



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

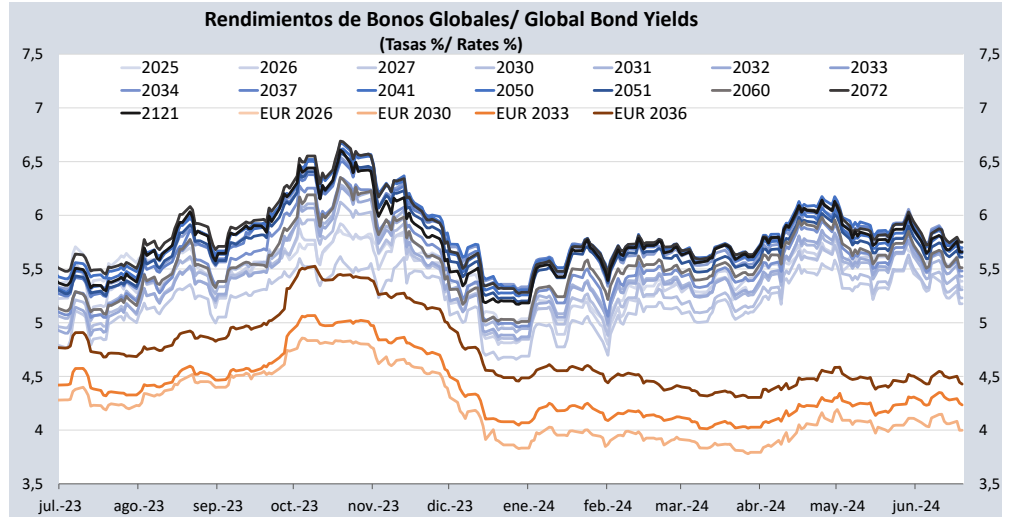
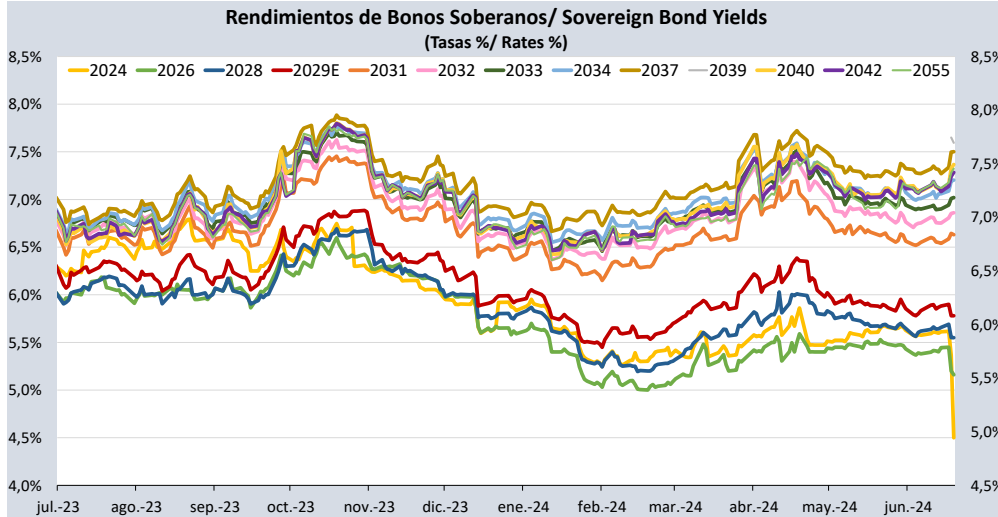
19/06/2024

