



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

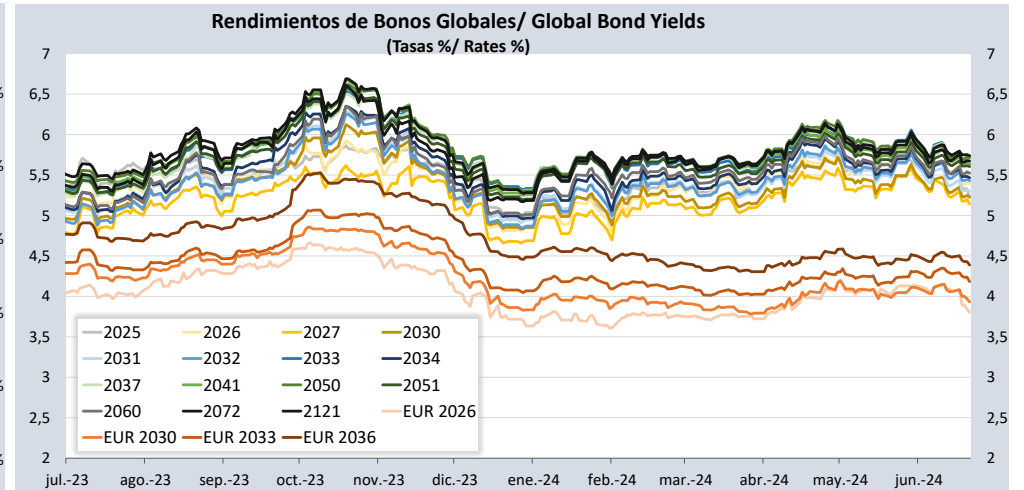
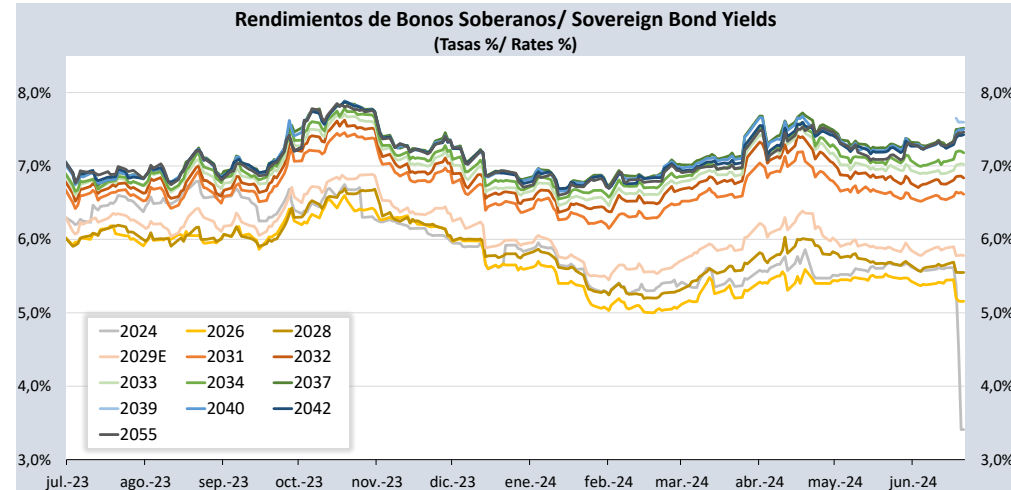
21/06/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente Millones S./ Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº 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)			
12-Ago-24	PEP01000C4W4	SB12AGO24	2,04	4 238	5,700	-	-	-	100,3173	-	-	-	3,4106	-	20-Jun-24	150	0,14	0,14	0,14
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,93	7 042	8,200	-	-	-	106,0752	-	-	-	5,1569	-	20-Jun-24	555	1,99	1,89	2,14
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,27	11 519	6,350	102,52	103,00	102,89	102,8951	5,65	5,52	5,55	5,5501	15	21-Jun-24	227	3,69	3,50	4,14
12-Ago-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,12	17 934	5,940	100,33	100,79	100,59	100,6047	5,85	5,74	5,79	5,7806	6	21-Jun-24	118	4,11	3,88	4,64
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,48	18 748	6,950	101,71	102,16	102,02	101,9344	6,66	6,58	6,60	6,6150	41	21-Jun-24	102	5,71	5,36	7,14
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,20	20 267	6,150	95,82	95,88	95,82	95,8392	6,84	6,83	6,84	6,8362	20	21-Jun-24	259	6,43	6,02	8,14
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,61	17 180	7,300	101,80	102,17	101,92	101,9547	7,05	6,99	7,03	7,0221	36	21-Jun-24	509	6,78	6,34	9,14
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,93	16 511	5,400	87,53	87,72	87,53	87,4579	7,17	7,14	7,17	7,1796	37	21-Jun-24	469	7,70	7,19	10,14
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,46	19 580	6,900	94,91	95,48	95,08	95,1251	7,54	7,47	7,52	7,5144	20	21-Jun-24	258	8,63	8,03	13,14
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	7 000	7,600	100,05	100,58	100,23	100,2568	7,62	7,56	7,60	7,5964	52	21-Jun-24	509	9,38	8,72	15,14
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,91	11 068	5,350	80,12	80,67	80,27	80,2642	7,52	7,45	7,50	7,5002	5	21-Jun-24	149	10,25	9,53	16,14
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,45	5 033	6,850	-	-	-	94,5946	-	-	-	7,4263	-	18-Jun-24	3	10,18	9,48	17,64
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,40	3 462	6,714	-	-	-	91,3195	-	-	-	7,4608	-	14-Jun-24	20	12,53	11,66	30,64
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,29	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,7795	-	-	-	1,0794	-	31-Oct-22	2	0,32	0,31	0,31
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,03	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,1395	-	-	-	3,4284	-	18-Ago-23	20	5,26	5,09	5,64
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,88	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,8330	-	-	-	4,5177	-	10-Jun-22	10	7,82	7,48	10,61
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,12	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,5094	-	-	-	4,8260	-	10-Ago-23	50	12,07	11,52	15,64
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,37	424	3,83% + VAC	-	-	-	87,6876	-	-	-	4,7188	-	21-Jul-22	2	14,57	13,91	22,14
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,17	383	3,26%+VAC	-	-	-	76,5012	-	-	-	4,7382	-	12-Ago-21	10	17,55	16,75	29,64

