

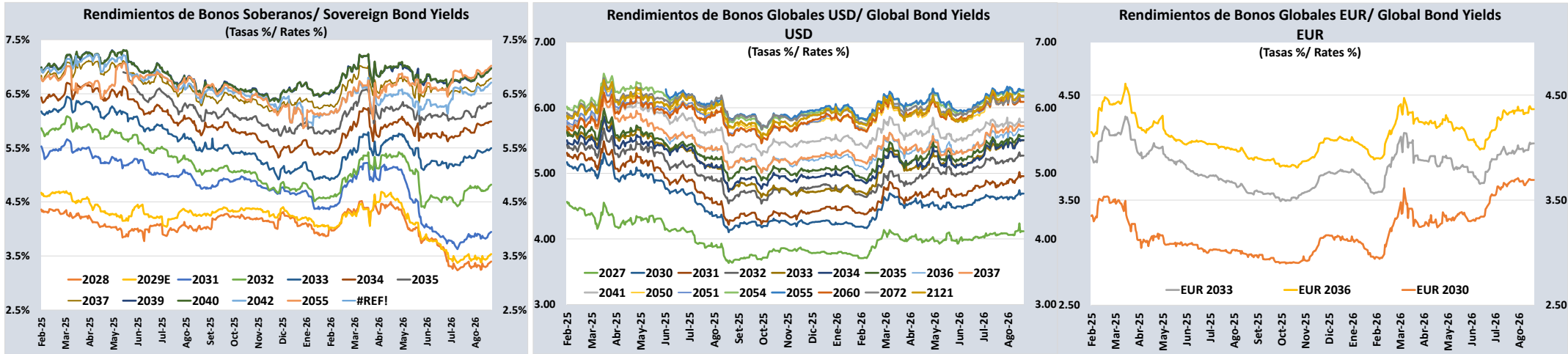


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

07/09/2026

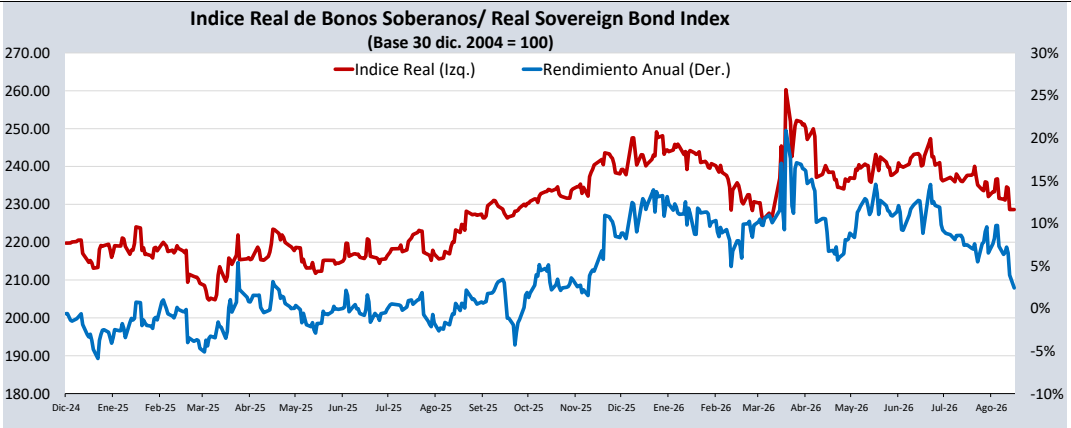
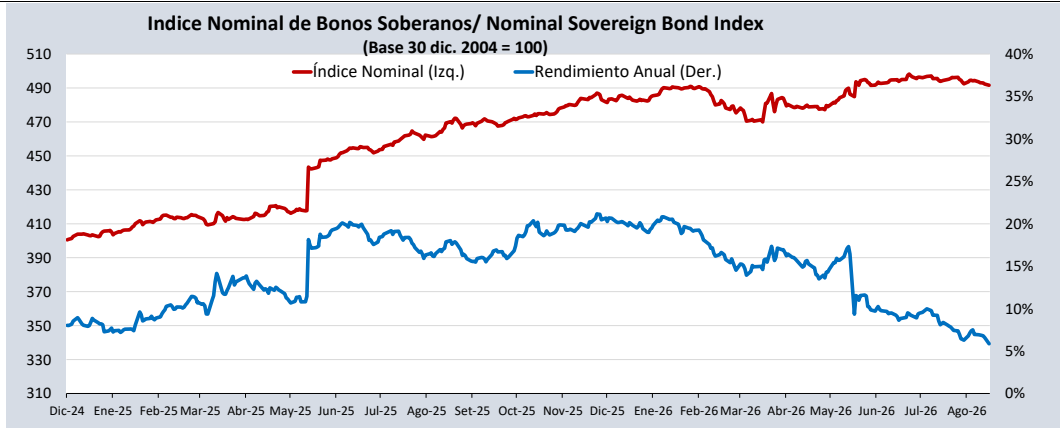
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	0,45	2 804	6,350	-	-	-	105,4224	-	-	-	3,3972	-	8-Jul-26	2	1,87	1,81	1,94
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,42	8 025	5,940	-	-	-	105,4845	-	-	-	3,5344	-	4-Set-26	3	2,33	2,25	2,44
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,49	14 560	6,950	-	-	-	113,2426	-	-	-	3,9461	-	3-Set-26	4	4,35	4,18	4,94
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,43	22 072	6,150	106,59	107,07	106,65	106,7069	4,84	4,75	4,83	4,8200	3	7-Set-26	6	5,15	4,91	5,94
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,52	24 199	7,300	110,08	110,46	110,31	110,2313	5,52	5,46	5,48	5,4957	16	7-Set-26	68	5,69	5,40	6,94
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,38	24 259	5,400	96,25	96,43	96,37	96,3212	6,00	5,97	5,98	5,9883	6	7-Set-26	87	6,59	6,22	7,94
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,48	26 344	6,850	103,09	103,39	103,39	103,2787	6,40	6,35	6,35	6,3674	11	7-Set-26	43	6,93	6,52	8,94
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,49	23 893	6,900	100,69	101,30	101,07	100,9449	6,82	6,74	6,77	6,7869	8	7-Set-26	16	7,95	7,44	10,94
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,54	21 020	7,600	105,09	105,74	105,31	105,3822	7,01	6,94	6,99	6,9764	11	7-Set-26	43	8,66	8,10	12,94
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,38	12 836	5,350	85,51	86,30	85,75	85,8403	7,01	6,91	6,98	6,9674	14	7-Set-26	29	9,74	9,10	13,94
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,48	5 040	6,850	-	-	-	101,4354	-	-	-	6,7079	-	2-Set-26	0,2	9,90	9,28	15,44
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,47	3 543	6,714	-	-	-	96,4491	-	-	-	7,0188	-	3-Ago-26	0,0	12,91	12,07	28,44
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,65	115	2,89%+VAC	-	-	-	103,7003	-	-	-	1,3313	-	18-Ago-23	20	3,34	3,30	3,44
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,76	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	126,8698	-	-	-	3,6237	-	17-Dic-24	1	6,72	6,48	8,41
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,80	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,6203	-	-	-	4,2895	-	8-May-26	7	11,00	10,55	13,44
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,27	1 335	3,83% + VAC	-	-	-	97,6605	-	-	-	3,9819	-	11-Oct-24	52	14,20	13,66	19,94
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,23	3 070	3,26%+VAC	-	-	-	87,8914	-	-	-	3,9778	-	4-Set-26	12	17,85	17,17	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).



