



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

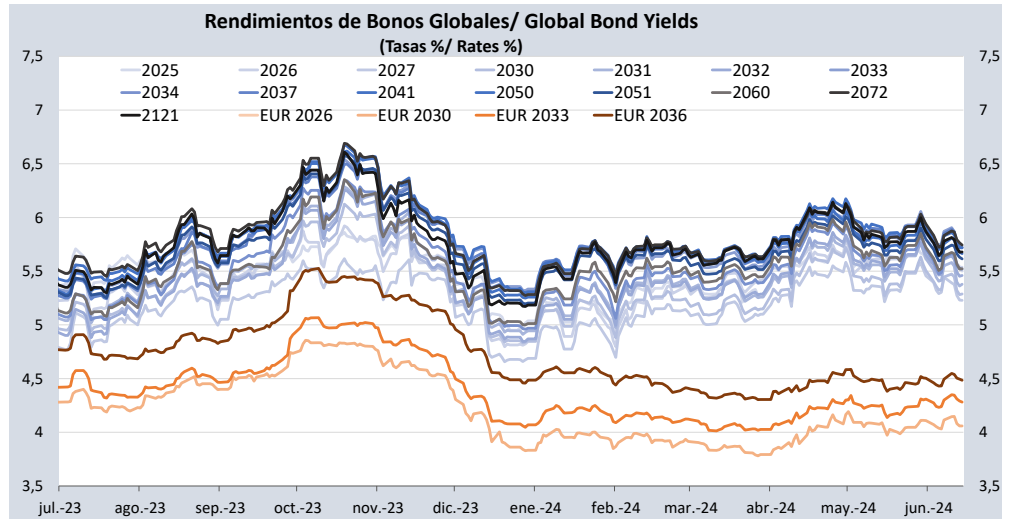
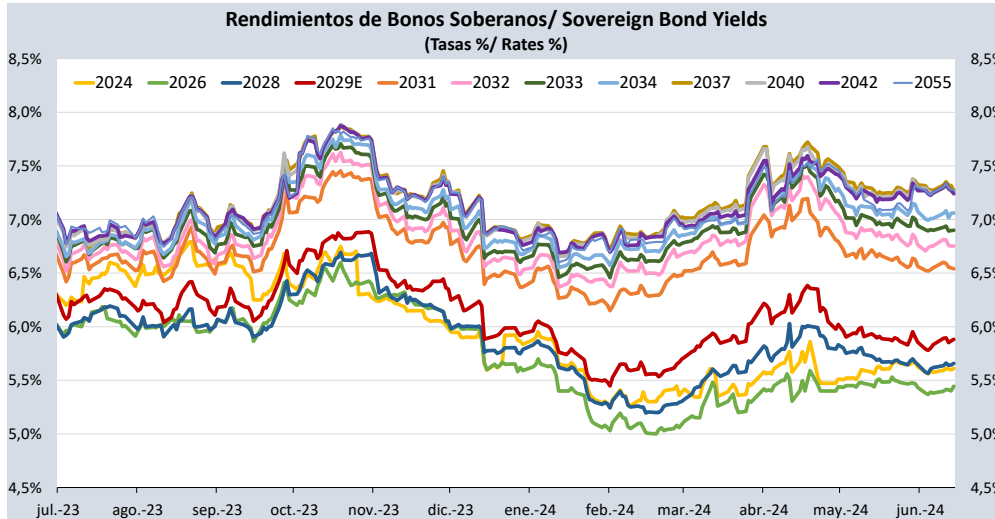
14/06/2024