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	2,00	4 238	5,700	100,15	100,22	100,15	100,1688	4,50	4,00	4,50	4,5000	1	19-Jun-24	2	0,15	0,14	0,15
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,88	7 042	8,200	105,76	106,17	106,05	106,0834	5,30	5,10	5,16	5,1600	1	19-Jun-24	1	1,99	1,90	2,15
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,23	11 519	6,350	102,82	102,96	102,89	102,8988	5,57	5,53	5,55	5,5500	2	19-Jun-24	4	3,69	3,50	4,15
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,09	17 934	5,940	100,13	100,81	100,61	100,6077	5,90	5,73	5,78	5,7800	1	19-Jun-24	2	4,11	3,89	4,65
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,44	18 748	6,950	101,74	101,88	101,85	101,8515	6,65	6,63	6,63	6,6300	7	19-Jun-24	14	5,72	5,36	7,15
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,16	20 267	6,150	95,58	95,79	95,70	95,6971	6,88	6,85	6,86	6,8599	18	19-Jun-24	152	6,44	6,02	8,15
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,57	17 180	7,300	101,84	102,13	102,03	101,9680	7,04	7,00	7,01	7,0202	11	19-Jun-24	260	6,79	6,34	9,15
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,90	16 511	5,400	87,21	87,62	87,40	87,2971	7,22	7,16	7,19	7,2039	21	19-Jun-24	138	7,71	7,19	10,15
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,43	19 580	6,900	95,04	95,36	95,16	95,2249	7,53	7,49	7,51	7,5015	24	19-Jun-24	201	8,64	8,04	13,15
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	7 000	7,600	100,09	100,40	100,23	100,2734	7,62	7,58	7,60	7,5945	27	19-Jun-24	277	9,38	8,72	15,15
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,88	11 068	5,350	80,19	80,43	80,27	80,3147	7,51	7,48	7,50	7,4933	3	19-Jun-24	152	10,26	9,54	16,15
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,41	5 033	6,850	-	-	-	94,6571	-	-	-	7,4194	-	18-Jun-24	3	10,19	9,48	17,65
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,36	3 462	6,714	-	-	-	91,3943	-	-	-	7,4539	-	14-Jun-24	20	12,54	11,67	30,65
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,25	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,4929	-	-	-	2,0529	-	31-Oct-22	2	0,32	0,32	0,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,02	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,1095	-	-	-	3,4339	-	18-Ago-23	20	5,27	5,09	5,65
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,84	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,6719	-	-	-	4,5357	-	10-Jun-22	10	7,82	7,48	10,62
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,10	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,5460	-	-	-	4,8217	-	10-Ago-23	50	12,08	11,53	15,65
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,35	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,7702	-	-	-	4,7120	-	21-Jul-22	2	14,58	13,92	22,15
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,15	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,5877	-	-	-	4,7314	-	12-Ago-21	10	17,56	16,77	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).



**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	0,00	0,22	-0,46	5,3320	0	-24	43	1,04	1,01	1,10
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,4880	0,00	0,30	-0,46	5,3860	0	-17	31	1,56	1,52	1,62
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,2390	0,00	0,30	-0,49	3,8920	0	-18	32	1,57	1,54	1,64
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,9450	0,00	0,29	-0,38	5,1770	0	-10	13	2,97	2,90	3,23
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,8420	0,00	0,46	-0,50	5,2310	0	-9	11	5,44	5,30	6,09
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,7410	0,00	0,41	-0,57	3,9990	0	-8	12	5,04	4,94	5,70
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,1100	0,00	0,50	-0,51	5,3070	0	-9	10	5,94	5,79	6,69
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,0680	0,00	0,39	-0,45	5,4320	0	-6	8	7,74	7,53	8,58
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,2690	0,00	0,74	-0,97	5,6650	0	-9	12	6,87	6,68	9,56
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,5990	0,10	0,50	-0,86	4,2350	-2	-7	14	8,19	8,02	8,85
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,7100	0,00	0,50	-0,63	5,4810	0	-7	10	8,11	7,89	9,71
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,7090	0,13	0,62	-0,93	4,4290	-2	-7	12	10,82	10,58	12,59
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,8710	0,00	0,94	-0,92	5,6720	0	-10	10	8,85	8,61	12,92
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,8040	0,00	0,56	-0,74	5,6470	0	-6	8	12,14	11,80	16,97
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,9910	0,00	0,80	-0,61	5,6990	0	-6	4	13,93	13,54	26,80
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,6340	0,00	0,56	-0,82	5,6110	0	-5	8	15,41	14,99	27,11
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,2500	0,00	0,55	-0,72	5,5130	0	-5	7	18,46	17,96	36,98
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1320	0,00	0,50	-0,72	5,7500	0	-4	6	17,47	16,98	48,27
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,2590	0,00	0,58	-0,74	5,6590	0	-6	7	17,96	17,46	98,52

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

\* Para mayor información respecto a la valorización de los bonos y letras puede consultar en: [http://www.mef.gob.pe/contenidos/tesoro\\_pub/gestion\\_act\\_pas/Manual\\_valorizacion\\_instrumentos\\_del\\_Tesoro.pdf](http://www.mef.gob.pe/contenidos/tesoro_pub/gestion_act_pas/Manual_valorizacion_instrumentos_del_Tesoro.pdf)

\*\* Precio de los bonos a fecha de liquidación T+0.

\*\*\* Última negociación 1:30 pm

\*\*\*\* Información con horario de corte 4:30 pm.