



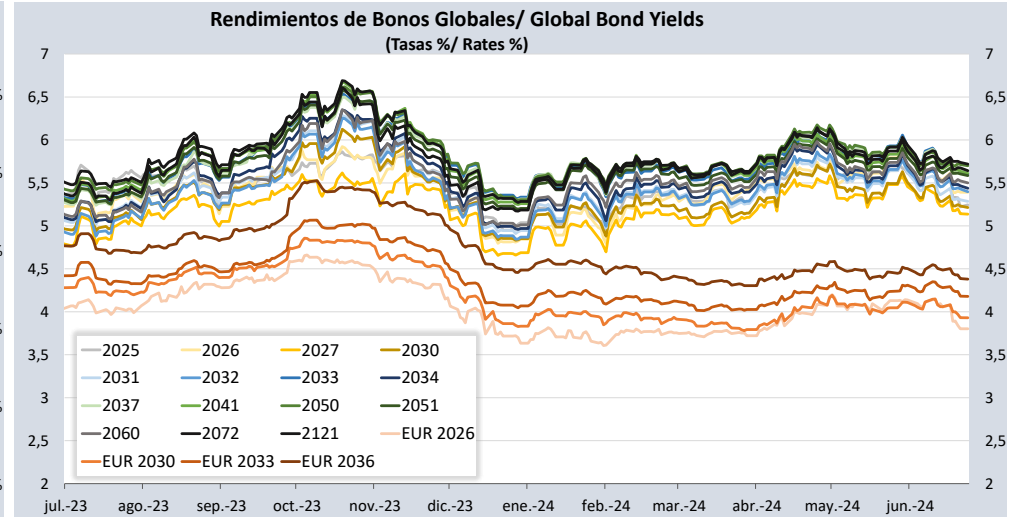
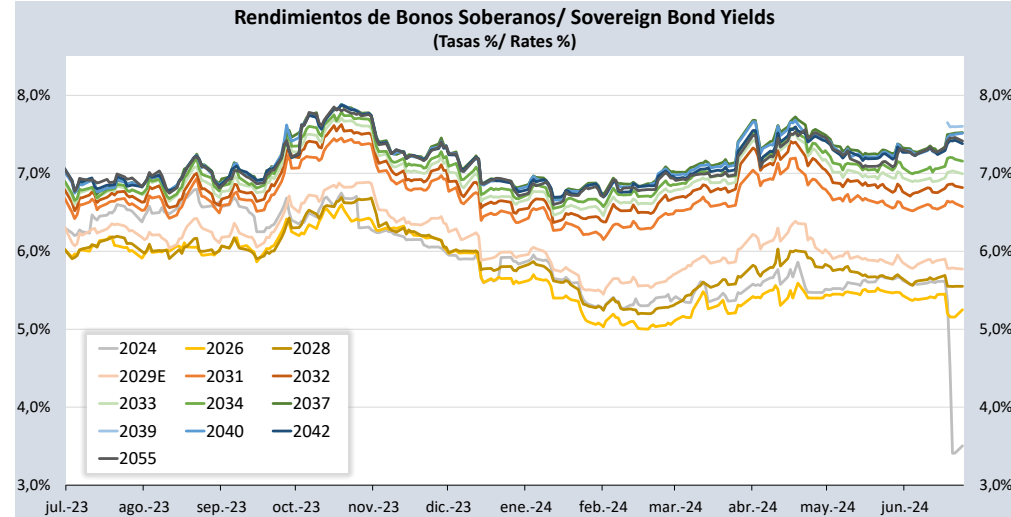
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

