

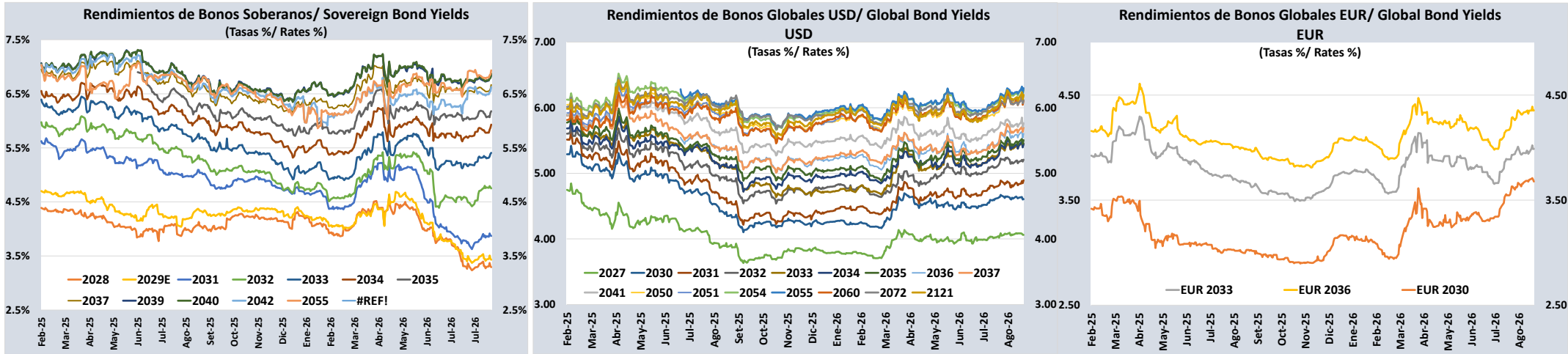


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

20/08/2026

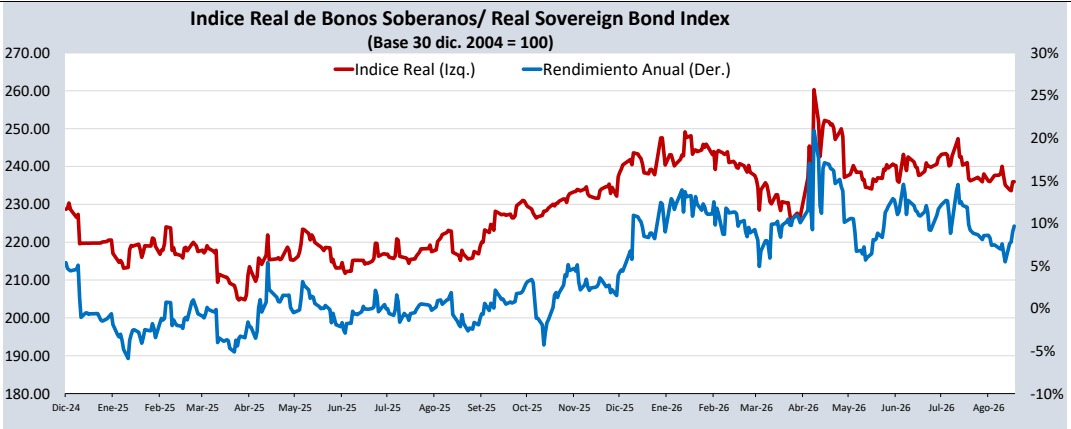
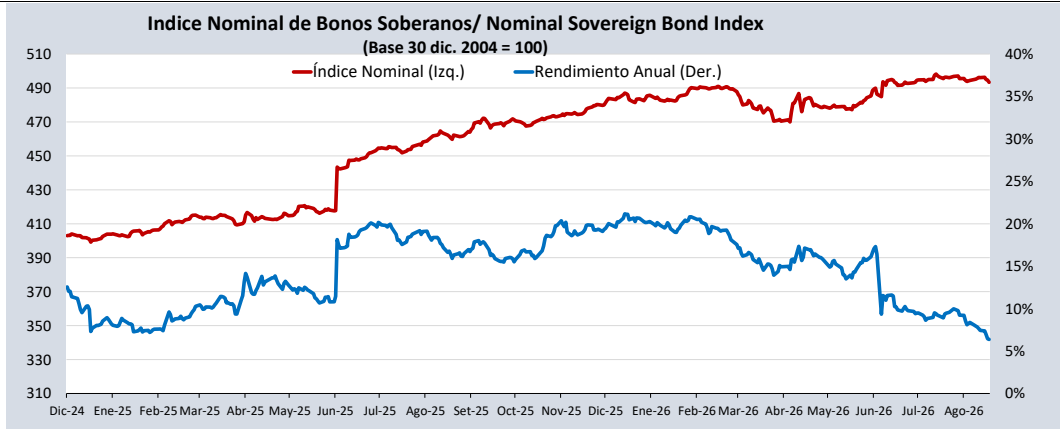
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)	Millones S./ / Millions PEN		Postura / Position	Postura / Position	Postura / Position	Prom. ponderado** / Weighted average (%)	Postura / Position	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
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,14	2 804	6,350	-	-	-	105,7615	-	-	-	3,2928	-	8-Jul-26	2	1,92	1,86	1,98
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,13	8 025	5,940	-	-	-	105,8456	-	-	-	3,4300	-	19-Ago-26	3	2,38	2,30	2,48
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,15	14 560	6,950	-	-	-	113,7290	-	-	-	3,8700	-	19-Ago-26	2	4,40	4,24	4,98
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,13	22 072	6,150	106,95	107,38	107,11	107,1276	4,78	4,70	4,75	4,7500	2	20-Ago-26	101	5,20	4,96	5,98
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,16	24 199	7,300	110,55	110,95	110,67	110,8209	5,45	5,38	5,43	5,4081	9	20-Ago-26	160	5,75	5,45	6,98
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,12	24 259	5,400	96,54	96,97	96,66	96,6577	5,95	5,88	5,93	5,9300	8	20-Ago-26	62	6,65	6,27	7,98
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,15	25 694	6,850	103,75	104,32	103,95	104,1584	6,30	6,22	6,27	6,2408	61	20-Ago-26	541	6,99	6,58	8,98
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,15	23 737	6,900	101,68	102,02	101,76	101,8653	6,69	6,65	6,68	6,6667	14	20-Ago-26	176	8,01	7,51	10,98
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,17	20 420	7,600	106,31	107,10	106,31	106,5014	6,87	6,78	6,87	6,8489	14	20-Ago-26	49	8,74	8,18	12,98
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,12	12 836	5,350	86,35	86,71	86,51	86,5674	6,90	6,86	6,88	6,8719	27	20-Ago-26	147	9,81	9,18	13,98
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,15	5 040	6,850	-	-	-	102,2481	-	-	-	6,6231	-	3-Ago-26	4,4	9,98	9,36	15,48
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,15	3 543	6,714	-	-	-	97,4499	-	-	-	6,9340	-	3-Ago-26	0,0	13,04	12,19	28,48
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,51	115	2,89%+VAC	-	-	-	104,2165	-	-	-	1,2061	-	18-Ago-23	20	3,39	3,35	3,48
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,40	1 801	7,39% + VAC	-	-	-	128,0350	-	-	-	3,5005	-	17-Dic-24	1	6,78	6,55	8,45
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,64	608	3,14%+VAC	-	-	-	87,9496	-	-	-	4,1456	-	8-May-26	7	11,08	10,64	13,48
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,08	1 333	3,83% + VAC	-	-	-	99,2493	-	-	-	3,8643	-	11-Oct-24	52	14,31	13,78	19,98
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,07	2 863	3,26%+VAC	-	-	93,87	93,8637	-	-	3,60	3,6000	3	20-Ago-26	11	18,26	17,63	27,48

