



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

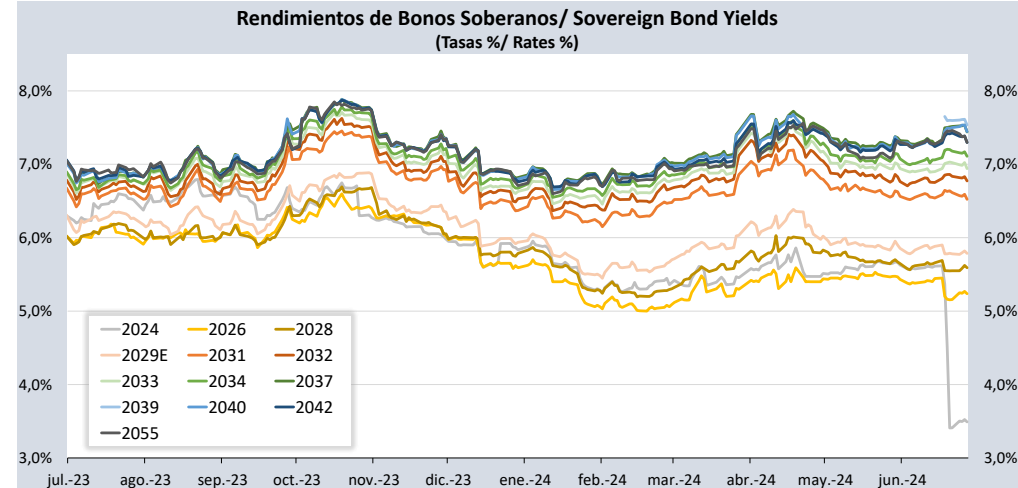
27/06/2024

Bonos soberanos / Sovereign bonds

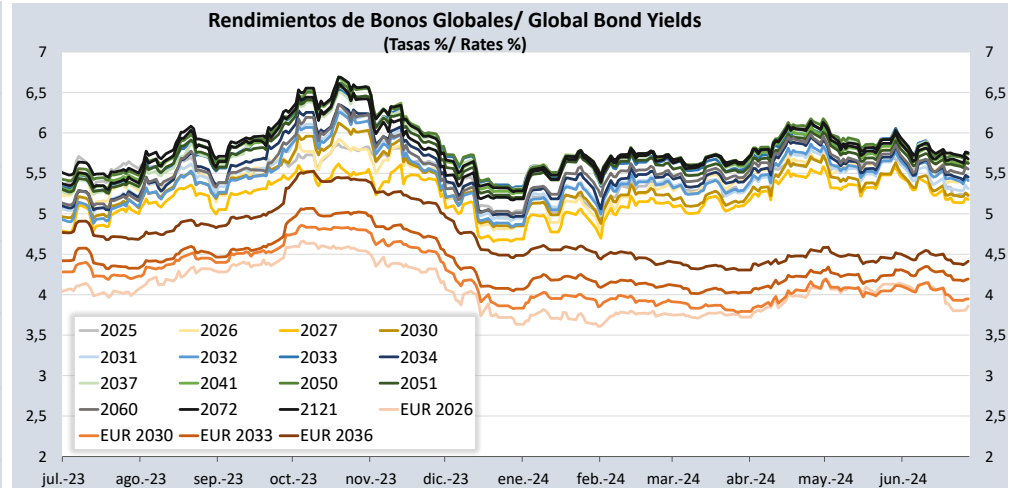
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada /	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones S./ / Millions PEN	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	2,13	1 048	5,700	-	-	-	100,2704	-	-	-	3,4905	-	20-Jun-24	150	0,13	0,12	0,13
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,06	3 937	8,200	-	-	-	105,8682	-	-	-	5,2368	-	24-Jun-24	400	1,97	1,87	2,13
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,37	7 225	6,350	102,55	102,88	102,77	102,7391	5,64	5,55	5,58	5,5900	2	27-Jun-24	4	3,67	3,48	4,13
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,22	13 176	5,940	100,45	100,64	100,60	100,5820	5,82	5,77	5,78	5,7859	9	27-Jun-24	15	4,09	3,86	4,63
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,60	18 748	6,950	102,35	103,14	102,63	102,4472	6,54	6,40	6,49	6,5229	66	27-Jun-24	395	5,70	5,35	7,13
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,30	20 267	6,150	95,77	96,66	96,36	96,2194	6,85	6,70	6,75	6,7730	48	27-Jun-24	592	6,42	6,01	8,13
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,73	17 180	7,300	102,35	103,10	102,70	102,4939	6,96	6,85	6,91	6,9406	35	27-Jun-24	263	6,77	6,33	9,13
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,02	16 511	5,400	87,67	88,48	88,06	87,9295	7,15	7,03	7,09	7,1086	31	27-Jun-24	204	7,70	7,19	10,13
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,58	19 580	6,900	95,76	96,03	95,80	95,7119	7,44	7,40	7,43	7,4403	36	27-Jun-24	145	8,63	8,03	13,13
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,00	15 436	7,600	100,93	101,19	101,10	100,7966	7,52	7,49	7,50	7,5349	153	27-Jun-24	1249	9,40	8,74	15,13
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,00	11 068	5,350	80,33	81,11	80,92	80,7091	7,50	7,40	7,42	7,4450	9	27-Jun-24	18	10,25	9,54	16,13
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,56	5 033	6,850	-	-	-	95,8017	-	-	-	7,2965	-	26-Jun-24	7	10,21	9,52	17,63
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,51	3 462	6,714	-	-	-	93,1459	-	-	-	7,2965	-	14-Jun-24	20	12,67	11,80	30,63
13-Oct-24	PEP01000CT89	SB13OCT24	1,40	884	6,84% + VAC	-	-	-	101,6619	-	-	-	1,1574	-	31-Oct-22	2	0,30	0,30	0,30
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,08	77	2,89%+VAC	-	-	-	97,3107	-	-	-	3,3956	-	18-Ago-23	20	5,25	5,08	5,63
