



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

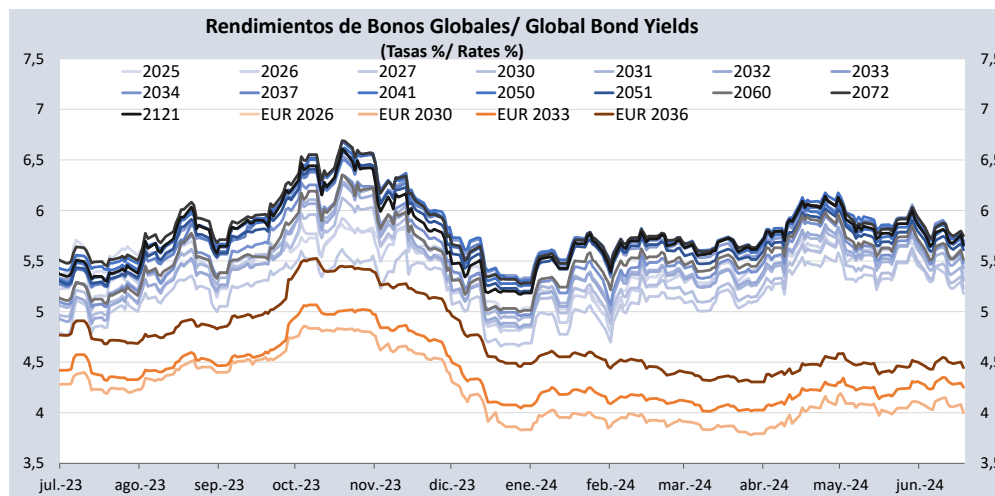
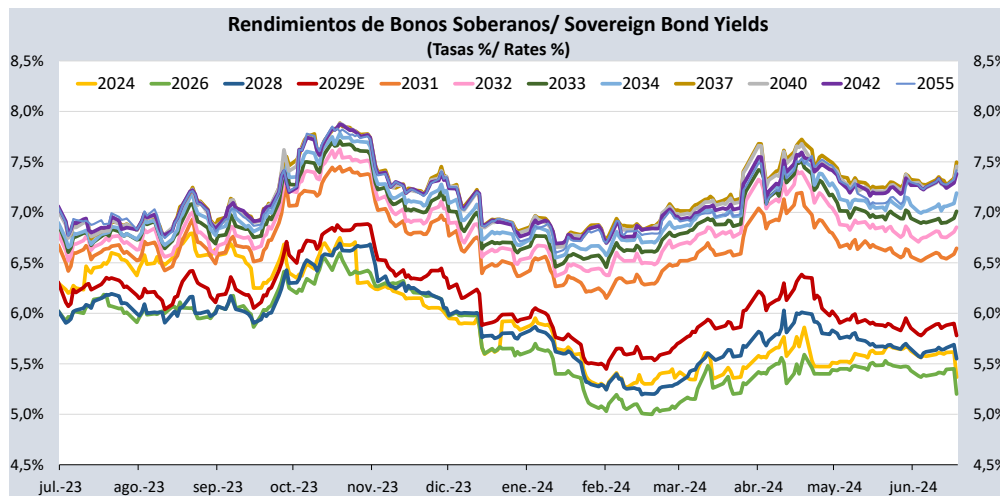
18/06/2024

