

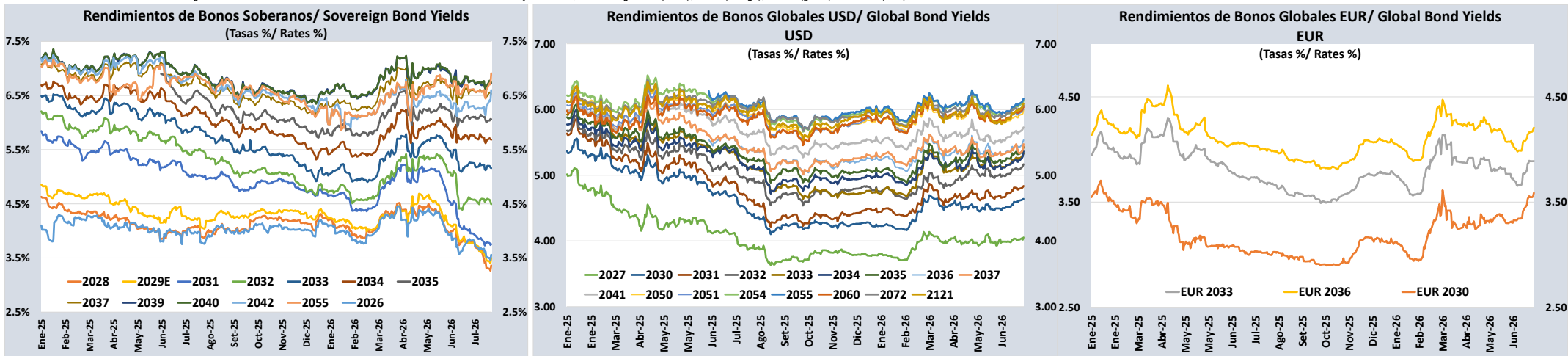


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

22/07/2026																			
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 (%)			Compra / Bid	Venta / Ask	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)			
12-Ago-26	PEP01000C0J9	SB12AGO26	3,62	1 446	8,200	-	-	-	100,2635	-	-	-	3,5602	-	2-Jul-26	0,2	0,06	0,06	0,06
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,81	2 804	6,350	-	-	-	105,8427	-	-	-	3,3628	-	8-Jul-26	2	1,94	1,88	2,06
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,63	8 025	5,940	105,80	0,00	105,80	105,8499	3,50	0,00	3,50	3,5000	1	22-Jul-26	2	2,40	2,32	2,56
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,07	14 560	6,950	114,36	114,70	114,70	114,4951	3,77	3,70	3,70	3,7546	13	22-Jul-26	178	4,35	4,20	5,06
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,72	22 072	6,150	108,43	108,86	108,76	108,6054	4,52	4,44	4,46	4,4930	24	22-Jul-26	483	5,14	4,92	6,06
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,23	24 199	7,300	112,14	112,66	112,35	112,4612	5,21	5,12	5,17	5,1585	7	22-Jul-26	48	5,66	5,38	7,06
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,39	24 259	5,400	97,99	98,18	98,12	98,1496	5,71	5,68	5,69	5,6843	14	22-Jul-26	72	6,56	6,21	8,06
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	3,03	25 244	6,850	105,41	105,82	105,57	105,6939	6,06	6,01	6,04	6,0246	17	22-Jul-26	92	6,87	6,48	9,06
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,05	23 737	6,900	102,75	111,48	102,93	102,9219	6,55	5,49	6,53	6,5315	24	22-Jul-26	172	7,85	7,37	11,06
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,36	20 195	7,600	107,34	108,10	107,39	107,5877	6,76	6,67	6,75	6,7284	14	22-Jul-26	193	8,54	8,00	13,06
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,36	12 836	5,350	87,27	88,33	87,60	87,5683	6,78	6,65	6,74	6,7417	13	22-Jul-26	79	9,63	9,02	14,06
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,03	5 040	6,850	0,00	0,00	102,47	102,4763	0,00	0,00	6,60	6,6000	1	22-Jul-26	1,3	9,74	9,14	15,56
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	2,97	3 543	6,714	-	-	-	97,7224	-	-	-	6,9109	-	22-Jul-26	0,9	12,70	11,88	28,56
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,28	115	2,89%+VAC	-	-	-	105,7718	-	-	-	1,2110	-	18-Ago-23	20	3,42	3,38	3,56
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,51	1 797	7,39% + VAC	-	-	-	130,1214	-	-	-	3,2834	-	17-Dic-24	1	6,68	6,47	8,53
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,39	607	3,14%+VAC	-	-	-	90,5649	-	-	-	4,0326	-	8-May-26	7	10,99	10,56	13,56
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,69	1 330	3,83% + VAC	-	-	-	99,4303	-	-	-	3,8510	-	11-Oct-24	52	14,13	13,60	20,06
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,44	2 789	3,26%+VAC	-	-	-	89,8733	-	-	-	3,8471	-	16-Jul-26	25	17,79	17,13	27,56

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).

