



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

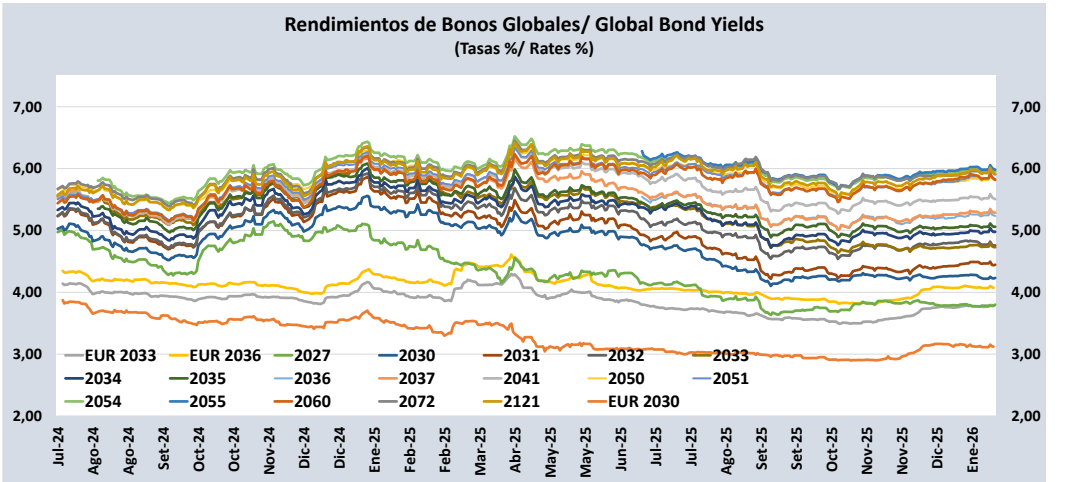
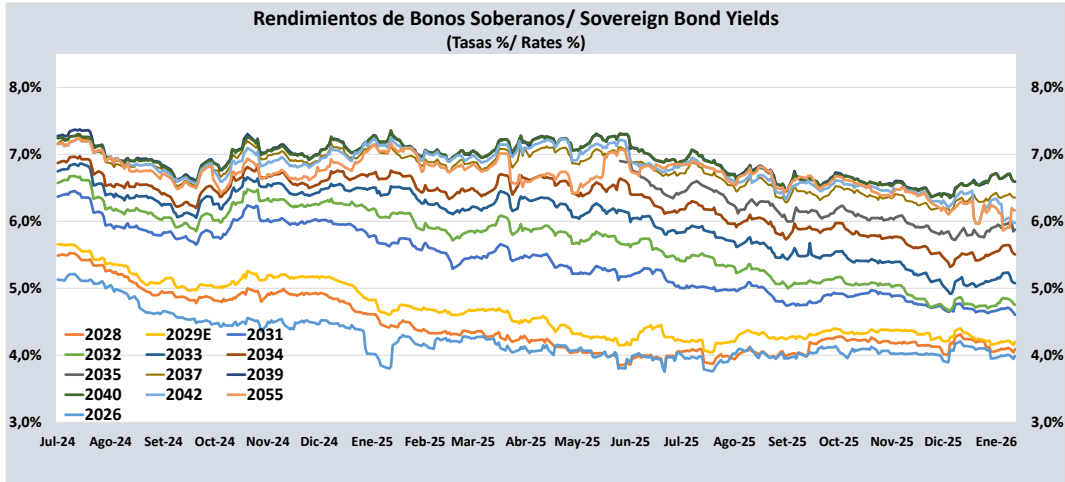
23/01/2026

