



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

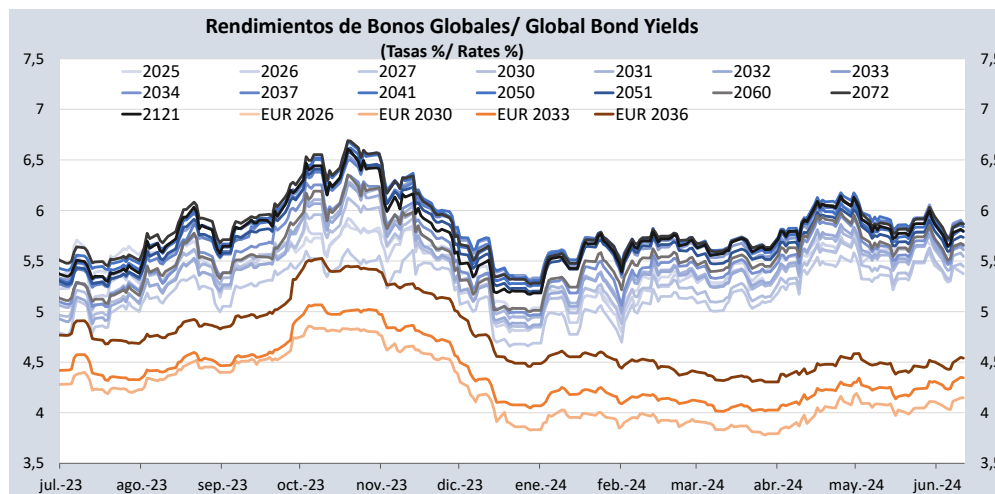
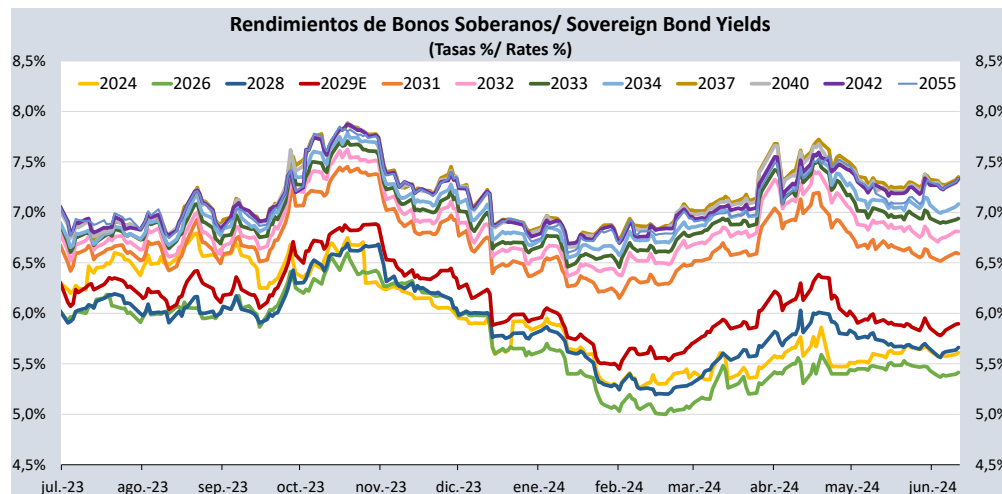
11/06/2024

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	1,88	4 238	5,700	-	-	-	100,0086	-	-	-	5,6099	-	9-May-24	12	0,17	0,16	0,17
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,70	7 042	8,200	105,52	106,04	105,58	105,6119	5,45	5,20	5,42	5,4150	2	11-Jun-24	4	2,02	1,91	2,17
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,09	11 519	6,350	102,36	102,80	102,50	102,4992	5,70	5,58	5,66	5,6620	6	11-Jun-24	12	3,72	3,52	4,17
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,96	17 934	5,940	100,13	100,25	100,17	100,1474	5,90	5,87	5,89	5,8958	22	11-Jun-24	45	4,13	3,90	4,67
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,29	18 748	6,950	102,02	102,19	102,13	102,0767	6,60	6,57	6,58	6,5906	18	11-Jun-24	73	5,74	5,39	7,17
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,03	20 117	6,150	95,81	96,11	96,11	95,9870	6,84	6,79	6,79	6,8094	58	11-Jun-24	233	6,46	6,05	8,17
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,41	17 180	7,300	102,40	102,77	102,50	102,5114	6,96	6,90	6,94	6,9391	48	11-Jun-24	236	6,82	6,38	9,17
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,78	16 211	5,400	87,89	88,22	88,22	88,0635	7,11	7,06	7,06	7,0823	26	11-Jun-24	88	7,74	7,23	10,17
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,27	19 580	6,900	96,18	96,45	96,42	96,4132	7,38	7,35	7,35	7,3509	21	11-Jun-24	304	8,70	8,10	13,17
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,76	11 068	5,350	81,44	81,84	81,76	81,6486	7,35	7,30	7,31	7,3235	9	11-Jun-24	31	10,34	9,63	16,17
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,26	5 033	6,850	-	-	-	95,4578	-	-	-	7,3326	-	10-Jun-24	2	10,24	9,54	17,67
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,21	3 387	6,714	-	-	-	92,6921	-	-	-	7,3365	-	3-Jun-24	6	12,67	11,81	30,67
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,10	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2473	-	-	-	3,0654	-	31-Oct-22	2	0,34	0,33	0,34
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,95	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2473	-	-	-	3,4862	-	18-Ago-23	20	5,29	5,11	5,67
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,68	911	7,39% + VAC	-	-	-	124,8836	-	-	-	4,4127	-	10-Jun-22	10	7,86	7,53	10,64
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,04	228	3,14%+VAC	-	-	-	83,5659	-	-	-	4,6113	-	10-Ago-23	50	12,16	11,62	15,67
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,26	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,9536	-	-	-	4,6170	-	21-Jul-22	2	14,66	14,02	22,17
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,08	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,0625	-	-	-	4,6192	-	12-Ago-21	10	17,71	16,93	29,67

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.