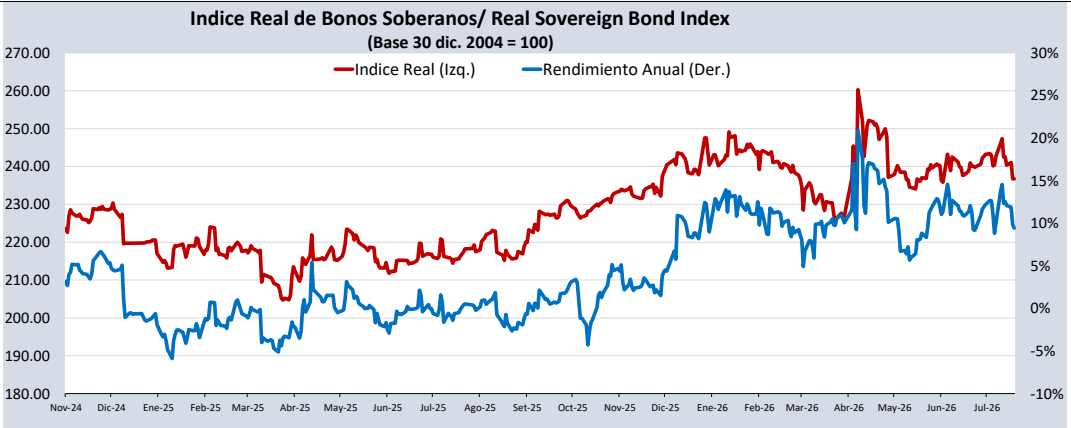
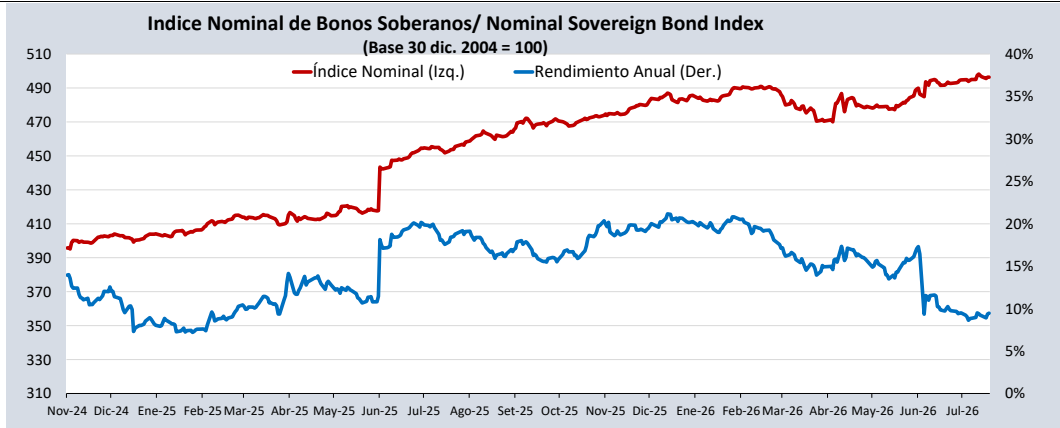
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	100,0730	-0,04	-0,04	-0,41	4,0530	3	4	39	1,06	1,04	1,09
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,6480	-0,01	-0,14	-0,35	4,6390	0	5	10	3,71	3,63	3,91
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	100,5250	-0,11	-0,15	-0,53	3,5870	3	4	16	3,44	3,38	3,69
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	91,7850	-0,06	-0,19	-0,35	4,8360	2	6	9	4,19	4,09	4,50
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,2860	-0,12	-0,36	-0,42	5,1670	3	8	9	5,96	5,81	6,36
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,5180	-0,11	-0,66	-0,83	5,3290	1	9	12	5,67	5,53	7,33
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,8280	0,01	-0,06	-0,75	3,8890	0	2	14	6,33	6,21	6,64
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,6010	-0,42	-0,87	-0,36	5,3630	8	16	6	6,68	6,50	7,48
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,6160	-0,25	-0,78	-0,45	5,4310	4	11	7	6,79	6,61	8,54
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	99,7500	-0,25	-0,79	-0,18	5,5330	3	12	2	7,51	7,31	9,69
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,4070	-0,16	-3,40	-0,93	4,2070	2	6	13	9,23	9,04	10,32
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,9690	-0,70	-1,38	-0,44	5,4730	9	9	5	7,79	7,58	10,64
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	76,1570	-0,19	-0,81	-0,67	5,7280	2	10	8	11,03	10,73	14,64
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	95,2460	-0,75	-1,56	-0,59	5,9980	6	13	5	13,13	12,75	24,32
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	68,6040	-0,16	-0,87	-0,53	6,0080	2	9	5	14,48	14,05	24,63
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	96,4690	-0,36	-1,26	-0,63	6,1400	3	10	5	13,45	13,05	28,04
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	100,4880	-0,34	-1,42	-0,22	6,1630	3	11	2	13,77	13,36	28,94
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	53,0430	-0,13	-0,81	-0,55	6,0360	1	9	6	17,30	16,79	34,36
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	62,0440	-0,17	-0,80	-0,59	6,0650	2	8	6	17,13	16,62	45,48
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	53,1940	-0,24	-1,07	-0,74	6,0900	3	12	8	16,61	16,12	95,02

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	12-Feb-55
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	496	0,0	-1,9	9,47	9	7	1,52	4,35	8,55	12,27	13,98	12,18	13,48	12,56	10,94	5,76	2,65	1,78
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	237	0,02	-5,80	9,43	-38	-292	2,08				30,80		9,44		17,76		39,92	



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.