



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

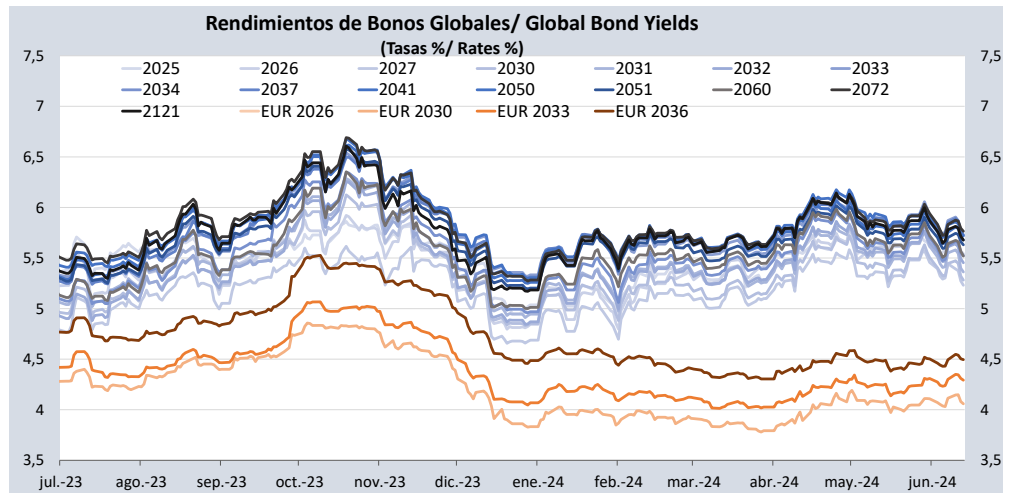
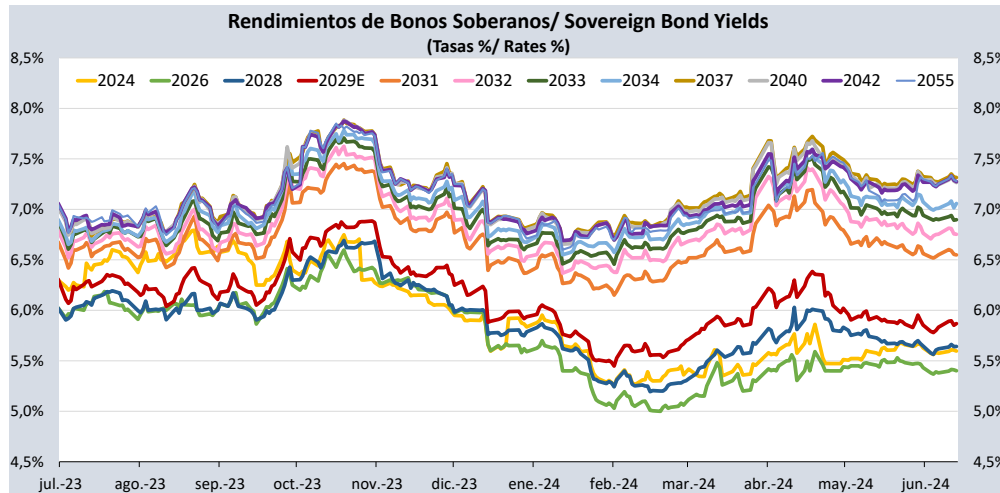
13/06/2024

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	1,91	4 238	5,700	-	-	-	-	-	-	-	5,5963	-	9-May-24	12	0,17	0,16	0,17
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,75	7 042	8,200	105,53	105,64	105,58	105,58	5,43	5,38	5,41	5,4014	7	13-Jun-24	14	2,01	1,91	2,17
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,13	11 519	6,350	102,42	102,79	102,57	102,57	5,68	5,58	5,64	5,6425	12	13-Jun-24	18	3,71	3,51	4,17
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,99	17 934	5,940	100,25	100,41	100,29	100,29	5,87	5,83	5,86	5,8688	26	13-Jun-24	103	4,13	3,90	4,67
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,33	18 748	6,950	102,41	102,47	102,47	102,3101	6,53	6,52	6,52	6,5489	51	13-Jun-24	307	5,74	5,38	7,17
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,06	20 117	6,150	96,23	96,94	96,47	96,3236	6,77	6,65	6,73	6,7531	24	13-Jun-24	187	6,46	6,05	8,17
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,45	17 180	7,300	102,77	102,90	102,90	102,7938	6,90	6,88	6,88	6,8968	15	13-Jun-24	30	6,82	6,38	9,17
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,81	16 211	5,400	88,16	89,07	88,35	88,2233	7,07	6,93	7,04	7,0584	10	13-Jun-24	57	7,74	7,23	10,17
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,31	19 580	6,900	96,66	97,23	96,90	96,6984	7,32	7,25	7,29	7,3154	12	13-Jun-24	224	8,70	8,10	13,17
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,79	11 068	5,350	81,93	82,99	82,17	82,1213	7,29	7,16	7,26	7,2653	5	13-Jun-24	17	10,35	9,65	16,17
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,30	5 033	6,850	-	-	-	96,0026	-	-	-	7,2745	-	10-Jun-24	2	10,26	9,57	17,67
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,25	3 387	6,714	93,10	94,24	93,34	93,3406	7,30	7,20	7,28	7,2790	3	13-Jun-24	32	12,72	11,86	30,67
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,14	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2316	-	-	-	3,0522	-	31-Oct-22	2	0,34	0,33	0,34
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,97	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2316	-	-	-	3,4542	-	18-Ago-23	20	5,29	5,11	5,67
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,72	911	7,39% + VAC	-	-	-	125,1139	-	-	-	4,3877	-	10-Jun-22	10	7,86	7,53	10,64
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,05	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,0930	-	-	-	4,5583	-	10-Ago-23	50	12,17	11,64	15,67
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,28	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,6708	-	-	-	4,5607	-	21-Jul-22	2	14,69	14,05	22,17
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,09	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,8198	-	-	-	4,5632	-	12-Ago-21	10	17,77	17,00	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.

