



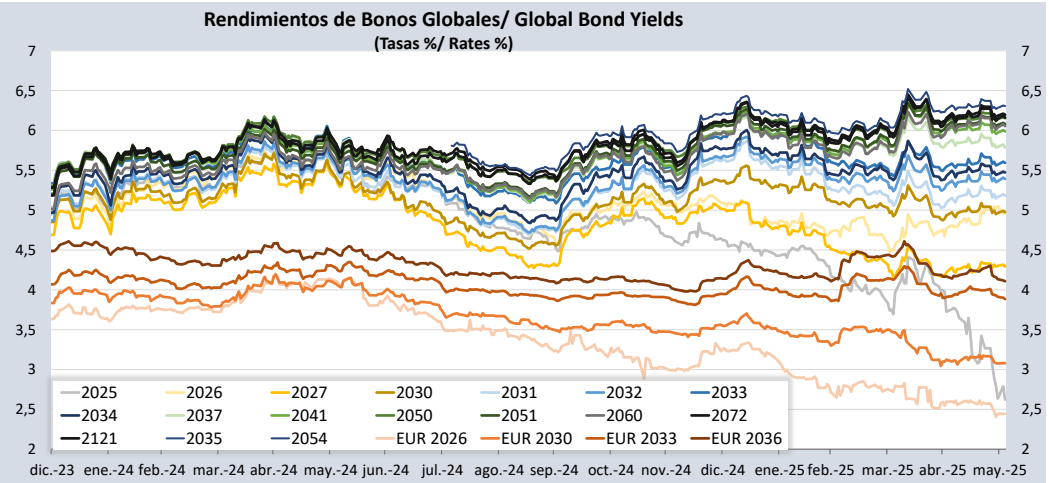
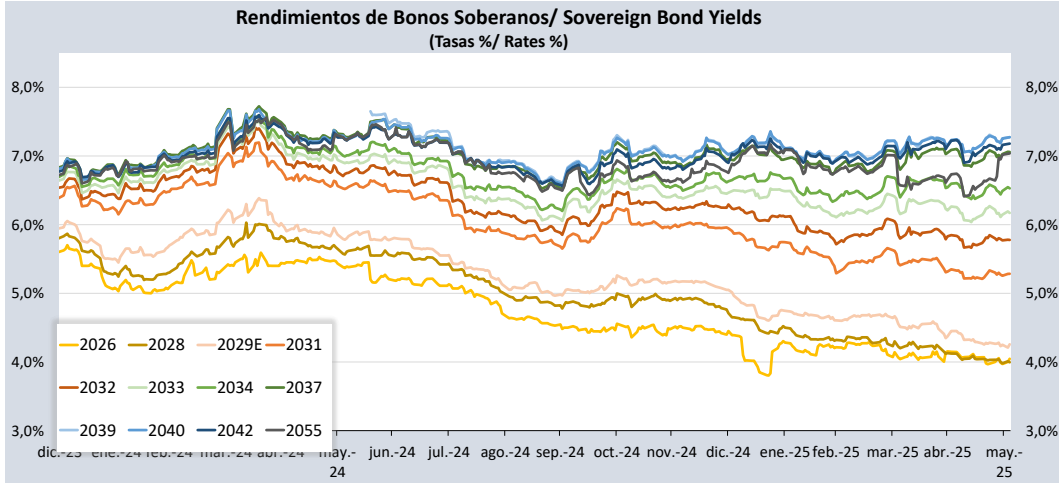
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

