



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

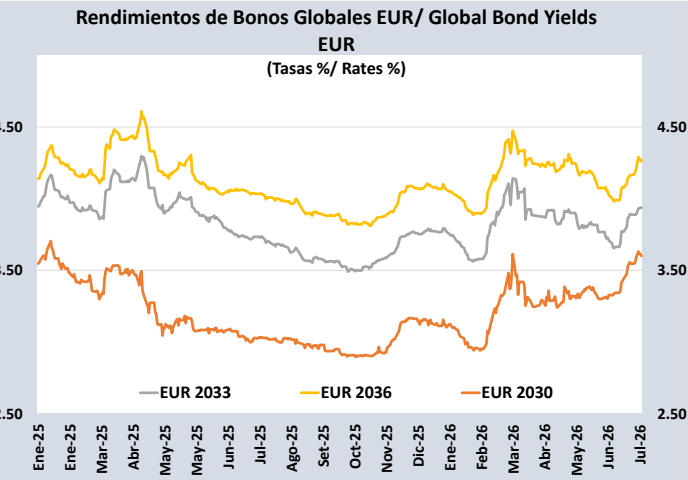
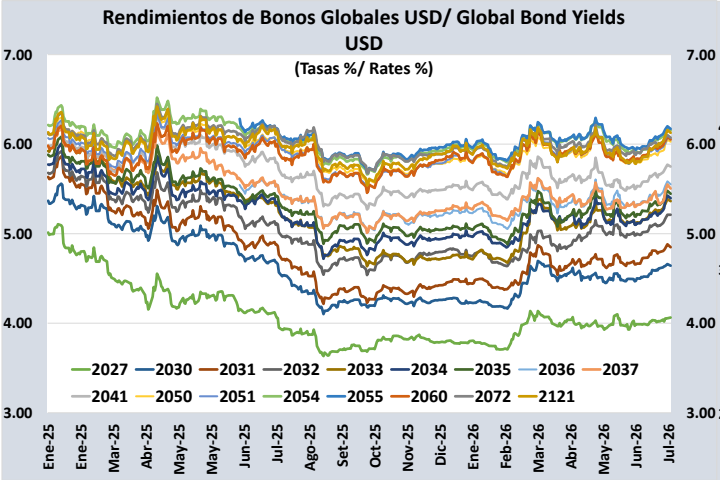
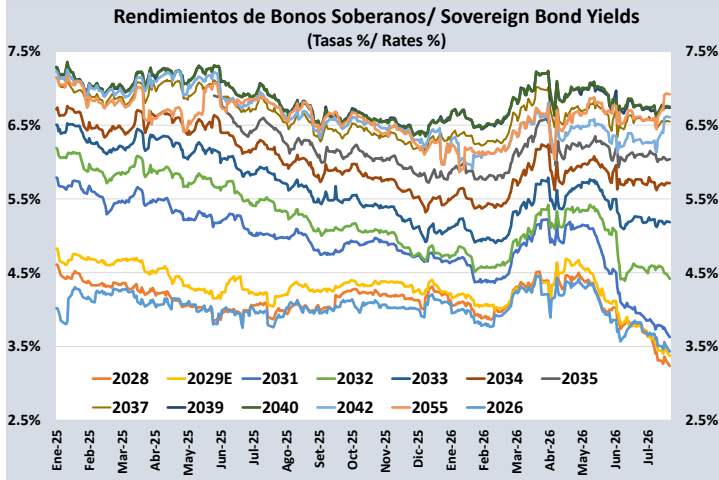
27/07/2026

