



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

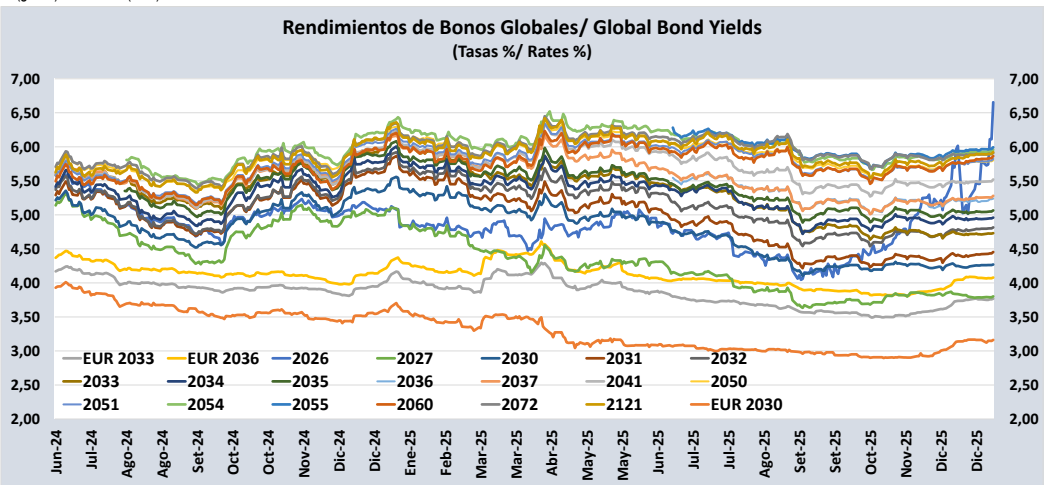
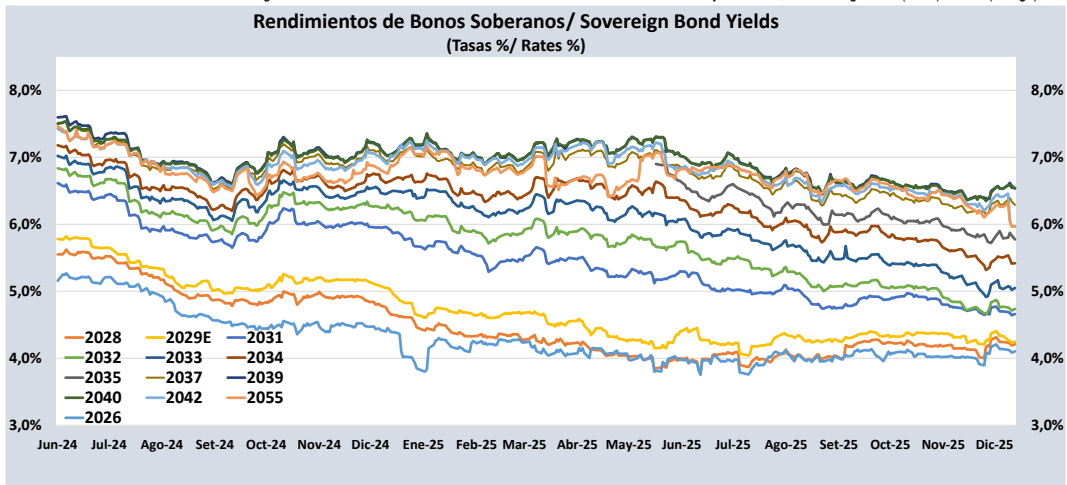
02/01/2026