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	102,1920	0,10	0,26	-0,45	5,2210	-11	-28	42	1,03	1,01	1,10
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,5110	0,04	0,27	-0,48	5,3920	-1	-15	33	1,55	1,51	1,61
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3850	0,06	0,40	-0,64	3,8020	-4	-25	43	1,57	1,54	1,63
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	97,0550	0,17	0,26	-0,43	5,1420	-6	-9	15	2,97	2,89	3,22
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,8550	0,08	0,30	-0,49	5,2320	-1	-6	11	5,52	5,38	6,08
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	99,0750	0,19	0,63	-0,79	3,9320	-4	-13	16	5,03	4,94	5,69
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,1540	0,10	0,42	-0,51	5,3030	-2	-8	10	5,94	5,78	6,69
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,1050	0,09	0,21	-0,49	5,4300	-1	-3	9	7,73	7,53	8,57
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,4630	0,24	0,64	-0,97	5,6390	-3	-8	12	6,86	6,68	9,56
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,9550	0,35	0,66	-0,96	4,1820	-5	-10	15	8,18	8,02	8,85
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,8280	0,12	0,38	-0,61	5,4660	-2	-5	9	8,10	7,89	9,71
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,0600	0,34	0,81	-0,86	4,3870	-4	-10	11	10,81	10,58	12,59
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,0040	0,21	0,60	-0,90	5,6580	-2	-6	9	8,85	8,61	12,91
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,9340	0,16	0,27	-0,76	5,6340	-2	-3	9	12,14	11,80	16,96
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,7920	0,13	0,04	-0,68	5,7140	-1	0	5	13,91	13,52	26,79
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,7200	0,11	0,12	-0,79	5,6040	-1	-1	7	15,41	14,99	27,11
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,1440	0,16	0,00	-0,68	5,5240	-1	0	7	18,43	17,94	36,98
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,2570	0,15	0,06	-0,72	5,7390	-1	0	6	17,49	17,00	48,26
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,1040	0,03	0,04	-0,65	5,6750	0	0	6	17,90	17,41	98,51