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 (%)	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	3,74	1 446	8,200	-	-	-	100,2064	-	-	-	3,4318	-	2-Jul-26	0,2	0,04	0,04	0,05
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	2,89	2 804	6,350	-	-	-	106,0660	-	-	-	3,2344	-	8-Jul-26	2	1,93	1,87	2,05
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	2,71	8 025	5,940	-	-	-	106,1412	-	-	-	3,3716	-	22-Jul-26	2	2,38	2,31	2,55
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	3,17	14 560	6,950	-	-	-	115,0932	-	-	-	3,6262	-	24-Jul-26	5	4,34	4,19	5,05
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	2,80	22 072	6,150	108,58	109,05	108,85	108,9993	4,49	4,41	4,44	4,4180	5	27-Jul-26	10	5,13	4,91	6,05
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	3,33	24 199	7,300	-	-	-	112,2767	-	-	-	5,1850	-	24-Jul-26	91	5,64	5,36	7,05
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	2,46	24 259	5,400	97,78	97,93	98,00	97,9717	5,75	5,72	5,71	5,7133	2	27-Jul-26	3	6,55	6,19	8,05
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	3,12	25 244	6,850	-	-	-	105,5794	-	-	-	6,0400	-	24-Jul-26	77	6,85	6,46	9,05
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	3,15	23 737	6,900	102,70	102,93	102,85	102,7842	6,56	6,53	6,54	6,5489	9	27-Jul-26	18	7,83	7,35	11,05
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	3,46	20 195	7,600	-	-	-	107,5237	-	-	-	6,7351	-	24-Jul-26	32	8,53	7,99	13,05
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	2,44	12 836	5,350	-	-	-	87,5119	-	-	-	6,7496	-	24-Jul-26	43	9,61	9,00	14,05
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	3,12	5 040	6,850	-	-	-	102,3993	-	-	-	6,6079	-	22-Jul-26	1,3	9,72	9,12	15,55
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	3,06	3 543	6,714	-	-	-	97,6287	-	-	-	6,9188	-	22-Jul-26	0,9	12,68	11,86	28,55
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,32	115	2,89%+VAC	-	-	-	106,2031	-	-	-	1,0857	-	18-Ago-23	20	3,41	3,37	3,55
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	3,61	1 797	7,39% + VAC	-	-	-	129,8879	-	-	-	3,3056	-	17-Dic-24	1	6,67	6,45	8,52
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,43	607	3,14%+VAC	-	-	-	90,5022	-	-	-	4,0398	-	8-May-26	7	10,97	10,55	13,55
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	1,75	1 330	3,83% + VAC	-	-	-	99,3233	-	-	-	3,8588	-	11-Oct-24	52	14,11	13,58	20,05
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	1,49	2 789	3,26%+VAC	-	-	-	89,7542	-	-	-	3,8549	-	16-Jul-26	25	17,76	17,11	27,55

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).

