



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

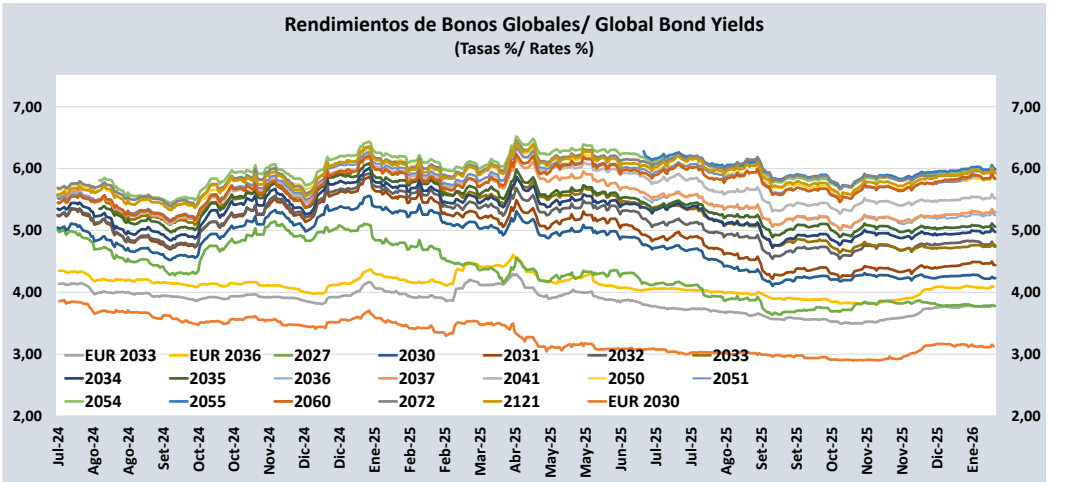
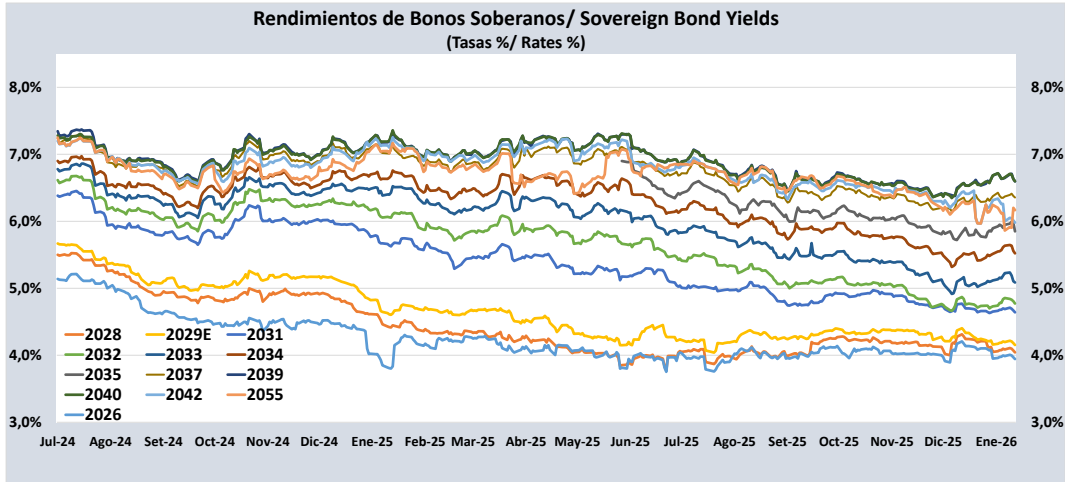
22/01/2026