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	100,0060	0,00	0,00	-0,38	4,1170	0	-1	41	0,96	0,94	0,97	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,6620	0,00	-0,02	-0,36	4,6910	0	1	11	3,59	3,50	3,79	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	100,1690	0,00	-0,02	-0,52	3,6920	0	1	16	3,32	3,26	3,56	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	91,5450	0,00	-0,05	-0,27	4,9560	0	2	7	4,12	4,02	4,38	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	82,0970	0,00	-0,04	-0,29	5,2700	0	2	6	5,84	5,69	6,23	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	119,0900	0,00	-0,17	-0,73	5,5020	0	2	11	5,54	5,39	7,21	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,3160	0,00	-0,28	-0,69	4,0400	0	6	14	6,20	6,08	6,51	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	85,0120	0,00	-0,12	-0,41	5,5060	0	3	8	6,55	6,37	7,36	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	98,7240	0,00	-0,16	-0,45	5,5660	0	2	7	6,84	6,66	8,42	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	98,7700	0,00	-0,20	-0,27	5,6680	0	3	4	7,37	7,17	9,56	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,4560	0,00	-0,22	-0,93	4,3660	0	3	13	9,09	8,90	10,19	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	106,4800	0,00	-0,05	-0,73	5,7210	0	0	9	7,64	7,42	10,52	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	75,8710	0,00	-0,01	-0,41	5,7790	0	0	5	10,90	10,59	14,51	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	93,1360	0,00	-0,14	-0,65	6,1740	0	1	5	12,88	12,49	24,20	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,9530	0,00	-0,11	-0,69	6,1870	0	1	7	14,21	13,78	24,51	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	95,1090	0,00	-0,14	-0,64	6,2470	0	1	5	13,64	13,23	27,92	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	99,0710	0,00	-0,23	-0,34	6,2690	0	2	3	13,55	13,14	28,81	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	52,6280	0,00	-0,04	-0,37	6,0890	0	1	4	17,10	16,59	34,23	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	61,0440	0,00	-0,58	-0,70	6,1640	0	6	7	16,81	16,30	45,36	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,3890	0,00	-0,13	-0,72	6,1820	0	1	8	16,74	16,23	94,89	

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	492	-0,8	-2,0	5,86	-73	-107	1,52	4,36	8,49	12,13	13,74	12,03	13,90	12,43	11,34	5,68	2,63	1,76
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	229	0,02	-2,72	2,41	-151	-394	2,06				29,64		9,15		17,33		41,82	



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.