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	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	3,19	1 446	8,200	-	-	-	102,4453	-	-	-	4,1030	-	11-Dic-25	10	0,60	0,57	0,61
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,47	2 804	6,350	-	-	-	105,1993	-	-	-	4,2097	-	17-Dic-25	0	2,43	2,33	2,61
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,31	8 024	5,940	-	-	-	104,8240	-	-	-	4,2467	-	31-Dic-25	31	2,87	2,76	3,11
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	2,70	14 559	6,950	-	-	111,10	111,1270	-	-	4,66	4,6600	1	2-Ene-26	1	4,75	4,54	5,61
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,39	22 069	6,150	-	-	107,95	107,8654	-	-	4,72	4,7362	3	2-Ene-26	29	5,54	5,29	6,61
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	2,84	24 045	7,300	-	-	113,92	114,0065	-	-	5,06	5,0492	19	2-Ene-26	209	6,03	5,74	7,61
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,10	24 256	5,400	-	-	99,76	99,8288	-	-	5,43	5,4189	16	2-Ene-26	42	6,95	6,59	8,61
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	3,82	22 464	6,850	-	-	107,78	107,9164	-	-	5,78	5,7628	34	2-Ene-26	134	7,15	6,76	9,61
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	2,68	22 230	6,900	-	-	105,01	105,0312	-	-	6,29	6,2878	32	2-Ene-26	348	8,18	7,69	11,61
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	2,95	17 180	7,600	-	-	109,45	109,6025	-	-	6,55	6,5336	11	2-Ene-26	22	8,84	8,30	13,61
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,08	12 835	5,350	-	-	88,91	88,9724	-	-	6,55	6,5413	10	2-Ene-26	27	9,94	9,33	14,61
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	2,66	5 040	6,850	-	-	-	109,0560	-	-	-	5,9663	-	31-Dic-25	3	10,18	9,60	16,11
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,61	3 542	6,714	-	-	-	110,2618	-	-	-	5,9663	-	30-Dic-25	2	13,71	12,94	29,11
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,12	110	2,89%+VAC	-	-	-	103,2552	-	-	-	2,0394	-	18-Ago-23	20	3,93	3,85	4,11
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,11	1 728	7,39% + VAC	-	-	-	133,8629	-	-	-	3,0633	-	17-Dic-24	2	7,07	6,86	9,08
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,22	519	3,14%+VAC	-	-	-	91,8541	-	-	-	3,8775	-	23-Oct-25	5	11,38	10,96	14,11
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,49	1 279	3,83% + VAC	-	-	-	109,6494	-	-	-	3,1666	-	11-Oct-24	52	14,76	14,31	20,61
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,27	2 396	3,26%+VAC	-	-	-	104,8260	-	-	-	2,9896	-	2-Dic-25	5	18,89	18,34	28,11

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).

