



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

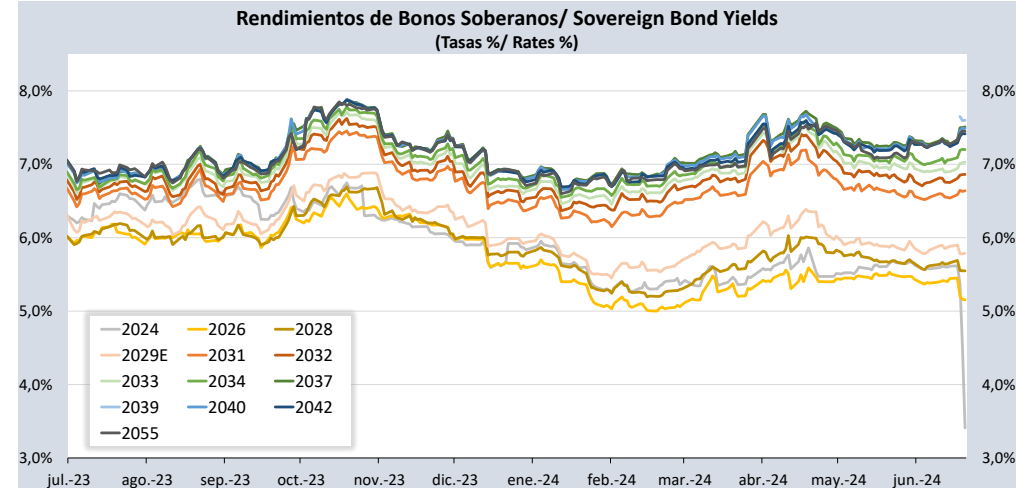
20/06/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

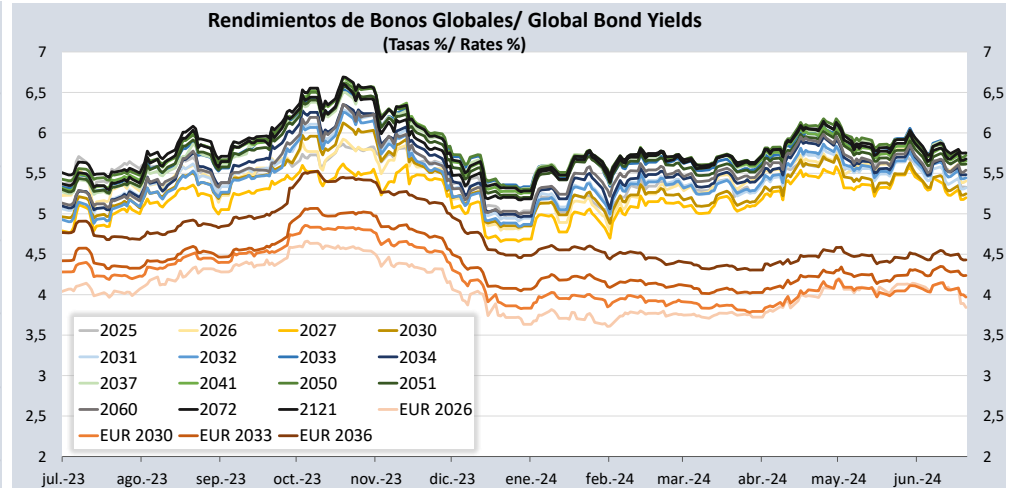
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Precio / Price					Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)		Millones S./ / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Postura / Position		Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Postura / Position		Última neg. / Last trading day		Prom. ponderado / Weighted average (%)	Día / Date			
				Compra / Bid			Venta / Ask	Compra / Bid			Venta / Ask								
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,02	4 238	5,700	-	-	100,32	100,3237	-	-	3,41	3,4085	1	20-Jun-24	150	0,15	0,14	0,15
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,91	7 042	8,200	105,75	106,21	106,11	106,0868	5,30	5,08	5,14	5,1548	7	20-Jun-24	555	1,99	1,89	2,15
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,25	11 519	6,350	102,78	103,18	102,90	102,9044	5,58	5,47	5,55	5,5480	2	20-Jun-24	105	3,69	3,50	4,15
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,11	17 934	5,940	-	-	-	100,5775	-	-	-	5,7875	-	19-Jun-24	2	4,11	3,88	4,65
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,46	18 748	6,950	101,46	102,13	101,88	101,8035	6,70	6,58	6,63	6,6385	11	20-Jun-24	90	5,71	5,36	7,15
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,18	20 267	6,150	95,47	95,82	95,82	95,6841	6,90	6,84	6,84	6,8623	15	20-Jun-24	364	6,44	6,02	8,15
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,59	17 180	7,300	101,90	102,10	102,00	101,9027	7,03	7,00	7,02	7,0300	27	20-Jun-24	608	6,78	6,34	9,15
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,91	16 511	5,400	87,21	87,53	87,46	87,3252	7,22	7,17	7,18	7,1999	38	20-Jun-24	138	7,71	7,19	10,15
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,45	19 580	6,900	95,16	95,32	95,16	95,1722	7,51	7,49	7,51	7,5083	80	20-Jun-24	462	8,64	8,03	13,15
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	7 000	7,600	100,25	100,33	100,27	100,2341	7,60	7,59	7,60	7,5990	33	20-Jun-24	611	9,38	8,72	15,15
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,90	11 068	5,350	80,35	80,86	80,35	80,3573	7,49	7,43	7,49	7,4881	21	20-Jun-24	42	10,26	9,54	16,15
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,43	5 033	6,850	-	-	-	94,7054	-	-	-	7,4142	-	18-Jun-24	3	10,19	9,48	17,65
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,38	3 462	6,714	-	-	-	91,4515	-	-	-	7,4487	-	14-Jun-24	20	12,54	11,67	30,65
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,27	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,7958	-	-	-	1,0772	-	31-Oct-22	2	0,32	0,32	0,32
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,02	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,0728	-	-	-	3,4415	-	18-Ago-23	20	5,27	5,09	5,65
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,86	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,6890	-	-	-	4,5334	-	10-Jun-22	10	7,82	7,48	10,62
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,11	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,5520	-	-	-	4,8213	-	10-Ago-23	50	12,08	11,52	15,65
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,36	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,8344	-	-	-	4,7069	-	21-Jul-22	2	14,58	13,93	22,15
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,16	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,6552	-	-	-	4,7263	-	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).



