



### PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

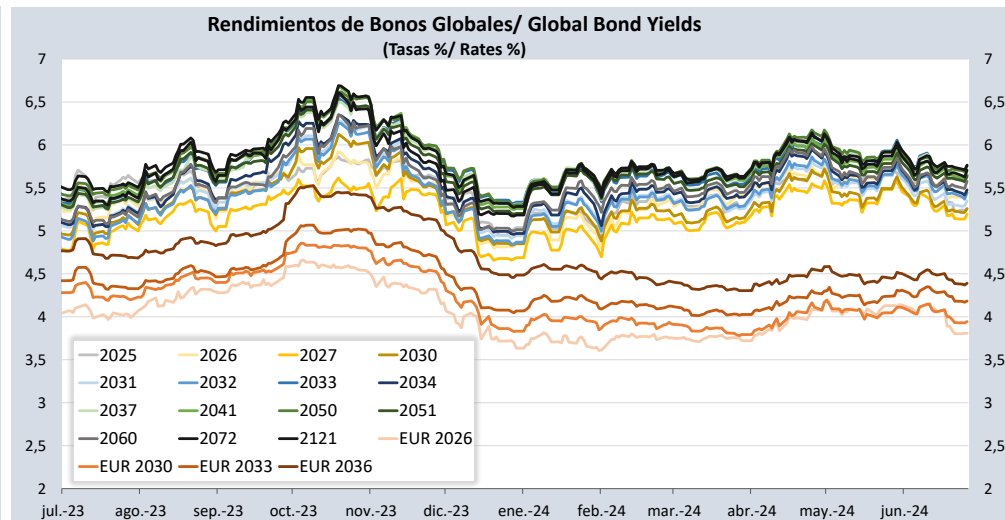
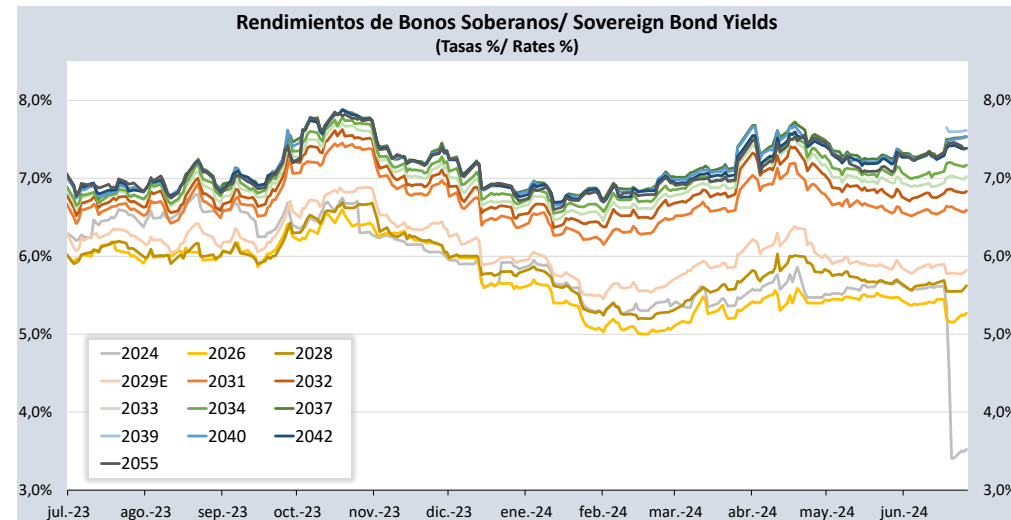
26/06/2024

