



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

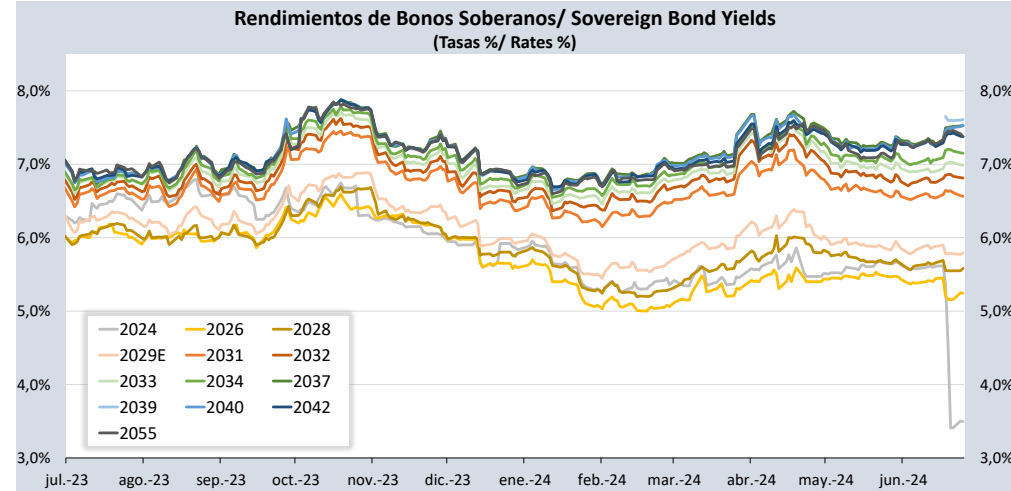
25/06/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

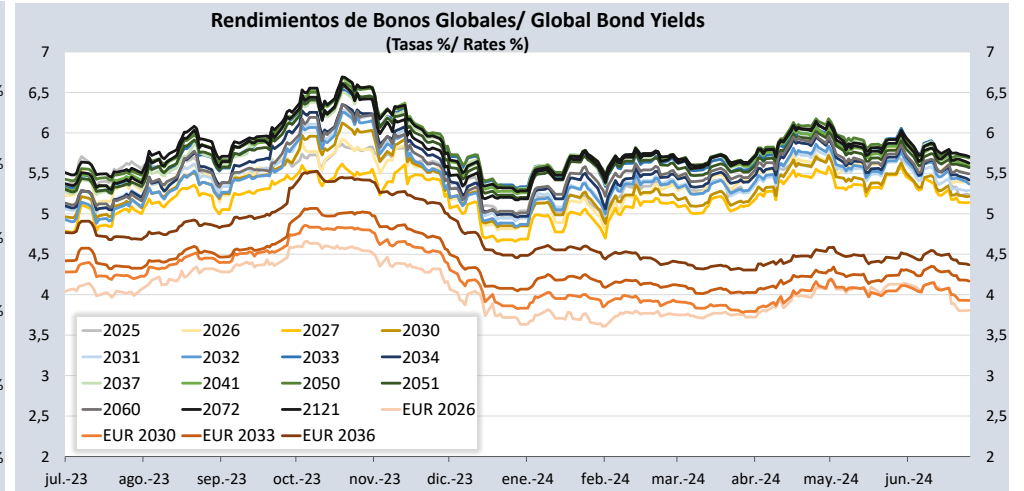
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)		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	2,10	4 238	5,700	-	-	-	100,2815	-	-	-	3,4959	-	20-Jun-24	150	0,13	0,13	0,13
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,02	7 042	8,200	-	-	-	105,8713	-	-	-	5,2422	-	24-Jun-24	400	1,98	1,88	2,13
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,34	11 519	6,350	-	-	-	102,7697	-	-	-	5,5825	-	24-Jun-24	30	3,68	3,48	4,13
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,19	17 934	5,940	-	-	-	100,5463	-	-	-	5,7950	-	24-Jun-24	98	4,09	3,87	4,63
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,56	18 748	6,950	102,13	102,41	102,16	102,2133	6,58	6,53	6,58	6,5648	16	25-Jun-24	59	5,70	5,35	7,13
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,26	20 267	6,150	95,88	96,12	95,97	95,9794	6,83	6,79	6,82	6,8132	18	25-Jun-24	336	6,42	6,01	8,13
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,69	17 180	7,300	101,97	102,23	102,10	102,1927	7,02	6,98	7,00	6,9860	23	25-Jun-24	142	6,77	6,33	9,13
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,99	16 511	5,400	87,66	87,79	87,66	87,6578	7,15	7,13	7,15	7,1500	17	25-Jun-24	141	7,70	7,18	10,13
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,54	19 580	6,900	95,01	95,20	95,09	95,0566	7,53	7,51	7,52	7,5235	10	25-Jun-24	86	8,62	8,02	13,13
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	7 000	7,600	100,14	100,27	100,14	100,1424	7,61	7,60	7,61	7,6095	38	25-Jun-24	145	9,38	8,72	15,13
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,97	11 068	5,350	79,60	80,28	80,01	79,9957	7,59	7,50	7,54	7,5355	8	25-Jun-24	20	10,23	9,51	16,13
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,52	5 033	6,850	-	-	-	95,0698	-	-	-	7,3750	-	24-Jun-24	20	10,19	9,49	17,63
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,47	3 462	6,714	-	-	-	92,2660	-	-	-	7,3750	-	14-Jun-24	20	12,60	11,73	30,63
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,36	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,6911	-	-	-	1,1625	-	31-Oct-22	2	0,31	0,30	0,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,06	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,2009	-	-	-	3,4171	-	18-Ago-23	20	5,25	5,08	5,63
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,96	911	7,39% + VAC	-	-	-	124,0321	-	-	-	4,4947	-	10-Jun-22	10	7,81	7,48	10,60
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,16	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,2949	-	-	-	4,8495	-	10-Ago-23	50	12,06	11,50	15,63
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,41	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,4614	-	-	-	4,6570	-	21-Jul-22	2	14,60	13,95	22,13
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,20	383	3,26%+VAC	-	-	-	77,5721	-	-	-	4,6570	-	12-Ago-21	10	17,63	16,84	29,63