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	1,93	4 238	5,700	-	-	-	100,0077	-	-	-	5,6117	-	9-May-24	12	0,16	0,16	0,16
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,77	7 042	8,200	-	-	-	105,5300	-	-	-	5,4450	-	13-Jun-24	14	2,01	1,90	2,16
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,15	11 519	6,350	101,98	103,08	102,50	102,5099	5,80	5,50	5,66	5,6579	16	14-Jun-24	30	3,71	3,51	4,16
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,01	17 934	5,940	99,73	100,33	100,17	100,2013	6,00	5,85	5,89	5,8822	23	14-Jun-24	96	4,12	3,89	4,66
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,35	18 748	6,950	101,46	102,41	102,30	102,3624	6,70	6,53	6,55	6,5395	56	14-Jun-24	298	5,73	5,38	7,16
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,08	20 117	6,150	96,20	96,53	96,23	96,3305	6,78	6,72	6,77	6,7521	26	14-Jun-24	172	6,46	6,05	8,16
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,47	17 180	7,300	102,64	102,77	102,70	102,7731	6,92	6,90	6,91	6,8998	40	14-Jun-24	195	6,81	6,37	9,16
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,82	16 211	5,400	88,05	88,42	88,26	88,2158	7,09	7,03	7,06	7,0599	16	14-Jun-24	78	7,74	7,23	10,16
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,33	19 580	6,900	96,82	97,23	96,99	97,0609	7,30	7,25	7,28	7,2704	17	14-Jun-24	192	8,70	8,11	13,16
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,81	11 068	5,350	-	-	-	82,1861	-	-	-	7,2575	-	14-Jun-24	0	10,35	9,65	16,16
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,31	5 033	6,850	-	-	-	96,3291	-	-	-	7,2399	-	10-Jun-24	2	10,27	9,58	17,66
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,27	3 387	6,714	92,54	96,12	93,56	93,3930	7,35	7,04	7,26	7,2744	3	14-Jun-24	20	12,72	11,86	30,66
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,16	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2157	-	-	-	3,0695	-	31-Oct-22	2	0,34	0,33	0,33
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,98	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2157	-	-	-	3,4583	-	18-Ago-23	20	5,28	5,11	5,66
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,74	911	7,39% + VAC	-	-	-	125,1637	-	-	-	4,3820	-	10-Jun-22	10	7,86	7,53	10,63
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,06	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,2308	-	-	-	4,5446	-	10-Ago-23	50	12,17	11,64	15,66
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,29	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,9751	-	-	-	4,5370	-	21-Jul-22	2	14,70	14,07	22,16
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,10	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,9132	-	-	-	4,5564	-	12-Ago-21	10	17,78	17,00	29,66

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).