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	3,65	1 446	8,200	-	-	-	102,2866	-	-	-	3,9915	-	13-Ene-26	1	0,54	0,52	0,56
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,83	2 804	6,350	-	-	-	105,3871	-	-	-	4,0915	-	16-Ene-26	0	2,37	2,28	2,56
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,65	8 024	5,940	104,79	105,01	104,92	104,8762	4,23	4,15	4,18	4,2016	6	23-Ene-26	37	2,82	2,70	3,06
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,10	14 559	6,950	111,27	111,42	111,32	111,3271	4,61	4,58	4,60	4,6026	5	23-Ene-26	23	4,69	4,48	5,56
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,74	22 069	6,150	107,66	107,95	107,78	107,7183	4,76	4,71	4,74	4,7525	15	23-Ene-26	45	5,48	5,23	6,56
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,25	24 045	7,300	113,77	113,90	113,84	113,7484	5,07	5,05	5,06	5,0759	65	23-Ene-26	378	5,97	5,68	7,56
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,41	24 256	5,400	99,03	99,33	99,30	99,2580	5,54	5,50	5,50	5,5055	28	23-Ene-26	80	6,89	6,53	8,56
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	4,21	22 464	6,850	106,86	107,01	107,01	107,0334	5,90	5,88	5,88	5,8774	38	23-Ene-26	98	7,08	6,69	9,56
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,08	22 230	6,900	104,26	104,51	104,43	104,4610	6,38	6,35	6,36	6,3559	21	23-Ene-26	131	8,11	7,62	11,56
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,39	17 443	7,600	108,97	109,48	109,06	109,0433	6,60	6,55	6,59	6,5920	13	23-Ene-26	57	8,77	8,22	13,56
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,38	12 835	5,350	88,35	88,64	88,52	88,5600	6,62	6,59	6,60	6,5939	13	23-Ene-26	82	9,87	9,26	14,56
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,05	5 040	6,850	-	-	-	108,9385	-	-	-	5,9761	-	21-Ene-26	0	10,12	9,55	16,06
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,99	3 542	6,714	-	-	-	107,4410	-	-	-	6,1635	-	21-Ene-26	1	13,47	12,68	29,06
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,29	111	2,89%+VAC	-	-	-	103,4386	-	-	-	1,9826	-	18-Ago-23	20	3,87	3,79	4,06
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,53	1 731	7,39% + VAC	-	-	-	132,8518	-	-	-	3,1527	-	17-Dic-24	2	7,00	6,79	9,03
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,40	520	3,14%+VAC	-	-	-	91,4142	-	-	-	3,9236	-	23-Oct-25	5	11,32	10,89	14,06
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,71	1 281	3,83% + VAC	-	-	-	108,6108	-	-	-	3,2314	-	11-Oct-24	52	14,67	14,21	20,56
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,46	2 400	3,26%+VAC	-	-	-	101,5916	-	-	-	3,1593	-	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).