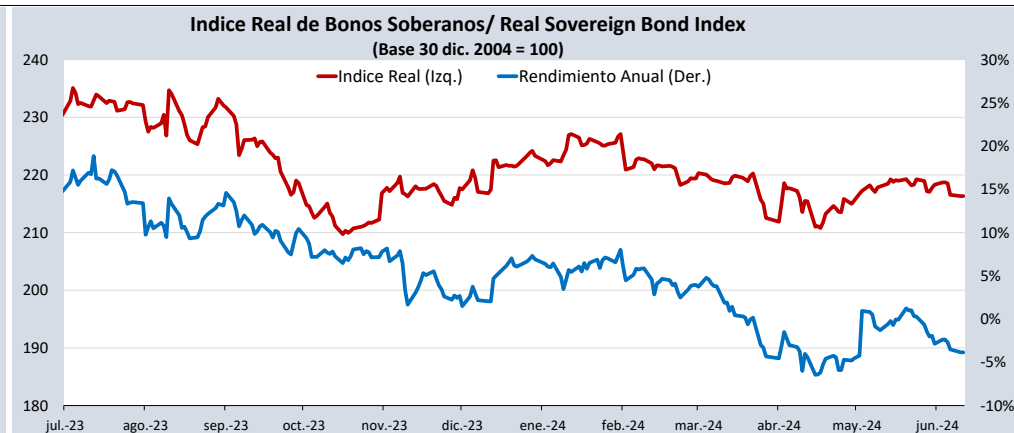
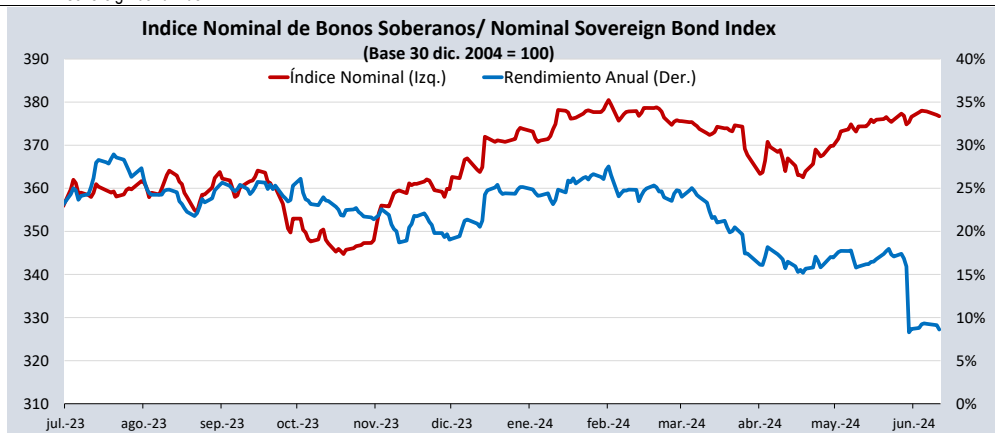
Bonos globales**** / Global bonds

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	95,0710	0,03	-0,07	-0,47	5,6280	-2	9	32	1,58	1,54	1,64
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,8220	-0,01	-0,06	-0,53	4,1500	1	6	35	1,60	1,56	1,66
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,3610	0,05	-0,13	-0,44	5,3750	-2	5	15	3,00	2,92	3,25
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	86,7910	0,13	-0,37	-0,54	5,4460	-3	9	12	5,45	5,31	6,11
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	97,9980	-0,01	-0,47	-0,56	4,1480	0	9	11	5,06	4,95	5,72
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	84,8790	0,19	-0,47	-0,52	5,5450	-4	10	10	5,96	5,80	6,71
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,0100	0,19	-0,57	-0,57	5,6090	-3	11	10	7,75	7,54	8,60
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,6570	0,29	-0,87	-0,94	5,8680	-4	10	12	6,87	6,67	9,58
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	77,8670	0,03	-0,61	-0,85	4,3460	0	11	14	8,21	8,03	8,88
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	80,5790	0,11	-0,72	-0,65	5,6500	-2	12	10	8,12	7,89	9,74
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	75,8010	0,07	-0,75	-0,94	4,5390	-1	10	12	10,83	10,59	12,62
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,0400	0,21	-0,98	-0,86	5,8690	-2	10	9	8,84	8,58	12,94
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	73,5240	0,16	-0,80	-0,78	5,7900	-2	9	9	12,11	11,77	16,99
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,1320	0,26	-1,34	-0,71	5,8390	-2	10	5	13,83	13,44	26,82
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,2990	0,10	-0,97	-0,82	5,7340	-1	9	8	15,32	14,89	27,13
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	55,7380	0,13	-1,01	-0,71	5,6620	-1	10	7	18,23	17,73	37,01
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,8430	0,10	-0,97	-0,75	5,8650	-1	9	7	17,24	16,75	48,29
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	55,9070	0,17	-0,82	-0,73	5,7950	-2	8	8	17,56	17,07	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	0	-1	8,61	-50	-61	-	5,21	8,23	12,51	13,37	13,47	12,32	9,95	13,15	6,31	3,36	2,11

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	216	0	-2	-3,85	0	-148	29,96	2,49	38,47	6,39	12,66	10,04



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