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.



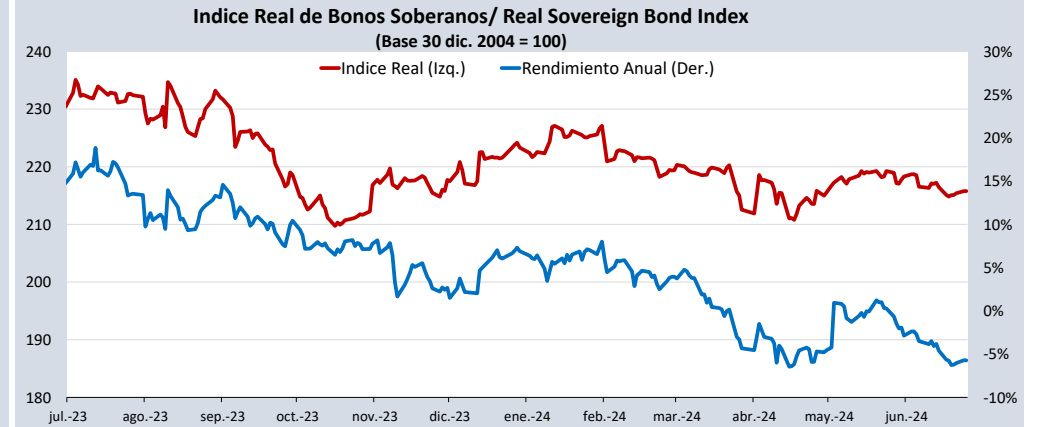
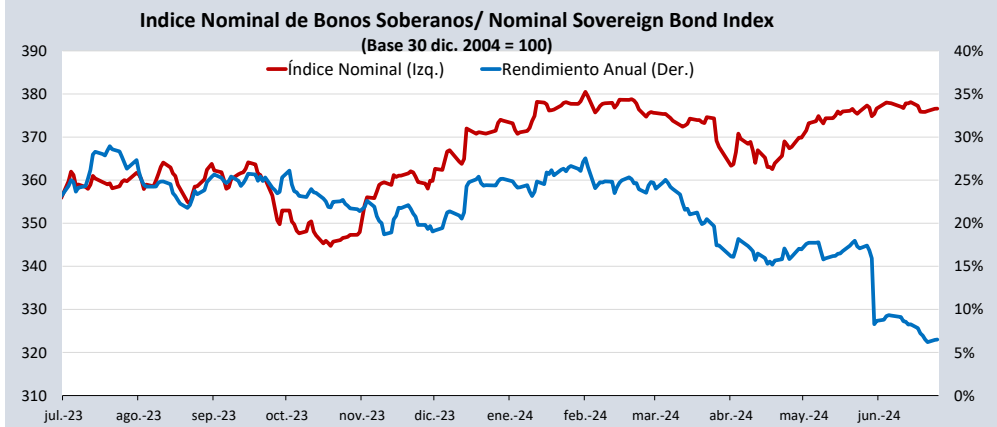
Bonos globales**** / Global bonds