03/06/2025

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº 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	Monto (Mills. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	2,51	3 940	8,200	-	-	-	104,7686	-	-	-	4,0468	-	28-May-25	5	1,15	1,11	1,19
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	1,95	7 231	6,350	-	-	-	106,9326	-	-	-	3,9950	-	2-Jun-25	2	2,94	3,31	3,19
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	1,82	13 187	5,940	105,59	105,87	105,63	105,6177	4,26	4,18	4,25	4,2568	10	3-Jun-25	24	3,38	3,24	3,69
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,13	19 590	6,950	108,40	108,78	108,64	108,6540	5,33	5,26	5,29	5,2842	9	3-Jun-25	59	5,16	4,90	6,19
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	1,89	22 058	6,150	102,07	102,27	102,18	102,1461	5,79	5,76	5,77	5,7770	15	3-Jun-25	97	5,91	5,59	7,19
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,24	23 285	7,300	107,06	107,25	107,19	107,1970	6,19	6,16	6,17	6,1693	5	3-Jun-25	18	6,34	5,98	8,19
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	1,66	18 726	5,400	92,27	92,59	92,40	92,3427	6,54	6,49	6,52	6,5283	6	3-Jun-25	12	7,25	6,81	9,19
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,12	21 769	6,900	98,76	99,31	98,92	98,8578	7,07	7,00	7,05	7,0575	49	3-Jun-25	188	8,36	7,81	12,19
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,33	15 975	7,600	103,08	103,69	103,25	103,0539	7,27	7,20	7,25	7,2727	17	3-Jun-25	43	8,94	8,33	14,19
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	1,64	12 453	5,350	82,68	82,76	82,76	82,6587	7,27	7,26	7,26	7,2726	49	3-Jun-25	204	10,02	9,34	15,19
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,10	5 037	6,850	-	-	-	96,9937	-	-	-	7,1794	-	28-May-25	0	10,02	9,35	16,69
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,06	3 540	6,714	-	-	-	96,2035	-	-	-	7,0360	-	28-May-25	23	12,86	12,02	29,69
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	0,89	77	2,89%+VAC	-	-	-	103,0531	-	-	-	2,1797	-	18-Ago-23	20	4,46	4,36	4,69
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	2,51	911	7,39% + VAC	-	-	-	126,5679	-	-	-	4,0204	-	17-Dic-24	2	7,36	7,08	9,66
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	0,96	228	3,14%+VAC	-	-	-	84,3105	-	-	-	4,6085	-	10-Ago-23	50	11,61	11,10	14,69
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,17	649	3,83% + VAC	-	-	-	92,0406	-	-	-	4,3951	-	11-Oct-24	52	14,42	13,81	21,19
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,00	1 234	3,26%+VAC	-	-	-	83,8239	-	-	-	4,2293	-	11-Abr-25	5	17,87	17,15	28,69

