



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

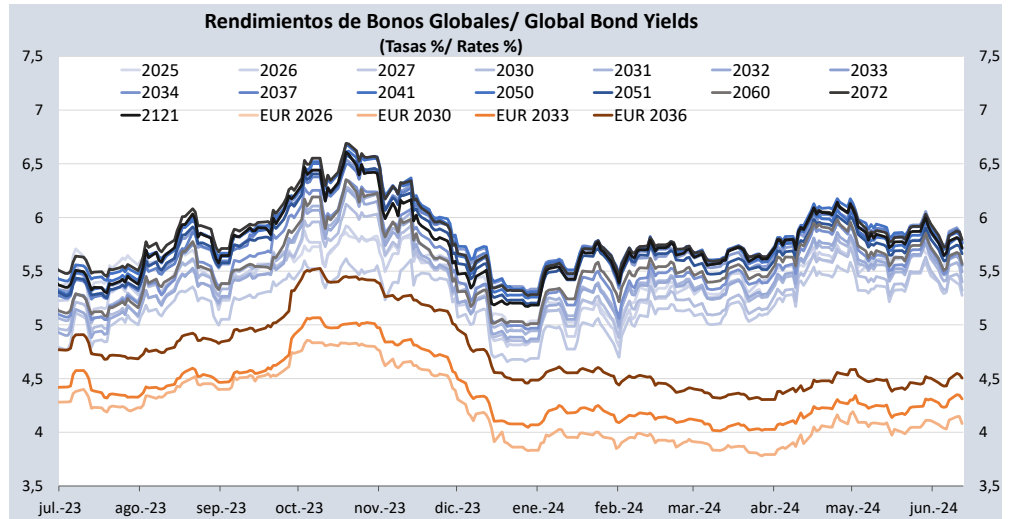
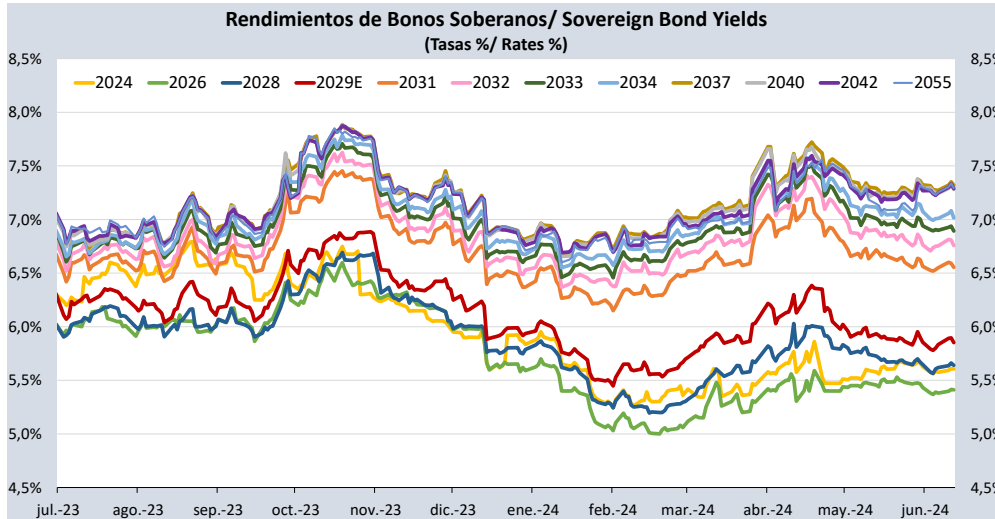
12/06/2024