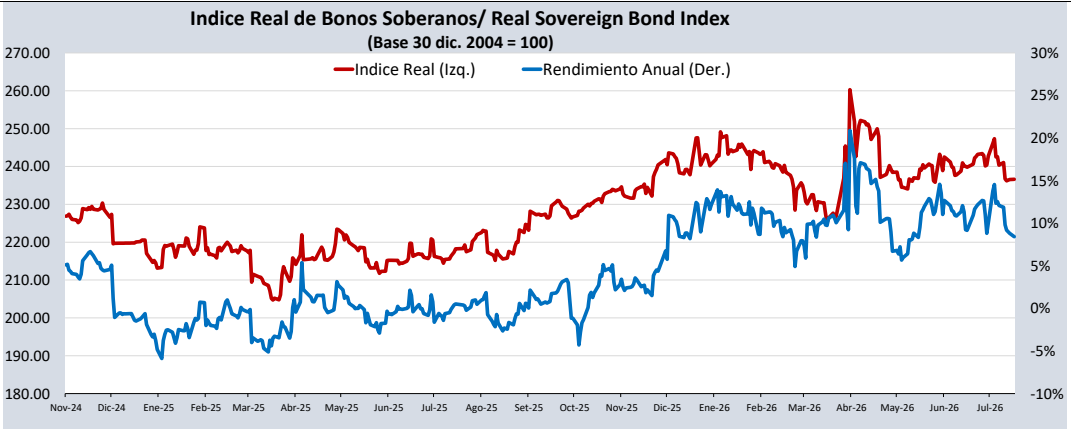
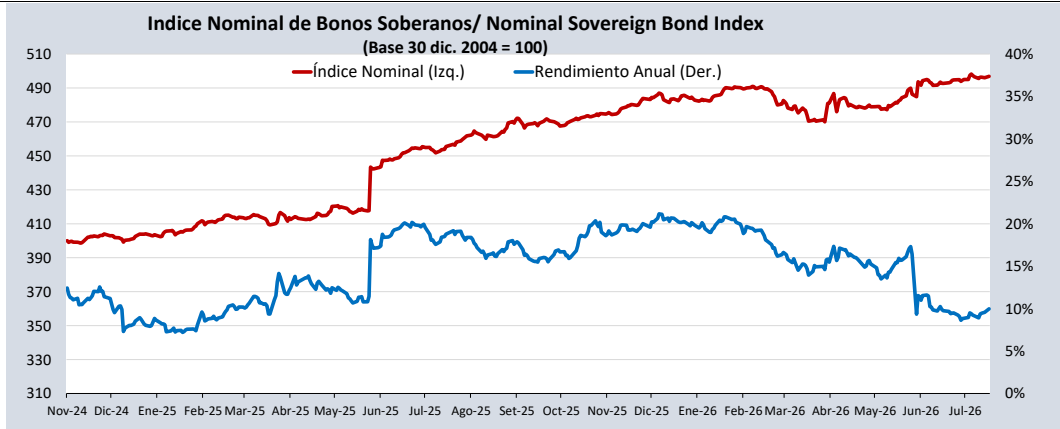
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	100,0620	-0,01	-0,02	-0,41	4,0630	1	2	39	1,05	1,03	1,08	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,6580	0,01	-0,03	-0,35	4,6420	0	2	10	3,70	3,61	3,90	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	100,4810	-0,04	-0,18	-0,53	3,6000	1	5	16	3,43	3,37	3,68	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	91,7600	-0,02	-0,13	-0,35	4,8490	1	4	9	4,24	4,14	4,49	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,1100	-0,18	-0,39	-0,42	5,2110	4	9	9	5,95	5,80	6,34	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	120,2570	-0,26	-0,59	-0,83	5,3630	3	8	12	5,66	5,51	7,32	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,6010	-0,23	-0,22	-0,75	3,9380	5	5	14	6,31	6,19	6,62	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,4350	-0,17	-0,72	-0,36	5,3960	3	13	6	6,66	6,49	7,47	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,5210	-0,09	-0,61	-0,45	5,4460	1	9	7	6,78	6,60	8,53	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	99,6080	-0,14	-0,65	-0,18	5,5520	2	9	2	7,49	7,29	9,68	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	81,0390	-0,37	-0,64	-0,93	4,2610	5	9	13	9,21	9,02	10,31	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	107,7150	-0,25	-1,13	-0,44	5,5040	3	14	5	7,77	7,57	10,63	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,9980	-0,16	-0,50	-0,67	5,7500	2	6	8	11,01	10,71	14,62	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	94,8920	-0,35	-1,23	-0,59	6,0270	3	10	5	13,10	12,71	24,31	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	68,0410	-0,56	-0,95	-0,53	6,0660	6	10	5	14,42	13,99	24,62	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	96,2900	-0,18	-0,83	-0,63	6,1540	1	6	5	13,43	13,03	28,03	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	100,3740	-0,11	-0,78	-0,22	6,1710	1	6	2	13,75	13,34	28,93	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,9140	-0,13	-0,57	-0,55	6,0510	2	6	6	17,26	16,76	34,34	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	61,9700	-0,07	-0,45	-0,59	6,0720	1	4	6	17,10	16,60	45,47	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,8700	-0,32	-0,86	-0,74	6,1270	4	10	8	16,49	16,00	95,00	

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	497	0,8	0,2	9,98	41	82	1,52	4,36	8,59	12,31	13,95	12,15	13,46	12,54	10,93	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	0,05	-3,75	8,42	-40	-367	2,09				30,79		9,45		17,76		39,91	



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.