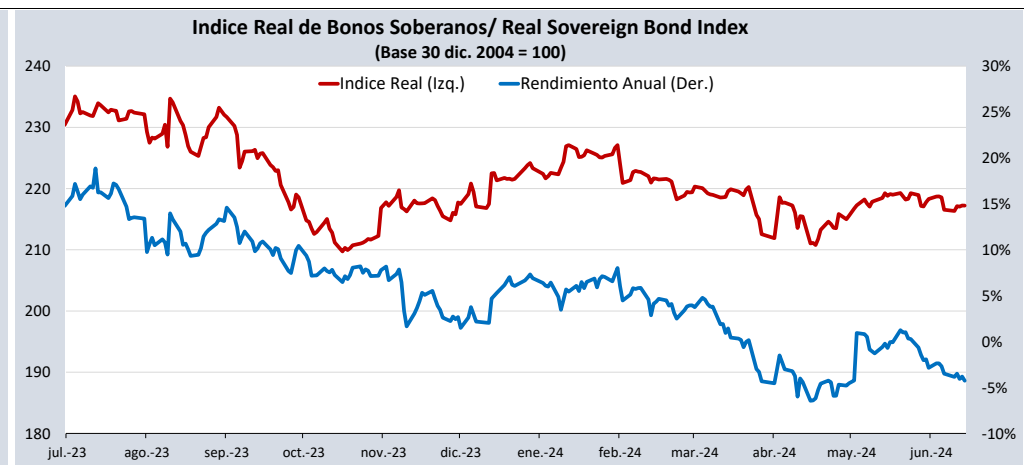
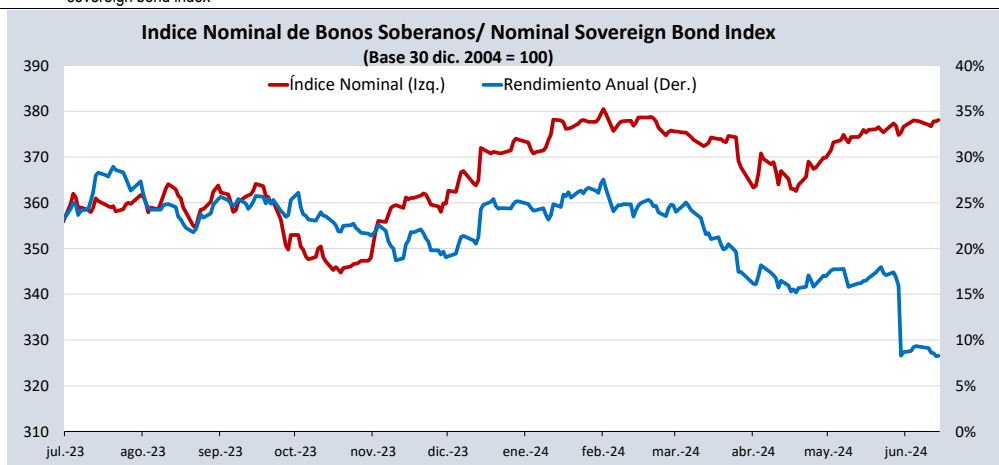
Bonos globales**** / Global bonds

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	101,9310	0,03	0,14	-0,44	5,5010	-4	-16	42	1,05	1,02	1,12
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,2450	0,02	0,21	-0,45	5,5370	0	-10	31	1,57	1,53	1,63
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	97,9830	0,06	0,11	-0,64	4,0550	-4	-6	43	1,59	1,56	1,65
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,7910	0,02	0,63	-0,43	5,2280	0	-22	15	2,99	2,91	3,24
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,5590	-0,01	0,78	-0,51	5,2880	1	-16	11	5,45	5,31	6,10
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,4410	0,00	0,28	-0,79	4,0590	0	-5	16	5,05	4,95	5,71
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,7330	-0,07	0,90	-0,50	5,3790	2	-17	10	5,95	5,80	6,71
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	75,8910	-0,02	0,91	-0,52	5,4600	1	-15	9	7,75	7,54	8,59
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,8180	-0,01	1,18	-0,89	5,7220	0	-15	11	6,88	6,68	9,58
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,2990	0,07	0,16	-0,89	4,2810	-1	-2	14	8,20	8,03	8,87
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,4520	0,04	0,67	-0,61	5,5190	0	-10	9	8,12	7,90	9,73
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,2540	0,09	0,10	-0,94	4,4850	-1	-1	12	10,82	10,59	12,61
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,4010	0,06	1,20	-0,86	5,7230	-1	-13	9	8,86	8,61	12,93
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,6620	0,15	0,84	-0,75	5,6630	-2	-9	8	12,15	11,81	16,98
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,7540	0,03	1,48	-0,65	5,7170	0	-11	5	13,93	13,54	26,81
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,6000	0,18	0,97	-0,83	5,6140	-2	-9	8	15,42	15,00	27,13
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,1480	-0,03	1,20	-0,66	5,5230	0	-12	6	18,46	17,96	37,00
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1970	0,25	0,99	-0,74	5,7440	-2	-9	7	17,50	17,01	48,28
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,0600	-0,02	1,01	-0,68	5,6790	0	-10	7	17,91	17,41	98,53

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	8,27	3	-101	-	5,19	8,21	12,48	13,37	13,48	12,31	9,94	13,20	6,33	3,38	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	-4,26	-45	-77	29,84	2,48	38,41	6,41	12,76	10,11



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