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 Años / Years	Vida media / Average Life 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	1,89	4 238	5,700	-	-	-	100,0092	-	-	-	5,6052	-	9-May-24	12	0,17	0,16	0,17
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,73	7 042	8,200	105,50	106,02	105,60	105,6149	5,45	5,20	5,40	5,4103	11	12-Jun-24	21	2,01	1,91	2,17
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,11	11 519	6,350	102,49	102,90	102,72	102,5786	5,66	5,55	5,60	5,6400	6	12-Jun-24	10	3,71	3,51	4,17
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,97	17 934	5,940	100,25	100,73	100,29	100,3243	5,87	5,75	5,86	5,8514	11	12-Jun-24	21	4,13	3,90	4,67
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,31	18 748	6,950	102,13	102,47	102,30	102,2831	6,58	6,52	6,55	6,5538	39	12-Jun-24	275	5,74	5,39	7,17
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,04	20 117	6,150	96,18	96,64	96,29	96,2994	6,78	6,70	6,76	6,7570	22	12-Jun-24	113	6,46	6,06	8,17
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,43	17 180	7,300	102,64	103,11	102,84	102,8205	6,92	6,85	6,89	6,8929	21	12-Jun-24	210	6,82	6,38	9,17
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,80	16 211	5,400	88,29	88,88	88,35	88,5023	7,05	6,96	7,04	7,0153	24	12-Jun-24	147	7,75	7,24	10,17
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,29	19 580	6,900	96,42	97,15	96,58	96,6611	7,35	7,26	7,33	7,3200	4	12-Jun-24	16	8,70	8,11	13,17
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,78	11 068	5,350	81,77	82,17	82,00	82,0007	7,31	7,26	7,28	7,2800	3	12-Jun-24	37	10,35	9,65	16,17
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,28	5 033	6,850	-	-	-	95,8651	-	-	-	7,2891	-	10-Jun-24	2	10,26	9,56	17,67
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,23	3 387	6,714	-	-	-	93,1819	-	-	-	7,2930	-	3-Jun-24	6	12,71	11,85	30,67
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,12	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2388	-	-	-	3,0609	-	31-Oct-22	2	0,34	0,33	0,34
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,96	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2388	-	-	-	3,4459	-	18-Ago-23	20	5,29	5,11	5,67
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,70	911	7,39% + VAC	-	-	-	125,4536	-	-	-	4,3530	-	10-Jun-22	10	7,87	7,54	10,64
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,04	228	3,14%+VAC	-	-	-	83,9654	-	-	-	4,5710	-	10-Ago-23	50	12,17	11,64	15,67
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,27	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,4914	-	-	-	4,5747	-	21-Jul-22	2	14,69	14,04	22,17
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,09	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,6331	-	-	-	4,5769	-	12-Ago-21	10	17,76	16,98	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).