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	102,0950	0,00	0,20	-0,47	5,3280	0	-22	44	1,03	1,01	1,10
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,4680	-0,02	0,24	-0,45	5,4050	2	-13	31	1,56	1,51	1,62
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3220	0,08	0,40	-0,64	3,8420	-5	-25	43	1,57	1,54	1,64
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,8840	-0,06	0,11	-0,41	5,1990	2	-3	14	2,97	2,90	3,23
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,7720	-0,07	0,20	-0,50	5,2470	2	-4	11	5,52	5,38	6,09
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,8810	0,14	0,44	-0,82	3,9710	-3	-9	16	5,04	4,94	5,69
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,0570	-0,05	0,25	-0,52	5,3190	1	-4	10	5,94	5,78	6,69
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,0120	-0,06	0,10	-0,50	5,4430	1	-1	9	7,73	7,53	8,57
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,2190	-0,05	0,39	-0,96	5,6710	1	-5	12	6,86	6,67	9,56
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,6050	0,01	0,38	-0,85	4,2370	0	-5	14	8,19	8,02	8,85
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,7100	0,00	0,29	-0,62	5,4820	0	-4	9	8,10	7,89	9,71
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,7170	0,01	0,55	-0,89	4,4300	0	-7	11	10,81	10,58	12,59
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,7940	-0,08	0,45	-0,89	5,6800	1	-5	9	8,85	8,60	12,92
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,7760	-0,03	0,26	-0,75	5,6510	0	-3	8	12,13	11,80	16,97
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,6660	-0,33	-0,06	-0,65	5,7230	2	0	5	13,90	13,52	26,80
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,6070	-0,03	0,19	-0,81	5,6140	0	-2	8	15,40	14,98	27,11
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,9890	-0,26	-0,19	-0,69	5,5390	3	2	7	18,41	17,92	36,98
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,1040	-0,03	0,15	-0,74	5,7520	0	-1	7	17,46	16,97	48,26
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,0780	-0,18	0,00	-0,73	5,6770	2	0	7	17,90	17,40	98,52