#### 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	Duración Modificada / Modified	Vida media / Average life	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Compra / Bid	Venta / Ask	Última neg. / Last trading day		Prom. ponderado / Weighted average (%)	Día / Date	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
				12-Ago-24	PEP01000C4W4								SB12AGO24						
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,04	3 937	8,200	-	-	-	105,8089	-	-	-	5,2693	-	24-Jun-24	400	1,97	1,87	2,13
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,36	7 225	6,350	-	-	-	102,6219	-	-	-	5,6225	-	24-Jun-24	30	3,67	3,48	4,13
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,20	13 176	5,940	-	-	-	100,4468	-	-	-	5,8200	-	24-Jun-24	98	4,09	3,87	4,63
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,58	18 748	6,950	102,01	102,24	102,12	102,0609	6,60	6,56	6,58	6,5919	16	26-Jun-24	202	5,70	5,35	7,13
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,28	20 267	6,150	95,77	95,89	95,83	95,8713	6,85	6,83	6,84	6,8317	24	26-Jun-24	244	6,42	6,01	8,13
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,71	17 180	7,300	101,90	102,16	102,10	101,9437	7,03	6,99	7,00	7,0235	54	26-Jun-24	408	6,77	6,32	9,13
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,00	16 511	5,400	87,42	87,87	87,61	87,5283	7,19	7,12	7,16	7,1705	61	26-Jun-24	349	7,69	7,18	10,13
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,56	19 580	6,900	94,87	95,28	95,17	94,9776	7,55	7,50	7,51	7,5337	32	26-Jun-24	230	8,61	8,01	13,13
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	15 436	7,600	99,96	100,40	100,31	100,1092	7,63	7,58	7,59	7,6133	61	26-Jun-24	383	9,38	8,72	15,13
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,98	11 068	5,350	79,84	80,09	80,05	80,0139	7,56	7,53	7,53	7,5334	6	26-Jun-24	74	10,22	9,51	16,13
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,54	5 033	6,850	93,93	95,77	95,02	94,9787	7,50	7,30	7,38	7,3849	2	26-Jun-24	7	10,18	9,48	17,63
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,49	3 462	6,714	-	-	-	92,1564	-	-	-	7,3849	-	14-Jun-24	20	12,58	11,72	30,63
13-Oct-24	PEP01000C89	SB13OCT24	1,38	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,6675	-	-	-	1,1891	-	31-Oct-22	2	0,30	0,30	0,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,07	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,0760	-	-	-	3,4424	-	18-Ago-23	20	5,25	5,08	5,63
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,98	911	7,39% + VAC	-	-	-	123,8519	-	-	-	4,5132	-	10-Jun-22	10	7,81	7,47	10,60
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,17	228	3,14%+VAC	-	-	-	81,2886	-	-	-	4,8504	-	10-Ago-23	50	12,05	11,50	15,63
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,42	424	3,83% + VAC	-	-	-	88,3395	-	-	-	4,6668	-	21-Jul-22	2	14,59	13,94	22,13
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,21	383	3,26%+VAC	-	-	-	77,4432	-	-	-	4,6668	-	12-Ago-21	10	17,61	16,83	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).



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	102,1360	-0,03	0,04	-0,42	5,2590	2	-7	40	1,02	0,99	1,08
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,4440	-0,08	-0,04	-0,44	5,4540	6	7	31	1,54	1,50	1,60
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3840	0,00	0,14	-0,64	3,8080	0	-8	43	1,55	1,52	1,62
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,9180	-0,15	-0,03	-0,33	5,1930	5	2	12	2,95	2,88	3,21
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,7550	-0,20	-0,09	-0,47	5,2570	4	3	10	5,50	5,36	6,07
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	99,0080	-0,08	0,27	-0,82	3,9450	2	-5	16	5,02	4,92	5,68
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	85,9360	-0,29	-0,17	-0,47	5,3490	6	4	9	5,92	5,77	6,67
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,0370	-0,44	-0,03	-0,48	5,4450	8	1	8	7,72	7,51	8,56
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,3710	-0,54	0,10	-0,93	5,6490	7	-2	11	6,85	6,66	9,54
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,9620	-0,09	0,36	-0,96	4,1830	1	-5	15	8,17	8,00	8,83
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,7710	-0,38	0,06	-0,58	5,4760	6	0	9	8,09	7,87	9,69
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,0540	-0,17	0,34	-0,86	4,3900	2	-4	11	10,80	10,57	12,58
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,7520	-0,63	-0,12	-0,83	5,6840	7	1	9	8,83	8,59	12,90
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,7970	-0,49	-0,01	-0,71	5,6500	6	0	8	12,12	11,78	16,95
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,2070	-0,93	-0,78	-0,69	5,7570	7	6	5	13,86	13,47	26,78
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,3780	-0,71	-0,26	-0,78	5,6350	6	2	7	15,37	14,95	27,09
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,6100	-0,86	-0,64	-0,70	5,5770	8	6	7	18,33	17,83	36,96
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	64,9580	-0,66	-0,17	-0,71	5,7650	6	1	6	17,42	16,93	48,25
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	56,7890	-0,82	-0,47	-0,65	5,7060	8	5	6	17,79	17,30	98,50

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

\* Para mayor información respecto a la valoración 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.