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).



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	0,00	0,02	-0,39	4,0610	0	-2	40	0,98	0,96	1,01
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,8720	-0,01	0,07	-0,40	4,6060	0	-1	12	3,63	3,55	3,83
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	100,2190	0,06	-0,01	-0,58	3,6770	-2	0	18	3,36	3,30	3,61
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	91,6950	-0,16	-0,26	-0,32	4,8940	4	8	9	4,17	4,07	4,43
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,2740	-0,13	-0,22	-0,34	5,2080	3	6	7	5,89	5,74	6,28
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	119,5140	-0,28	-0,51	-0,80	5,4530	4	7	12	5,59	5,44	7,25
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,4910	0,01	-0,20	-0,75	3,9880	0	5	15	6,25	6,13	6,56
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,2530	-0,28	-0,38	-0,42	5,4480	5	7	8	6,60	6,42	7,40
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	99,1200	-0,38	-0,47	-0,50	5,5060	6	7	7	6,89	6,71	8,47
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	99,2160	-0,48	-0,47	-0,30	5,6060	6	6	4	7,42	7,22	9,61
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,4770	0,01	-0,19	-1,02	4,3540	0	3	14	9,14	8,95	10,24
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,7130	-0,53	-0,62	-0,73	5,6950	6	8	9	7,69	7,47	10,57
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,9520	-0,45	-0,43	-0,54	5,7630	5	5	7	10,95	10,64	14,56
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	93,1180	-0,74	-1,09	-0,69	6,1750	6	9	6	12,93	12,54	24,24
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,8930	-0,68	-0,70	-0,64	6,1900	7	8	7	14,25	13,82	24,56
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	94,7780	-0,90	-1,07	-0,67	6,2730	7	8	5	13,66	13,25	27,97
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	98,6940	-0,96	-1,12	-0,37	6,2980	7	9	3	13,57	13,15	28,86
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,4390	-0,56	-0,60	-0,38	6,1080	6	7	4	17,11	16,61	34,28
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	61,5240	-0,49	-0,76	-0,37	6,1160	5	7	4	16,95	16,45	45,40
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,2620	-0,58	-0,77	-0,72	6,1970	7	9	9	16,74	16,24	94,94

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	493	-1,3	-2,9	6,37	-8	-127	1,53	4,39	8,55	12,21	13,85	12,11	13,58	12,49	11,11	5,74	2,66	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	236	0,02	-1,41	9,66	65	319	2,00				28,87		8,97		17,01		43,15	



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.