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	3,63	1 446	8,200	-	-	-	102,3238	-	-	-	3,9435	-	13-Ene-26	1	0,54	0,52	0,56
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,81	2 804	6,350	-	-	-	105,5109	-	-	-	4,0435	-	16-Ene-26	0	2,38	2,28	2,56
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,63	8 024	5,940	-	-	-	105,0198	-	-	-	4,1536	-	16-Ene-26	0	2,82	2,71	3,06
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,08	14 559	6,950	111,17	111,32	111,22	111,1344	4,63	4,60	4,62	4,6411	11	22-Ene-26	83	4,69	4,48	5,56
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,72	22 069	6,150	107,38	107,90	107,61	107,6082	4,81	4,72	4,77	4,7720	10	22-Ene-26	55	5,48	5,23	6,56
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,23	24 045	7,300	113,57	113,91	113,77	113,6844	5,10	5,05	5,07	5,0861	24	22-Ene-26	331	5,97	5,68	7,56
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,39	24 256	5,400	98,64	100,97	99,16	99,1468	5,60	5,25	5,52	5,5222	33	22-Ene-26	119	6,89	6,53	8,56
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	4,19	22 464	6,850	106,86	107,05	106,97	107,0508	5,90	5,88	5,89	5,8752	32	22-Ene-26	90	7,09	6,69	9,56
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,06	22 230	6,900	104,39	104,51	104,43	104,4613	6,37	6,35	6,36	6,3559	32	22-Ene-26	218	8,11	7,63	11,56
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,37	17 443	7,600	108,87	109,43	109,06	109,0042	6,61	6,55	6,59	6,5963	20	22-Ene-26	491	8,77	8,23	13,56
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,37	12 835	5,350	88,43	88,94	88,60	88,5264	6,61	6,55	6,59	6,5977	28	22-Ene-26	258	9,87	9,26	14,56
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,03	5 040	6,850	-	-	-	108,8985	-	-	-	5,9799	-	21-Ene-26	0	10,12	9,55	16,06
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,97	3 542	6,714	-	-	-	107,3877	-	-	-	6,1673	-	21-Ene-26	1	13,47	12,68	29,06
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,28	111	2,89%+VAC	-	-	-	103,4928	-	-	-	1,9695	-	18-Ago-23	20	3,87	3,80	4,06
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,51	1 731	7,39% + VAC	-	-	-	132,7889	-	-	-	3,1604	-	17-Dic-24	2	7,00	6,79	9,03
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,39	520	3,14%+VAC	-	-	-	91,3734	-	-	-	3,9275	-	23-Oct-25	5	11,32	10,89	14,06
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,70	1 281	3,83% + VAC	-	-	-	108,5535	-	-	-	3,2351	-	11-Oct-24	52	14,67	14,21	20,56
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,45	2 400	3,26%+VAC	-	-	-	101,5226	-	-	-	3,1630	-	2-Dic-25	5	18,66	18,09	28,06

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).