24/06/2024

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	2,08	4 238	5,700	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20-Jun-24	150	0,14	0,13	0,14
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,00	7 042	8,200	105,54	106,05	105,86	105,8624	5,40	5,15	5,25	5,2500	2	24-Jun-24	400	1,98	1,88	2,14
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,32	11 519	6,350	102,68	102,89	102,89	102,8904	5,61	5,55	5,55	5,5500	2	24-Jun-24	30	3,68	3,49	4,14
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,17	17 934	5,940	100,38	100,84	100,61	100,6381	5,84	5,72	5,78	5,7720	22	24-Jun-24	98	4,10	3,87	4,64
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,54	18 748	6,950	101,85	102,24	102,18	102,1701	6,63	6,56	6,57	6,5726	25	24-Jun-24	85	5,70	5,35	7,14
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,25	20 267	6,150	95,71	96,00	96,00	95,9553	6,86	6,81	6,81	6,8171	33	24-Jun-24	446	6,43	6,02	8,14
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,67	17 180	7,300	101,90	102,20	102,17	102,1453	7,03	6,99	6,99	6,9932	28	24-Jun-24	271	6,78	6,33	9,14
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,97	16 511	5,400	87,50	87,79	87,60	87,6181	7,18	7,13	7,16	7,1558	26	24-Jun-24	170	7,70	7,19	10,14
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,52	19 580	6,900	94,93	95,09	95,09	95,0653	7,54	7,52	7,52	7,5223	36	24-Jun-24	240	8,62	8,02	13,14
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	7 000	7,600	100,05	100,46	100,23	100,2079	7,62	7,57	7,60	7,6020	49	24-Jun-24	351	9,38	8,72	15,14
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,95	11 068	5,350	79,68	80,87	80,12	80,1648	7,58	7,43	7,52	7,5136	11	24-Jun-24	109	10,24	9,52	16,14
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,50	5 033	6,850	94,84	96,24	95,02	95,0231	7,40	7,25	7,38	7,3800	2	24-Jun-24	20	10,19	9,49	17,64
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,45	3 462	6,714	-	-	-	91,8285	-	-	-	7,4145	-	14-Jun-24	20	12,56	11,69	30,64
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,35	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,7022	-	-	-	1,1762	-	31-Oct-22	2	0,31	0,30	0,31
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,06	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,2207	-	-	-	3,4129	-	18-Ago-23	20	5,26	5,08	5,64
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,94	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,9344	-	-	-	4,5055	-	10-Jun-22	10	7,81	7,48	10,61
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,15	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,3696	-	-	-	4,8414	-	10-Ago-23	50	12,06	11,51	15,64
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,40	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,1753	-	-	-	4,6798	-	21-Jul-22	2	14,59	13,94	22,14
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,19	383	3,26%+VAC	-	-	-	77,0140	-	-	-	4,6992	-	12-Ago-21	10	17,58	16,79	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	102,1620	-0,03	0,33	-0,43	5,2440	2	-34	41	1,02	1,00	1,09
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,5200	0,01	0,38	-0,44	5,3910	0	-22	31	1,54	1,50	1,61
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3870	0,00	0,44	-0,64	3,8030	0	-28	43	1,56	1,53	1,63
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	97,0740	0,02	0,48	-0,40	5,1360	-1	-16	14	2,96	2,89	3,21
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,9520	0,10	0,68	-0,52	5,2130	-2	-14	11	5,51	5,37	6,08
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	99,0860	0,01	0,76	-0,74	3,9300	0	-15	15	5,03	4,93	5,68
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,2490	0,09	0,81	-0,51	5,2850	-2	-15	10	5,93	5,78	6,68
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,3000	0,19	0,85	-0,49	5,3970	-3	-14	9	7,72	7,52	8,56
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,7530	0,29	1,37	-0,98	5,6030	-4	-17	12	6,86	6,67	9,55
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,9810	0,03	0,75	-0,98	4,1790	0	-11	16	8,18	8,01	8,84
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,0120	0,18	0,93	-0,61	5,4380	-3	-14	9	8,10	7,88	9,70
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,1220	0,06	1,00	-0,83	4,3800	-1	-12	10	10,81	10,58	12,58
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,2330	0,23	1,35	-0,93	5,6330	-3	-15	10	8,85	8,60	12,91
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,1610	0,23	1,02	-0,72	5,6090	-3	-11	8	12,14	11,81	16,96
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,9770	0,19	0,96	-0,63	5,7000	-1	-7	5	13,91	13,53	26,79
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,9290	0,21	0,98	-0,79	5,5850	-2	-9	7	15,42	15,00	27,10
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,3950	0,25	1,10	-0,69	5,5000	-2	-11	7	18,47	17,97	36,97
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,4850	0,23	0,89	-0,70	5,7190	-2	-8	6	17,52	17,04	48,25
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,4420	0,34	1,17	-0,71	5,6420	-3	-12	7	18,00	17,50	98,51