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	102,1650	0,00	0,07	-0,42	5,2360	-1	-10	40	1,02	0,99	1,09
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,5200	0,00	0,03	-0,46	5,3960	0	1	32	1,54	1,50	1,60
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3830	0,00	0,14	-0,64	3,8070	0	-8	43	1,56	1,53	1,62
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	97,0680	-0,01	0,12	-0,40	5,1390	0	-4	14	2,96	2,88	3,21
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,9500	0,00	0,11	-0,53	5,2140	0	-2	11	5,51	5,37	6,07
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	99,0870	0,00	0,35	-0,79	3,9290	0	-7	16	5,02	4,93	5,68
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,2260	-0,02	0,12	-0,48	5,2900	0	-2	9	5,93	5,77	6,68
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,4730	0,17	0,41	-0,47	5,3680	-3	-6	8	7,72	7,52	8,56
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,9090	0,16	0,64	-0,97	5,5840	-2	-8	12	6,86	6,67	9,54
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	79,0480	0,07	0,55	-0,97	4,1690	-1	-8	15	8,17	8,01	8,84
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,1540	0,14	0,44	-0,61	5,4170	-2	-6	9	8,10	7,88	9,70
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,2200	0,10	0,64	-0,85	4,3690	-1	-8	11	10,81	10,57	12,58
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	108,3780	0,14	0,51	-0,84	5,6180	-1	-5	9	8,85	8,60	12,90
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,2900	0,13	0,49	-0,74	5,5950	-1	-5	8	12,14	11,81	16,95
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	99,1370	0,16	0,15	-0,65	5,6880	-1	-1	5	13,92	13,53	26,78
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	72,0850	0,16	0,45	-0,80	5,5700	-1	-4	7	15,43	15,01	27,09
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	57,4650	0,07	0,22	-0,70	5,4930	-1	-2	7	18,48	17,98	36,97
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,6180	0,13	0,49	-0,71	5,7070	-1	-4	6	17,55	17,06	48,25
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,6070	0,16	0,35	-0,74	5,6260	-2	-3	7	18,05	17,55	98,50

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index

Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual % / Annual yield %	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly		Diario / Daily	Semanal / Weekly	12-Ago-26	12-Ago-28	12-Feb-29	12-Ago-31	12-Ago-32	12-Ago-33	12-Ago-34	12-Ago-37	12-Ago-39	12-Ago-40	12-Feb-42	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	377	0	1	6,50	5	-73	5,00	7,90	12,02	12,82	12,89	11,76	9,48	12,42	4,57	5,92	3,20	2,01

Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual % / Annual yield %	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)					
		Diario / Daily	Semanal / Weekly		Diario / Daily	Semanal / Weekly	13-Oct-24	12-Feb-30	31-Ene-35	12-Feb-40	12-Feb-46	12-Feb-54
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	216	0	1	-5,72	0	5	30,23	2,50	38,38	6,24	12,64	10,02



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

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

*** Última negociación 1:30 pm

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