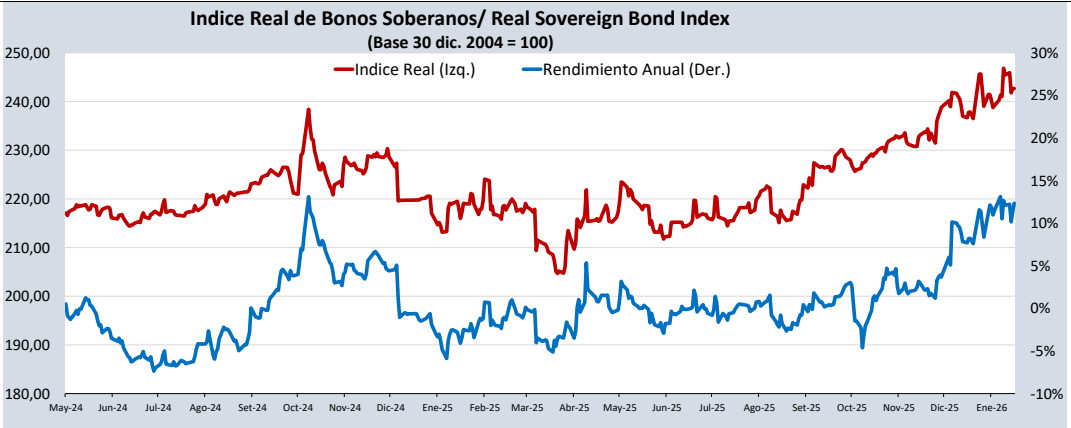
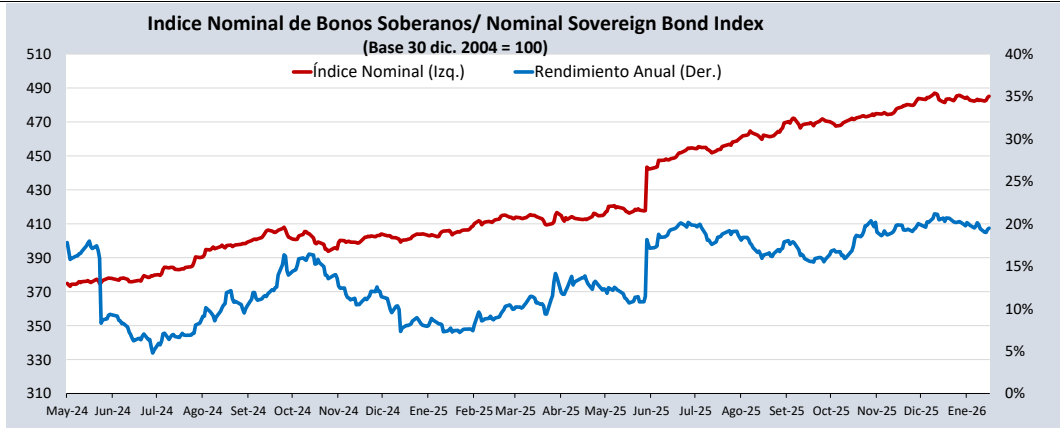
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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
25-ago-27	US715638BU55	449	4,125	100,5280	0,00	0,01	-0,53	3,7780	0	-1	35	1,53	1,50	1,59
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	94,4840	0,01	0,01	-0,47	4,2280	0	0	12	4,16	4,07	4,41
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	102,3720	0,00	-0,05	-0,66	3,1220	0	1	17	3,88	3,82	4,19
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	92,6490	0,01	0,12	-0,42	4,4390	0	-2	10	4,62	4,52	5,00
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	83,2430	0,08	0,12	-0,42	4,7550	-1	-1	8	6,40	6,25	6,86
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	125,9980	0,08	-0,08	-0,80	4,7350	-1	0	11	6,01	5,87	7,83
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,4230	0,04	-0,07	-0,70	3,7860	0	2	13	6,78	6,65	7,14
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	87,1260	0,12	-0,10	-0,52	4,9750	-2	2	9	7,08	6,91	7,98
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,2770	0,15	-0,11	-0,53	5,0580	-2	1	7	7,13	6,96	9,04
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	101,9770	0,09	-0,12	-0,25	5,2440	-1	1	3	7,83	7,63	10,19
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,7330	0,12	-0,01	-0,73	4,0720	-1	0	10	9,63	9,43	10,82
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,4900	0,11	-0,24	-0,72	5,2910	-1	3	8	8,08	7,87	11,14
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,4450	0,19	-0,13	-0,68	5,5170	-2	2	8	11,35	11,04	15,14
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,3750	0,22	-0,34	-0,81	5,8260	-2	3	6	13,38	13,00	24,82
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	69,9820	0,26	-0,12	-0,72	5,8430	-3	1	7	14,74	14,32	25,13
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,6560	0,29	-0,18	-0,75	5,9730	-2	1	6	13,70	13,31	28,54
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	102,8640	0,30	-0,22	-0,32	5,9910	-2	1	2	14,03	13,62	29,44
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	54,7070	0,25	-0,06	-0,60	5,8330	-3	1	6	17,67	17,17	34,86
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,4190	0,28	-0,08	-0,74	5,9270	-3	1	7	17,43	16,92	45,98
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	54,6800	0,26	-0,09	-0,64	5,9260	-3	1	7	17,07	16,58	95,52

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-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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	485	0,8	2,5	19,49	15	-40	1,56	4,43	8,54	12,50	14,43	12,64	12,83	12,27	9,91	5,99	2,90
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	243	0,02	-4,15	12,36	105	-30	2,28				35,23		6,00		20,30		36,19



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.