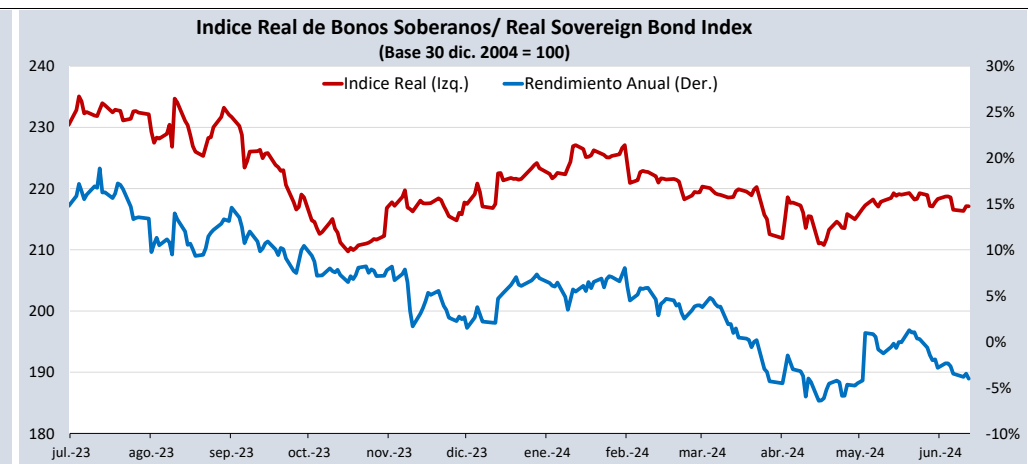
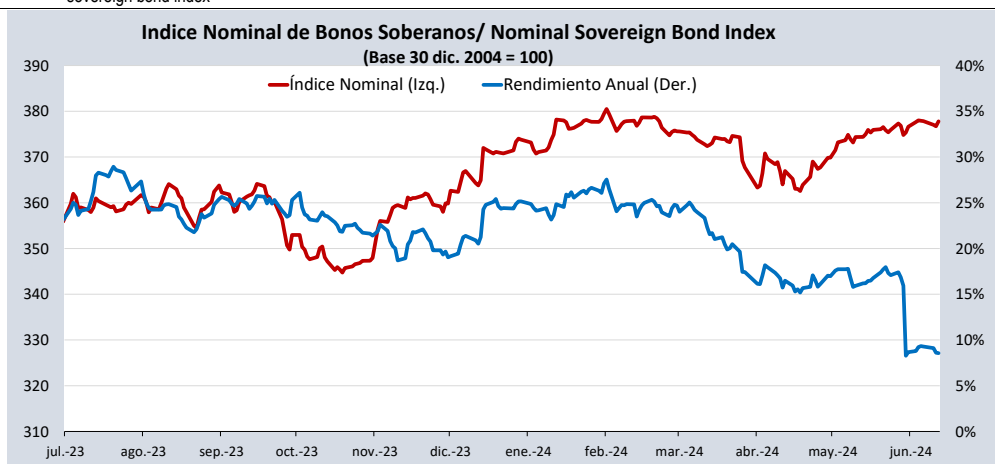
Bonos globales**** / Global bonds

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	101,8750	0,09	-0,05	-0,43	5,5700	-8	1	40	1,06	1,03	1,12
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,1880	0,12	-0,02	-0,45	5,5540	-7	5	31	1,58	1,53	1,64
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,9380	0,12	0,01	-0,65	4,0760	-7	1	42	1,59	1,56	1,66
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,6510	0,29	0,07	-0,39	5,2740	-10	-2	14	2,99	2,92	3,25
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,3810	0,59	0,05	-0,48	5,3210	-13	0	10	5,45	5,31	6,11
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,3280	0,33	-0,21	-0,79	4,0810	-7	4	16	5,06	4,95	5,72
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,6120	0,73	0,07	-0,48	5,3990	-15	-1	9	5,96	5,80	6,71
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,6760	0,67	-0,12	-0,49	5,4930	-12	3	9	7,75	7,55	8,59
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,5300	0,87	-0,23	-0,93	5,7600	-11	2	11	6,88	6,69	9,58
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,1000	0,23	-0,45	-0,86	4,3100	-4	8	14	8,21	8,03	8,87
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,2140	0,64	-0,48	-0,62	5,5530	-10	8	10	8,12	7,90	9,73
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,0860	0,28	-0,56	-0,94	4,5040	-4	7	12	10,83	10,59	12,61
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,9350	0,89	-0,44	-0,90	5,7730	-10	5	10	8,85	8,60	12,94
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,2390	0,72	-0,60	-0,77	5,7090	-8	7	9	12,14	11,80	16,99
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,1930	1,06	-0,78	-0,70	5,7590	-8	6	5	13,90	13,51	26,82
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,0690	0,77	-0,73	-0,86	5,6620	-7	7	8	15,38	14,96	27,13
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,6960	0,96	-0,62	-0,59	5,5670	-9	6	6	18,39	17,89	37,00
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,6310	0,79	-0,80	-0,79	5,7940	-7	7	7	17,39	16,90	48,29
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,6830	0,78	-0,71	-0,74	5,7160	-8	7	7	17,80	17,30	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	378	1	0	8,57	-5	-76	-	5,20	8,22	12,50	13,36	13,48	12,32	9,97	13,15	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	-1	-4,03	-54	-134	29,85	2,48	38,50	6,39	12,69	10,08



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