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 / Años / Years	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	1,99	4 238	5,700	-	-	-	100,0431	-	-	-	5,3667	-	9-May-24	12	0,15	0,14	0,15
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,86	7 042	8,200	105,88	106,19	105,99	106,0080	5,25	5,10	5,20	5,2000	1	18-Jun-24	1	2,00	1,90	2,15
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,22	11 519	6,350	102,76	102,97	102,93	102,8986	5,59	5,53	5,54	5,5505	5	18-Jun-24	20	3,70	3,50	4,15
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,07	17 934	5,940	100,29	100,64	100,61	100,6080	5,86	5,77	5,78	5,7800	3	18-Jun-24	4	4,11	3,89	4,65
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,42	18 748	6,950	101,79	101,85	101,85	101,7709	6,64	6,63	6,63	6,6445	52	18-Jun-24	486	5,72	5,36	7,15
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,15	20 267	6,150	95,48	95,76	95,76	95,7372	6,90	6,85	6,85	6,8529	14	18-Jun-24	196	6,44	6,03	8,15
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,55	17 180	7,300	101,64	102,10	102,10	102,0340	7,07	7,00	7,00	7,0103	12	18-Jun-24	89	6,79	6,35	9,15
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,88	16 511	5,400	87,01	87,62	87,52	87,3736	7,25	7,16	7,17	7,1916	47	18-Jun-24	290	7,71	7,19	10,15
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,41	19 580	6,900	94,46	95,63	95,16	95,2572	7,60	7,45	7,51	7,4973	61	18-Jun-24	211	8,64	8,04	13,15
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,87	11 068	5,350	80,19	81,30	80,66	80,6046	7,51	7,37	7,45	7,4562	22	18-Jun-24	52	10,27	9,56	16,15
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,39	5 033	6,850	94,84	95,77	94,84	94,9990	7,40	7,30	7,40	7,3823	2	18-Jun-24	3	10,20	9,50	17,65
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,34	3 462	6,714	-	-	-	91,8015	-	-	-	7,4168	-	14-Jun-24	20	12,58	11,71	30,65
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,23	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,2526	-	-	-	2,8304	-	31-Oct-22	2	0,33	0,32	0,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,01	77	2,89%+VAC	-	-	-	101,2526	-	-	-	3,4395	-	18-Ago-23	20	5,27	5,10	5,65
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,82	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,7780	-	-	-	4,5250	-	10-Jun-22	10	7,83	7,49	10,62
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,10	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,2989	-	-	-	4,7429	-	10-Ago-23	50	12,11	11,56	15,65
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,34	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,2189	-	-	-	4,6759	-	21-Jul-22	2	14,61	13,95	22,15
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,14	383	3,26%+VAC	-	-	-	77,0593	-	-	-	4,6953	-	12-Ago-21	10	17,60	16,81	29,65

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	102,0960	0,26	0,31	-0,46	5,3320	-25	-32	43	1,04	1,01	1,11
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,4880	0,35	0,42	-0,46	5,3860	-23	-24	31	1,56	1,52	1,62
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,2390	0,30	0,42	-0,49	3,8900	-19	-26	32	1,58	1,55	1,64
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,9450	0,35	0,58	-0,38	5,1770	-12	-20	13	2,98	2,90	3,23
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,8420	0,57	1,05	-0,50	5,2310	-12	-22	11	5,44	5,30	6,09
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,7410	0,41	0,74	-0,57	3,9990	-8	-15	12	5,04	4,94	5,70
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,1100	0,67	1,23	-0,51	5,3070	-13	-24	10	5,94	5,79	6,69
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,0680	0,62	1,06	-0,45	5,4320	-11	-18	8	7,74	7,53	8,58
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,2690	0,88	1,61	-0,97	5,6650	-11	-20	12	6,87	6,68	9,56
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,4990	0,27	0,63	-0,86	4,2510	-4	-9	14	8,19	8,02	8,86
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,7100	0,63	1,13	-0,63	5,4810	-10	-17	10	8,11	7,89	9,72
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,5800	0,46	0,78	-0,95	4,4450	-6	-9	12	10,82	10,58	12,60
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8710	0,99	1,83	-0,92	5,6720	-11	-20	10	8,86	8,61	12,92
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,8040	0,66	1,28	-0,74	5,6470	-8	-14	8	12,14	11,81	16,97
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,9910	0,97	1,86	-0,61	5,6990	-7	-14	4	13,93	13,54	26,80
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,6340	0,69	1,33	-0,82	5,6110	-6	-12	8	15,41	14,99	27,11
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,2500	0,96	1,51	-0,72	5,5130	-9	-15	7	18,46	17,97	36,99
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1320	0,53	1,29	-0,72	5,7500	-5	-12	6	17,47	16,98	48,27
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,2590	0,99	1,35	-0,74	5,6590	-10	-14	7	17,96	17,47	98,52

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