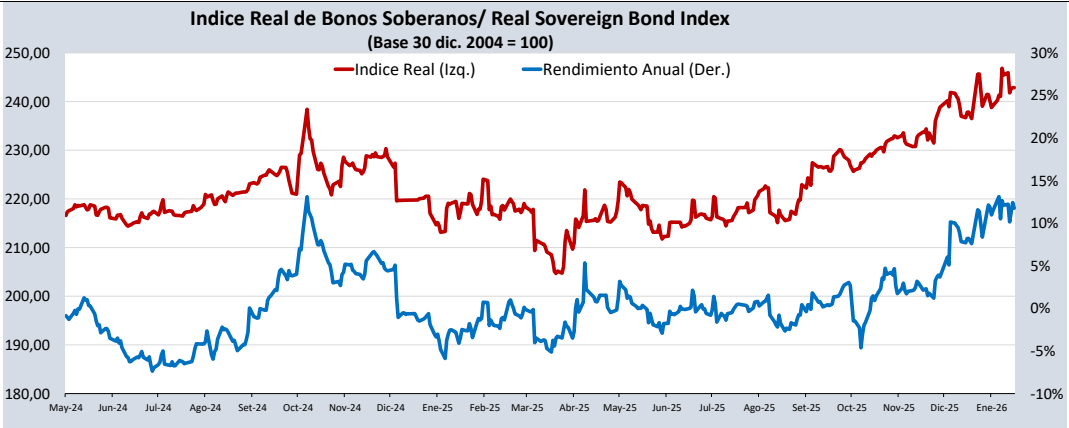
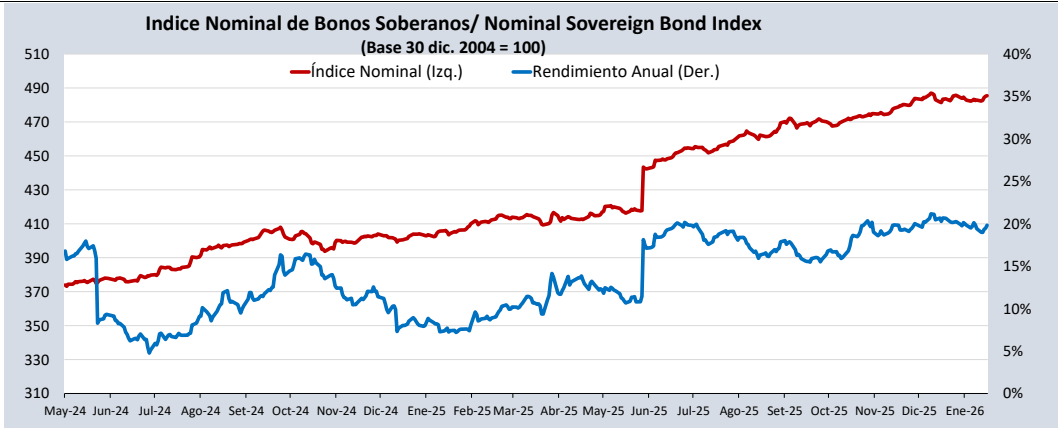
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	100,4910	-0,03	-0,03	-0,52	3,8000	2	2	34	1,53	1,50	1,59	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	94,4810	-0,02	-0,02	-0,44	4,2310	1	1	11	4,16	4,07	4,41	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	102,4540	0,08	0,03	-0,61	3,1010	-2	-1	16	3,87	3,81	4,19	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	92,6330	-0,02	0,11	-0,39	4,4450	1	-2	9	4,69	4,59	5,00	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	83,2490	0,00	0,10	-0,41	4,7570	0	-1	8	6,40	6,25	6,86	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	126,0260	0,00	0,02	-0,66	4,7280	0	-1	9	6,00	5,87	7,83	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,5190	0,09	0,00	-0,73	3,7700	-2	1	13	6,78	6,65	7,13	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	87,1210	0,00	0,01	-0,52	4,9770	0	0	9	7,08	6,90	7,98	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	102,2630	-0,01	-0,01	-0,51	5,0590	0	0	7	7,13	6,95	9,04	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	102,0630	0,08	0,08	-0,27	5,2330	-1	-1	4	7,83	7,63	10,19	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,8160	0,08	0,06	-0,75	4,0620	-1	0	10	9,63	9,43	10,82	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	110,5350	0,04	0,02	-0,62	5,2850	0	0	7	8,08	7,87	11,14	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	77,5540	0,12	0,14	-0,66	5,5050	-1	-1	8	11,35	11,04	15,13	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	97,5430	0,16	0,03	-0,72	5,8130	-1	0	5	13,39	13,01	24,82	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	70,1440	0,17	0,19	-0,68	5,8280	-1	-2	7	14,75	14,33	25,13	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	98,8730	0,21	0,15	-0,75	5,9570	-2	-1	6	13,72	13,32	28,54	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	103,0040	0,17	0,03	-0,29	5,9810	-1	0	2	14,03	13,63	29,44	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	54,8800	0,21	0,25	-0,58	5,8150	-2	-3	6	17,69	17,19	34,86	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	63,5920	0,18	0,20	-0,73	5,9110	-2	-2	7	17,46	16,96	45,98	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	54,8540	0,17	0,23	-0,73	5,9070	-2	-3	8	17,12	16,63	95,51	

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	0,3	2,6	19,83	34	41	1,56	4,43	8,55	12,51	14,43	12,65	12,82	12,26	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	-2,59	11,77	-65	-35	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.