25	7	17,96	17,46	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	2	9,28	-5	99	-	5,20	8,21	12,50	13,35	13,47	12,30	9,97	13,19	6,33	3,37	2,12

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	1	-2,61	8	-67	29,65	2,48	38,46	6,43	12,79	10,19



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