



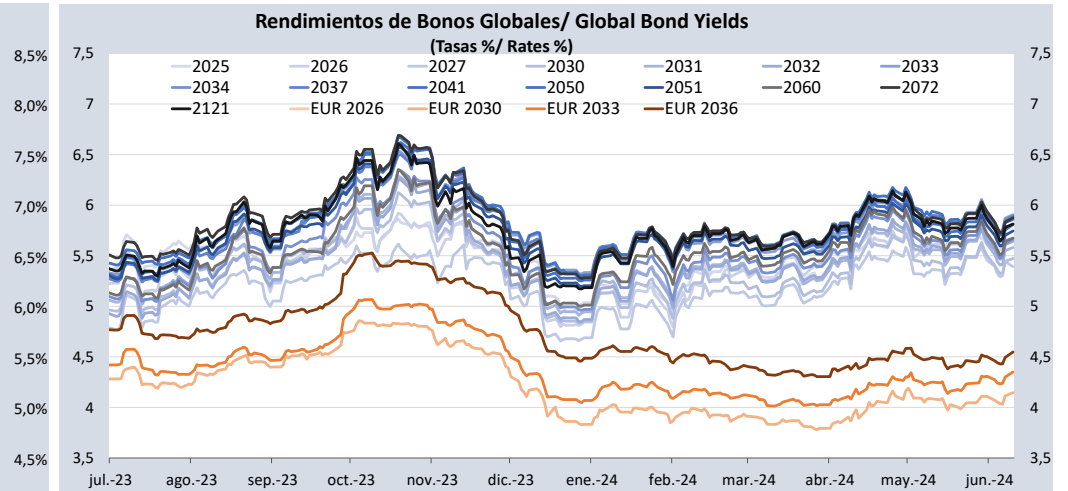
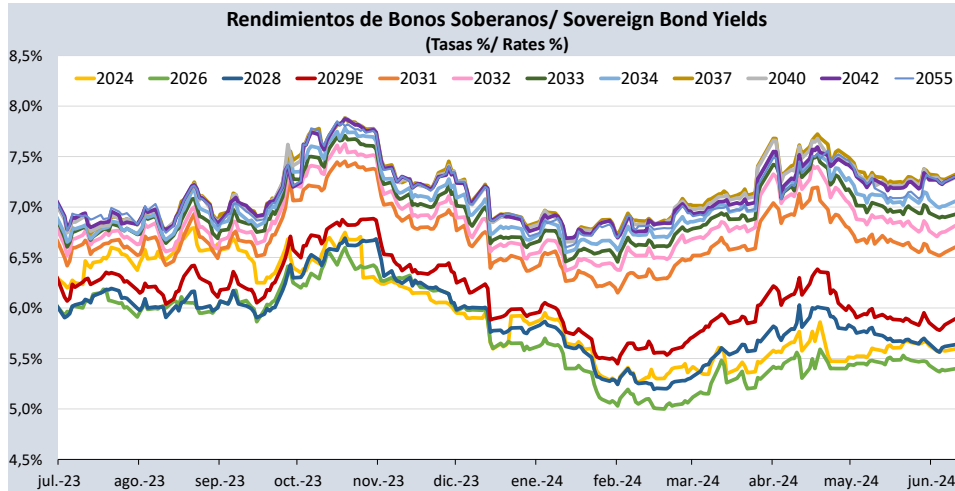
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

10/06/2024

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	1,86	4 238	5,700	-	-	-	100,0117	-	-	-	5,5927	-	9-May-24	12	0,18	0,17	0,18
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,68	7 042	8,200	-	-	-	105,6542	-	-	-	5,3978	-	6-Jun-24	2	2,02	1,91	2,18
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,08	11 519	6,350	102,39	102,61	102,54	102,5938	5,69	5,63	5,65	5,6367	13	10-Jun-24	52	3,72	3,52	4,18
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,94	17 934	5,940	100,04	100,33	100,25	100,1654	5,92	5,85	5,87	5,8913	10	10-Jun-24	188	4,13	3,90	4,68
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,27	18 748	6,950	101,62	102,25	102,14	102,0160	6,67	6,56	6,58	6,6015	24	10-Jun-24	64	5,74	5,39	7,18
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,01	20 117	6,150	95,45	96,10	96,04	95,9587	6,90	6,79	6,80	6,8140	31	10-Jun-24	270	6,47	6,05	8,18
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,39	17 180	7,300	102,10	102,57	102,50	102,5889	7,00	6,93	6,94	6,9276	26	10-Jun-24	116	6,82	6,38	9,18
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,77	16 211	5,400	87,63	88,21	88,21	88,2284	7,15	7,06	7,06	7,0566	41	10-Jun-24	305	7,75	7,24	10,18
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,26	19 580	6,900	95,97	96,58	96,54	96,6489	7,41	7,33	7,34	7,3214	27	10-Jun-24	161	8,70	8,11	13,18
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,75	11 068	5,350	81,28	82,33	81,68	81,9094	7,37	7,24	7,32	7,2909	5	10-Jun-24	22	10,35	9,65	16,18
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,24	5 033	6,850	94,83	96,71	95,76	95,7622	7,40	7,20	7,30	7,3000	1	10-Jun-24	2	10,26	9,56	17,68
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,20	3 387	6,714	-	-	-	93,0584	-	-	-	7,3039	-	3-Jun-24	6	12,71	11,84	30,68
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,08	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2601	-	-	-	3,0578	-	31-Oct-22	2	0,35	0,34	0,35
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,94	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2601	-	-	-	3,4970	-	18-Ago-23	20	5,29	5,11	5,68
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,66	911	7,39% + VAC	-	-	-	125,0453	-	-	-	4,3964	-	10-Jun-22	10	7,87	7,53	10,65
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,03	228	3,14%+VAC	-	-	-	83,7807	-	-	-	4,5893	-	10-Ago-23	50	12,17	11,64	15,68
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,25	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,2366	-	-	-	4,5946	-	21-Jul-22	2	14,68	14,03	22,18
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,07	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,3625	-	-	-	4,5968	-	12-Ago-21	10	17,74	16,96	29,68

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.