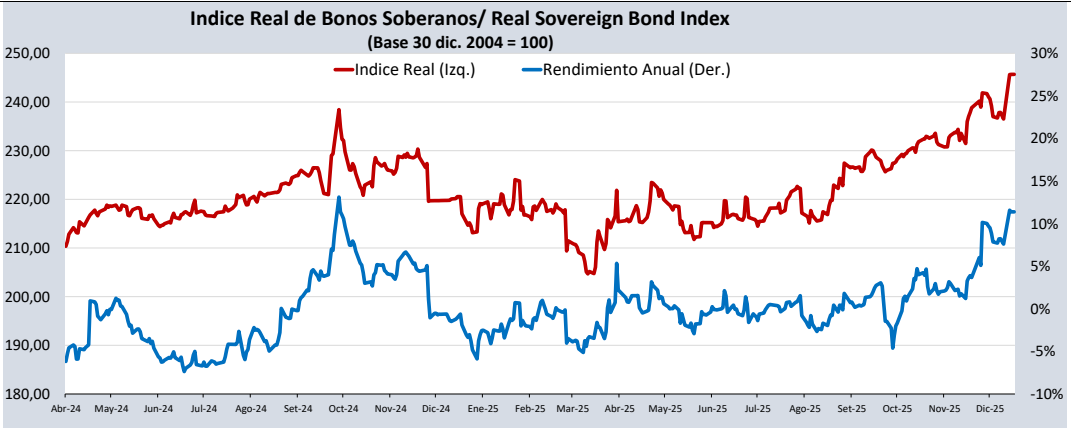
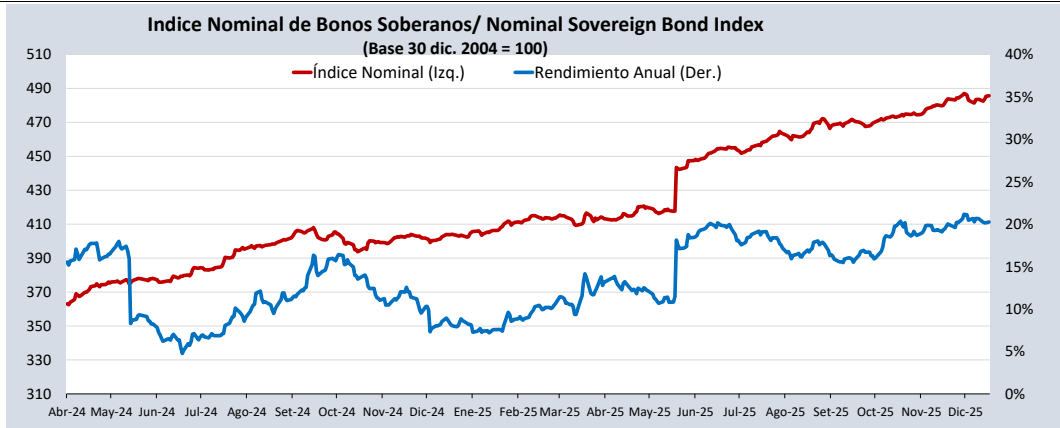
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	
23-ene-26	US715638DE95	282	2,392	99,7840	0,00	0,01	-0,52	6,6550	54	86	1043	0,06	0,06	0,06	
30-ene-26	XS1315181708	€689	2,750	100,1110	0,00	0,00	-0,39	1,1000	0	-65	552	0,08	0,08	0,08	
25-ago-27	US715638BU55	449	4,125	100,5060	-0,02	-0,03	-0,51	3,8010	1	2	32	1,59	1,56	1,65	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	94,2610	-0,02	-0,02	-0,51	4,2710	1	1	13	4,21	4,13	4,47	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	102,2500	-0,05	0,00	-0,66	3,1610	1	0	17	3,93	3,87	4,24	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	92,5150	-0,08	-0,11	-0,43	4,4540	2	3	10	4,68	4,57	5,06	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,8200	-0,05	-0,07	-0,44	4,8160	1	2	8	6,46	6,31	6,91	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	126,1700	-0,07	-0,18	-0,79	4,7310	1	2	11	6,06	5,92	7,89	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,4180	-0,05	-0,02	-0,70	3,7680	1	1	13	6,84	6,71	7,19	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	87,1490	-0,06	-0,12	-0,54	4,9600	1	2	9	7,01	6,84	8,04	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,2210	-0,12	-0,18	-0,52	5,0660	2	2	7	7,19	7,01	9,10	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	102,0320	-0,06	-0,29	-0,28	5,2380	1	4	4	7,89	7,69	10,24	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,6180	-0,06	-0,01	-0,77	4,0780	1	0	10	9,68	9,49	10,88	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,6230	-0,21	-0,23	-0,66	5,2800	2	3	7	8,14	7,93	11,20	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,3810	-0,22	-0,27	-0,64	5,5190	3	3	7	11,40	11,09	15,19	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,6710	-0,20	-0,30	-0,64	5,8020	1	2	5	13,45	13,08	24,88	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,1700	-0,25	-0,38	-0,70	5,8220	2	4	7	14,81	14,39	25,19	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,8760	-0,28	-0,41	-0,74	5,9570	2	3	5	13,77	13,38	28,60	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	102,8520	-0,32	-0,38	-0,46	5,9930	2	3	3	14,08	13,67	29,49	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	54,4040	-0,29	-0,39	-0,58	5,8640	3	4	6	17,67	17,17	34,91	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,5980	-0,18	-0,22	-0,69	5,9090	2	2	6	17,04	16,55	46,04	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	54,7170	-0,24	-0,28	-0,69	5,9210	3	3	7	17,14	16,65	95,57	

Índice de bonos soberanos / Peruvian sovereign bond index																		
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	Diario / Daily	Semanal / Weekly	12-Ago-28	12-Feb-29	12-Ago-31	12-Ago-32	12-Ago-33	12-Ago-34	12-Ago-35	12-Ago-37	12-Ago-39	12-Ago-40	12-Feb-42	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	486	0,4	2,3	20,27	10	-42	1,55	4,41	8,50	12,48	14,41	12,68	12,87	12,28	9,91	5,99	2,89	2,05
Índice / Index	Valor / Value	Cambio / Change		Rend anual	Cambio / Change (bps.)		Composición del índice (%) / Index composition (%)											
		Diario / Daily	Semanal / Weekly	% / Annual yield %	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	246	0,00	7,82	11,39	-1	316	2,24				34,89		5,93		20,17		36,76	



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.