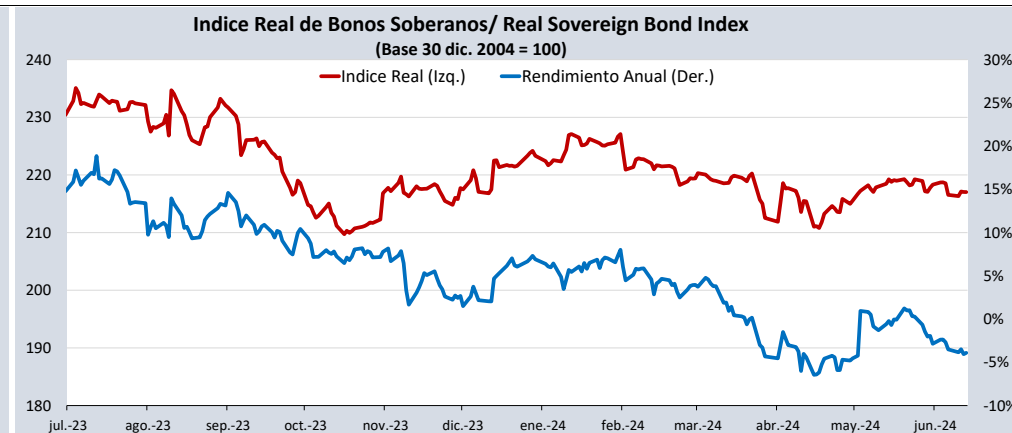
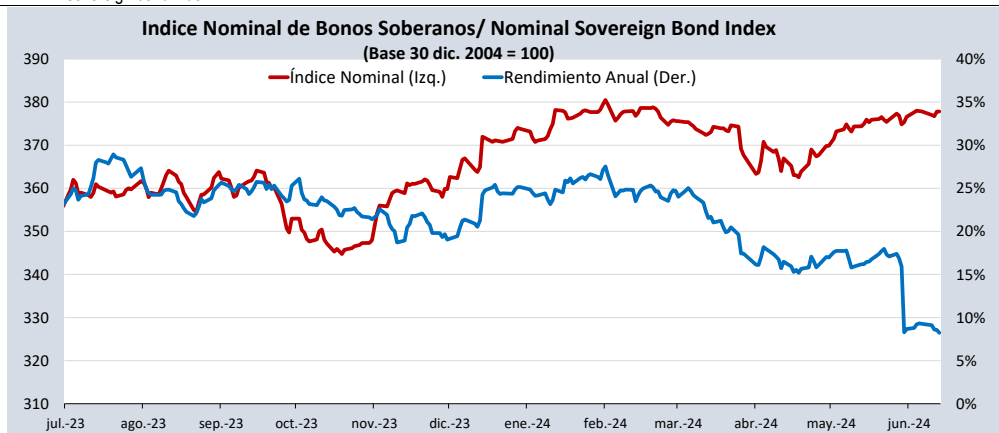
Bonos globales**** / Global bonds

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	95,2270	0,04	0,01	-0,44	5,5330	-2	3	30	1,57	1,53	1,64
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,9210	-0,02	-0,05	-0,53	4,0940	2	5	35	1,59	1,56	1,66
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,7750	0,12	0,23	-0,40	5,2310	-4	-7	14	2,99	2,91	3,24
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,5710	0,19	0,24	-0,49	5,2820	-4	-4	10	5,45	5,31	6,11
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,4380	0,11	-0,14	-0,56	4,0590	-2	3	11	5,05	4,95	5,71
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,8020	0,19	0,30	-0,47	5,3620	-4	-5	9	5,96	5,80	6,71
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,9100	0,23	0,15	-0,52	5,4530	-4	-2	9	7,75	7,55	8,59
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,8250	0,30	0,25	-0,90	5,7230	-4	-4	11	6,88	6,69	9,58
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,2270	0,13	-0,30	-0,90	4,2920	-2	5	15	8,20	8,03	8,87
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,4150	0,20	-0,20	-0,62	5,5230	-3	3	10	8,12	7,90	9,73
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,1670	0,08	-0,48	-0,95	4,4950	-1	6	12	10,82	10,59	12,61
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,3440	0,41	0,12	-0,85	5,7290	-4	-1	9	8,86	8,61	12,94
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,5120	0,27	-0,22	-0,72	5,6790	-3	3	8	12,14	11,81	16,99
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,7270	0,53	0,06	-0,63	5,7190	-4	0	5	13,93	13,54	26,82
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,4200	0,35	-0,33	-0,78	5,6300	-3	3	7	15,41	14,99	27,13
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,1740	0,48	0,06	-0,58	5,5200	-5	-1	6	18,46	17,97	37,00
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,9500	0,32	-0,39	-0,72	5,7650	-3	3	6	17,45	16,96	48,28
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,0780	0,40	-0,06	-0,73	5,6770	-4	1	7	17,92	17,42	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	0	0	8,24	-33	-104	-	5,20	8,22	12,49	13,37	13,48	12,32	9,94	13,16	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	217	0	0	-3,90	17	-40	29,86	2,48	38,42	6,41	12,72	10,10



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