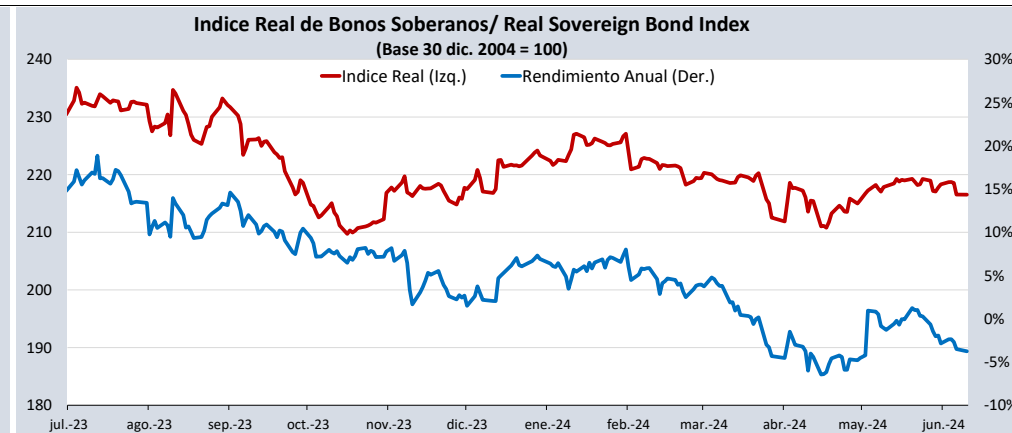
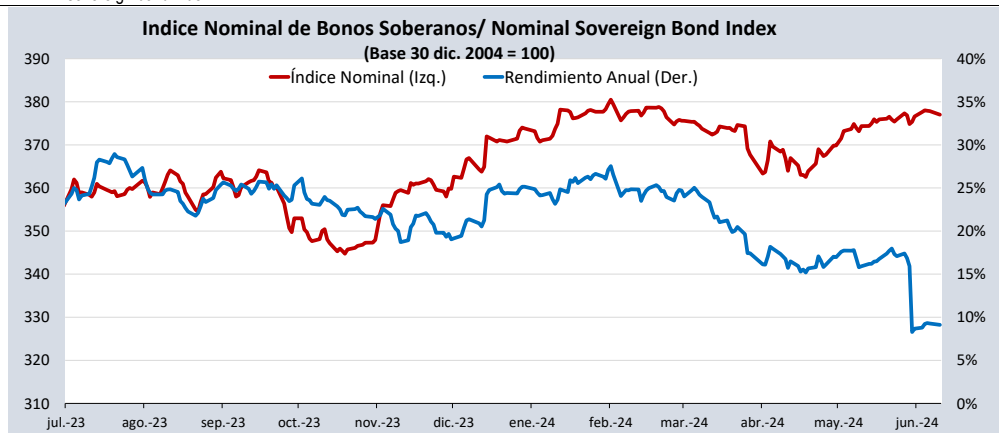
Bonos globales**** / Global bonds

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	101,7930	0,00	-0,12	-0,42	5,6540	-1	8	39	1,06	1,03	1,13
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,0360	0,00	-0,01	-0,49	5,6460	1	5	33	1,58	1,54	1,64
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,8310	-0,04	-0,03	-0,77	4,1420	3	4	50	1,60	1,57	1,66
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,3120	0,15	0,03	-0,29	5,3910	-5	0	10	3,00	2,92	3,25
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	86,6610	-0,12	-0,29	-0,53	5,4730	3	7	11	5,46	5,31	6,11
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,0040	-0,16	-0,37	-0,88	4,1460	3	8	18	5,06	4,96	5,72
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	84,6940	-0,14	-0,31	-0,56	5,5810	3	7	11	5,96	5,80	6,72
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	74,8180	-0,17	-0,43	-0,56	5,6420	3	8	10	7,75	7,54	8,60
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,3650	-0,28	-0,68	-0,94	5,9050	3	8	12	6,87	6,67	9,59
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	77,8400	-0,30	-0,43	-0,83	4,3500	5	8	13	8,21	8,03	8,88
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	80,4710	-0,31	-0,42	-0,62	5,6660	5	7	10	8,12	7,89	9,74
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	75,7290	-0,42	-0,66	-0,91	4,5480	5	9	12	10,83	10,59	12,62
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,8340	-0,36	-0,71	-0,93	5,8920	4	8	10	8,83	8,58	12,94
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	73,3630	-0,46	-0,41	-0,73	5,8080	5	5	8	12,11	11,77	16,99
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	96,8740	-0,40	-0,83	-0,75	5,8590	3	6	6	13,82	13,42	26,83
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,1970	-0,44	-0,44	-0,81	5,7440	4	4	8	15,31	14,88	27,14
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,6080	-0,34	-0,57	-0,64	5,6750	3	6	7	18,21	17,71	37,01
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,7390	-0,47	-0,45	-0,77	5,8750	4	4	7	17,22	16,73	48,29
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,7340	-0,32	-0,48	-0,72	5,8130	3	5	7	17,51	17,01	98,54

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	377	-1	-1	9,11	-17	32	-	5,21	8,23	12,50	13,35	13,46	12,31	9,96	13,17	6,32	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	217	0	-2	-3,76	-27	-139	29,91	2,48	38,46	6,39	12,69	10,07



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