

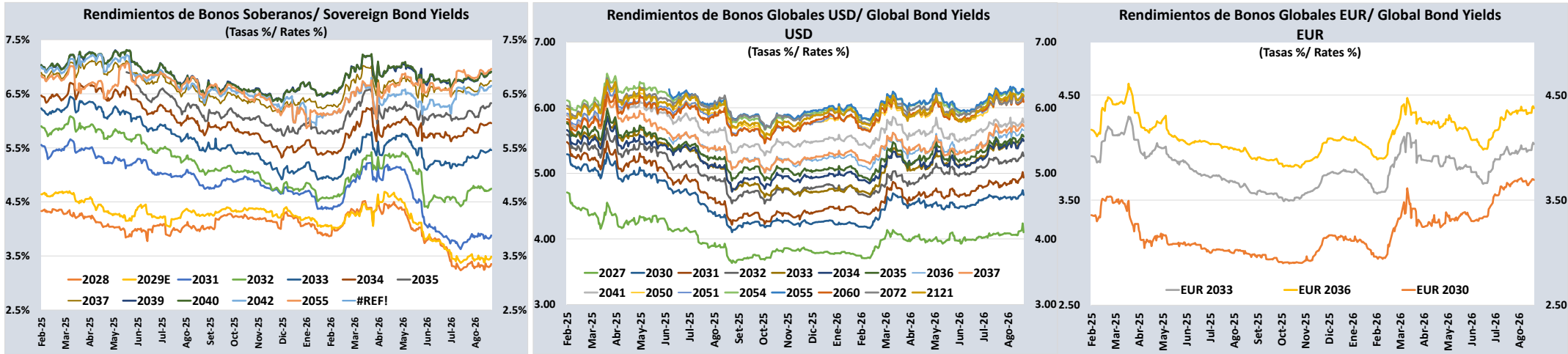


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

03/09/2026

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	Última neg. / Last trading day	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	0,38	2 804	6,350	-	-	-	105,5377	-	-	-	3,3528	-	8-Jul-26	2	1,88	1,82	1,94
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,36	8 025	5,940	-	-	-	105,6146	-	-	-	3,4900	-	28-Ago-26	2	2,34	2,26	2,44
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,42	14 560	6,950	113,18	113,73	113,46	113,5850	3,96	3,84	3,90	3,8800	2	3-Set-26	4	4,36	4,20	4,94
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,37	22 072	6,150	106,84	107,36	106,97	107,1128	4,80	4,70	4,77	4,7452	6	3-Set-26	50	5,16	4,93	5,94
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,44	24 199	7,300	110,28	110,50	110,44	110,4755	5,49	5,45	5,46	5,4572	17	3-Set-26	78	5,71	5,41	6,94
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,32	24 259	5,400	95,85	96,73	96,49	96,5121	6,07	5,92	5,96	5,9560	12	3-Set-26	53	6,61	6,23	7,94
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,41	26 119	6,850	103,44	103,79	103,53	103,6335	6,34	6,29	6,33	6,3156	34	3-Set-26	312	6,95	6,53	8,94
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,41	23 893	6,900	101,11	101,48	101,15	101,3153	6,77	6,72	6,76	6,7381	29	3-Set-26	125	7,96	7,46	10,94
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,45	20 870	7,600	105,74	106,39	105,87	105,9963	6,94	6,86	6,92	6,9055	13	3-Set-26	253	8,69	8,13	12,94
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,32	12 836	5,350	86,14	86,73	86,29	86,2862	6,93	6,86	6,91	6,9100	2	3-Set-26	5	9,76	9,13	13,94
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,41	5 040	6,850	-	-	-	101,9815	-	-	-	6,6505	-	2-Set-26	0,2	9,93	9,31	15,44
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,40	3 543	6,714	-	-	-	97,1243	-	-	-	6,9614	-	3-Ago-26	0,0	12,97	12,13	28,44
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,62	115	2,89%+VAC	-	-	-	103,9456	-	-	-	1,2657	-	18-Ago-23	20	3,35	3,31	3,44
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,68	1 803	7,39% + VAC	-	-	-	127,3523	-	-	-	3,5692	-	17-Dic-24	1	6,73	6,50	8,41
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,76	609	3,14%+VAC	-	-	-	87,3334	-	-	-	4,2128	-	8-May-26	7	11,03	10,58	13,44
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,23	1 335	3,83% + VAC	-	-	-	98,6009	-	-	-	3,9120	-	11-Oct-24	52	14,25	13,71	19,94
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,20	3 002	3,26%+VAC	-	-	92,72	92,7200	-	-	3,67	3,6700	2	3-Set-26	10	18,16	17,52	27,44