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,00	911	7,39% + VAC	-	-	-	124,4667	-	-	-	4,4480	-	10-Jun-22	10	7,81	7,48	10,60
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,17	228	3,14%+VAC	-	-	-	82,0651	-	-	-	4,7692	-	10-Ago-23	50	12,07	11,52	15,63
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,43	424	3,83% + VAC	-	-	-	89,4278	-	-	-	4,5806	-	21-Jul-22	2	14,64	14,00	22,13
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,22	383	3,26%+VAC	-	-	-	78,5973	-	-	-	4,5806	-	12-Ago-21	10	17,71	16,94	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	102,1730	0,04	0,08	-0,43	5,2190	-4	-11	41	1,01	0,99	1,08
23-ene-26	US715638DE95	614	2,392	95,4880	0,04	0,02	-0,44	5,4290	-2	2	30	1,54	1,50	1,60
30-ene-26	XS1315181708	€1 097	2,750	98,3140	-0,07	-0,01	-0,49	3,8610	5	2	33	1,55	1,52	1,62
25-ago-27	US715638BU55	752	4,125	96,9680	0,05	0,08	-0,42	5,1760	-2	-2	15	2,95	2,88	3,21
20-jun-30	US715638DA73	694	2,844	87,8800	0,13	0,11	-0,47	5,2310	-3	-2	10	5,50	5,36	6,07
30-mar-30	XS1373156618	€998	3,750	98,9970	-0,01	0,12	-0,62	3,9480	0	-2	13	5,02	4,92	5,68
23-ene-31	US715638DF60	3 478	2,783	86,1410	0,20	0,08	-0,49	5,3090	-4	-1	10	5,92	5,77	6,67
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	76,2470	0,21	0,23	-0,50	5,4100	-4	-3	9	7,72	7,51	8,55
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	122,5550	0,18	0,34	-1,03	5,6260	-2	-4	13	6,85	6,66	9,54
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	78,9050	-0,06	0,30	-0,97	4,1950	1	-4	16	8,17	8,00	8,83
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,9130	0,14	0,20	-0,58	5,4550	-2	-3	9	8,09	7,87	9,69
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	76,8780	-0,18	0,16	-0,88	4,4130	2	-2	11	10,79	10,56	12,57
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,9970	0,25	0,20	-0,92	5,6580	-3	-2	10	8,83	8,59	12,90
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,9490	0,15	0,17	-0,73	5,6340	-2	-2	8	12,12	11,79	16,95
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	98,4840	0,28	-0,18	-0,66	5,7370	-2	1	5	13,87	13,49	26,78
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	71,5230	0,14	-0,08	-0,78	5,6220	-1	1	7	15,38	14,96	27,09
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	56,8660	0,26	-0,12	-0,72	5,5520	-3	1	7	18,37	17,87	36,96
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	65,0900	0,13	-0,01	-0,69	5,7540	-1	0	6	17,44	16,95	48,24
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	57,0820	0,29	0,00	-0,65	5,6770	-3	0	6	17,88	17,39	98,50

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.