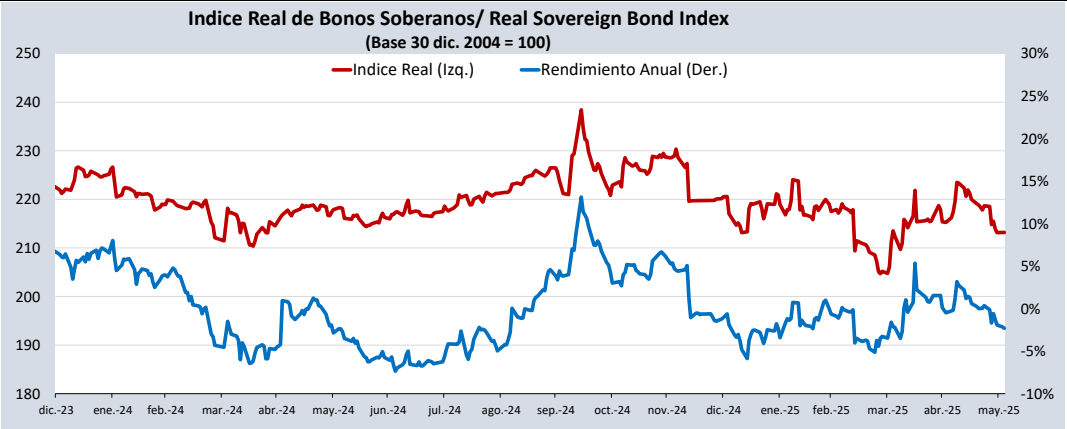
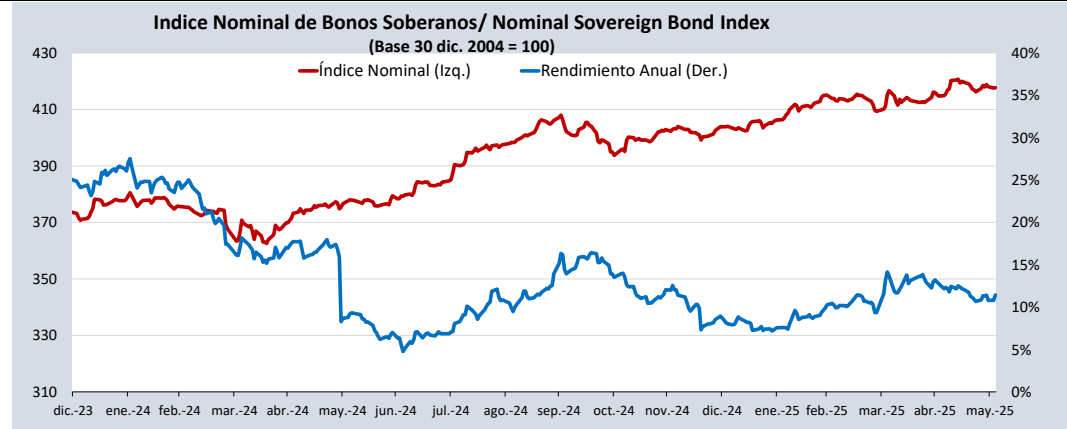
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the 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	425	7,350	100,6060	0,01	-0,01	-0,42	2,6210	-17	-44	312	0,13	0,13	0,13	
23-ene-26	US715638DE95	346	2,392	98,4110	0,00	0,06	-0,50	4,9560	0	-3	82	0,63	0,62	0,65	
30-ene-26	XS1315181708	€845	2,750	100,1840	0,00	0,05	-1,14	2,4410	0	-8	175	0,65	0,64	0,67	
25-ago-27	US715638BU55	618	4,125	99,6410	0,05	-0,03	-0,53	4,2930	-2	1	25	2,13	2,08	2,26	
20-jun-30	US715638DA73	645	2,844	90,5890	0,07	-0,02	-0,55	4,9760	-1	1	13	4,65	4,54	5,12	
30-mar-30	XS1373156618	€935	3,750	102,9080	0,00	0,26	-1,46	3,0780	0	-6	33	4,27	4,21	4,73	
23-ene-31	US715638DF60	3 207	2,783	88,3960	0,07	-0,08	-0,52	5,1830	-2	2	12	5,17	5,04	5,72	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	78,4880	0,11	-0,10	-0,59	5,3900	-2	3	11	6,95	6,77	7,61	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	121,0520	0,11	-0,13	-0,86	5,5930	-1	1	11	6,37	6,20	8,59	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,6370	0,11	0,38	-0,95	3,8820	-2	-6	16	7,36	7,22	7,88	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,1950	0,06	-0,03	-0,63	5,4720	-1	1	10	7,44	7,24	8,74	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,1820	0,05	-0,05	-0,61	5,6200	-1	1	8	7,52	7,32	9,83	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,5910	0,08	0,61	-0,80	4,1070	-1	-8	10	10,14	9,94	11,63	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,4580	0,35	0,20	-0,84	5,7850	-4	-2	10	8,40	8,16	11,95	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	72,7990	0,13	-0,10	-0,70	5,9890	-1	1	8	11,60	11,26	16,00	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	93,2530	0,19	-0,12	-0,70	6,1530	-2	1	6	13,38	12,98	25,83	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	67,2710	0,15	-0,06	-0,74	6,0800	-1	1	8	14,79	14,36	26,14	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	94,2720	0,08	-0,32	-0,74	6,3060	-1	3	6	13,60	13,19	29,61	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,4270	0,20	-0,20	-0,75	6,0550	-2	2	8	17,51	17,00	36,01	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	60,5240	0,14	0,00	-0,78	6,1970	-1	0	8	16,54	16,04	47,30	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,5730	0,22	-0,21	-0,68	6,1600	-2	2	8	16,55	16,05	97,55	

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	418	0	-1	11,45	63	10	2,46	4,58	8,25	12,63	13,36	14,83	10,25	12,80	9,80	6,11	2,91	2,03
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-Feb-30					31-Ene-35		12-Feb-40		12-Feb-46		12-Feb-54
Índice de bonos soberanos real / Real sovereign bond index	213	0	-2	-2,32	-18	-64	2,57					37,86		6,26		19,48		33,83



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.