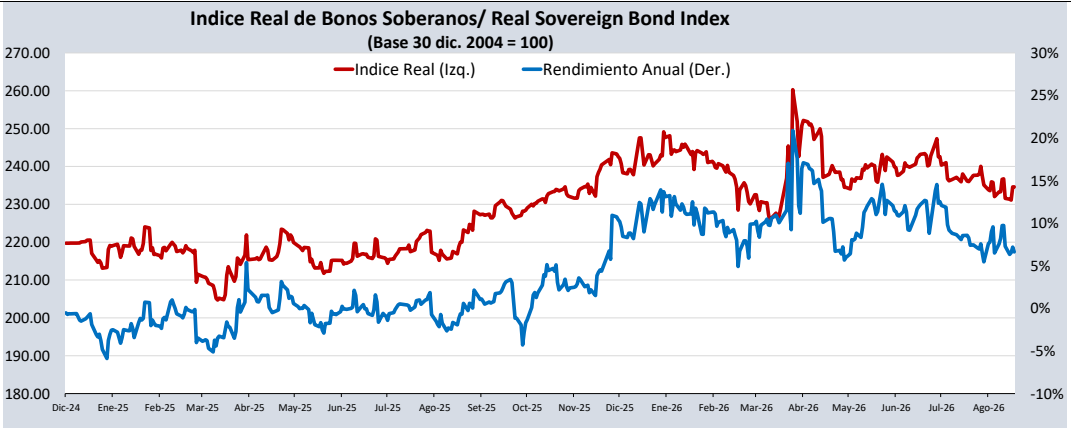
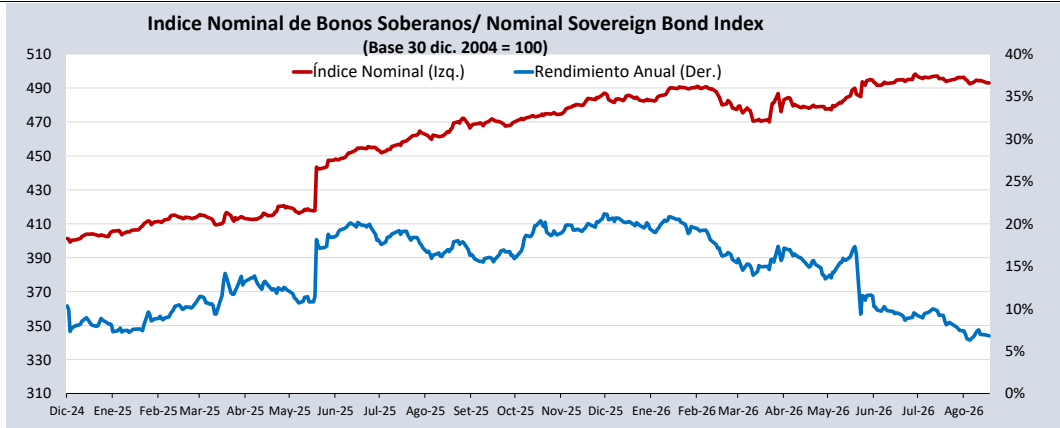
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the 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	100,0210	0,13	-0,04	-0,39	4,1020	-14	4	42	0,97	0,95	0,98	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,7110	0,25	-0,16	-0,32	4,6710	-7	6	10	3,60	3,52	3,80	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	100,1690	0,02	-0,16	-0,52	3,6920	-1	5	16	3,33	3,27	3,58	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	91,6020	0,31	-0,28	-0,28	4,9350	-8	8	7	4,14	4,04	4,39	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,1060	0,28	-0,30	-0,30	5,2620	-6	7	6	5,85	5,70	6,24	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	119,1390	0,10	-0,63	-0,71	5,4980	-2	9	11	5,55	5,40	7,22	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,3350	0,09	-0,26	-0,75	4,0340	-1	6	15	6,21	6,09	6,52	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,0660	0,19	-0,59	-0,43	5,4920	-3	11	8	6,56	6,38	7,37	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7640	0,16	-0,59	-0,50	5,5600	-3	9	8	6,85	6,67	8,43	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	98,8700	0,10	-0,53	-0,22	5,6540	-1	7	3	7,38	7,18	9,58	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,3780	0,14	-0,30	-1,02	4,3760	-2	5	14	9,10	8,91	10,21	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,5020	0,23	-0,58	-0,73	5,7190	-3	7	9	7,65	7,43	10,53	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,8850	0,49	-0,46	-0,42	5,7760	-6	6	5	10,91	10,60	14,52	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	93,1430	0,18	-0,64	-0,66	6,1740	-1	5	5	12,89	12,50	24,21	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,9360	0,21	-0,57	-0,68	6,1880	-2	6	7	14,22	13,79	24,52	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	95,1210	0,21	-0,60	-0,65	6,2460	-2	5	5	13,65	13,24	27,93	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	99,0310	0,23	-0,57	-0,26	6,2720	-2	4	2	13,56	13,14	28,83	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,6270	0,56	-0,36	-0,33	6,0880	-6	4	4	17,11	16,60	34,24	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	61,0270	0,09	-0,99	-0,70	6,1660	-1	10	7	16,81	16,31	45,37	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,3940	0,21	-0,61	-0,72	6,1820	-2	7	8	16,75	16,25	94,90	

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	0,0	-1,2	6,80	-5	-70	1,52	4,35	8,49	12,13	13,72	12,01	13,90	12,43	11,36	5,68	2,64	1,77
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	235	0,01	-2,12	6,64	-56	-310	2,01				28,98		8,99		17,04		42,98	



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.