



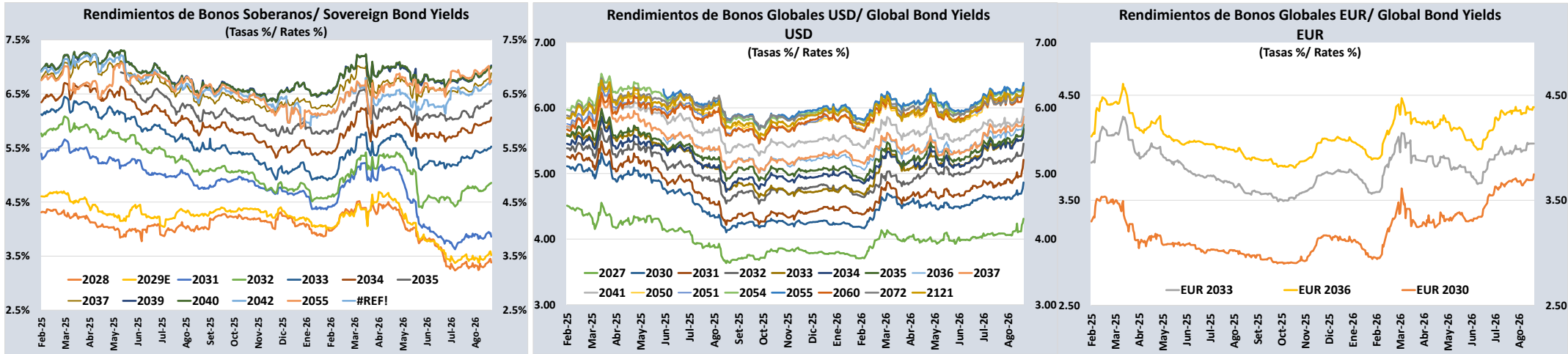
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

10/09/2026

Bonos soberanos / Sovereign bonds																			
Bonos* / Bonds				Saldo vigente		Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media /
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)			Millones S/. / Millions PEN	Cupón / Coupon (%)	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
				Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask										
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,50	2 804	6,350	-	-	-	105,4289	-	-	-	3,3821	-	8-Jul-26	2	1,86	1,80	1,93
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,47	8 025	5,940	-	-	-	105,5026	-	-	-	3,5193	-	8-Set-26	14	2,32	2,24	2,43
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,55	14 560	6,950	112,93	113,60	113,88	113,6326	4,00	3,86	3,92	3,8600	3	10-Set-26	4	4,34	4,18	4,93
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,48	22 072	6,150	106,21	106,42	106,37	106,5146	4,91	4,87	4,88	4,8551	14	10-Set-26	137	5,14	4,90	5,93
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,58	24 199	7,300	109,76	110,57	109,79	110,0345	5,57	5,44	5,57	5,5270	23	10-Set-26	222	5,68	5,39	6,93
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,43	24 259	5,400	95,72	96,05	95,84	95,8650	6,09	6,04	6,07	6,0649	32	10-Set-26	204	6,58	6,20	7,93
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,54	26 344	6,850	102,45	102,85	102,52	102,6570	6,49	6,43	6,48	6,4594	41	10-Set-26	215	6,92	6,50	8,93
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,54	23 893	6,900	100,02	100,69	100,17	100,1973	6,91	6,82	6,89	6,8864	15	10-Set-26	76	7,92	7,41	10,93
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,60	21 020	7,600	104,41	105,13	104,75	104,9516	7,09	7,01	7,05	7,0265	30	10-Set-26	234	8,64	8,08	12,93
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,42	12 836	5,350	85,21	85,44	85,52	85,5313	7,05	7,02	7,01	7,0075	3	10-Set-26	16	9,72	9,08	13,93
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,54	5 040	6,850	-	-	-	101,2884	-	-	-	6,7234	-	2-Set-26	0,2	9,89	9,27	15,43
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,53	3 543	6,714	-	-	-	99,6852	-	-	-	6,7494	-	8-Set-26	15,0	13,14	12,31	28,43
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,68	115	2,89%+VAC	-	-	-	103,8353	-	-	-	1,2888	-	18-Ago-23	20	3,33	3,29	3,43
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,82	1 804	7,39%+VAC	-	-	-	126,1735	-	-	-	3,7055	-	17-Dic-24	1	6,70	6,46	8,39
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,82	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,2161	-	-	-	4,3335	-	8-May-26	7	10,99	10,53	13,43
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,30	1 335	3,83%+VAC	-	-	-	98,7510	-	-	-	3,9010	-	11-Oct-24	52	14,23	13,70	19,93
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,26	3 070	3,26%+VAC	-	-	-	91,6368	-	-	-	3,7373	-	4-Set-26	12	18,07	17,42	27,43

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).

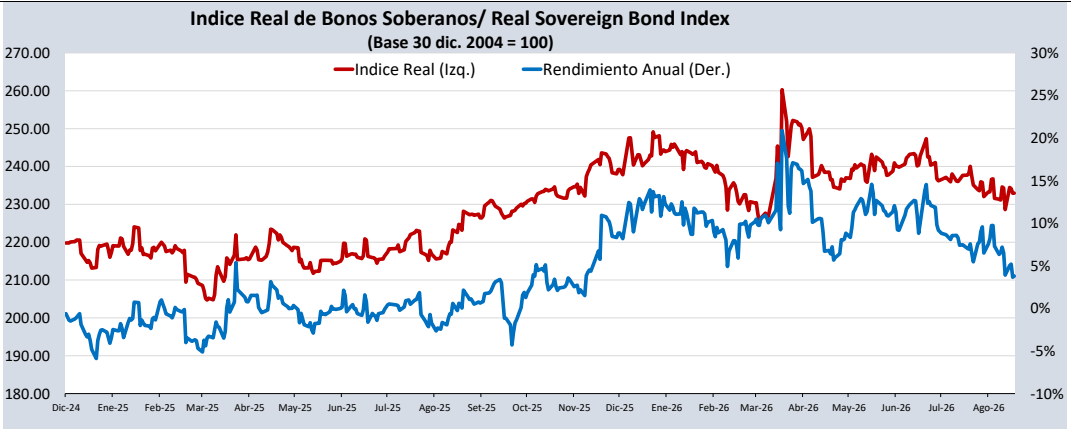
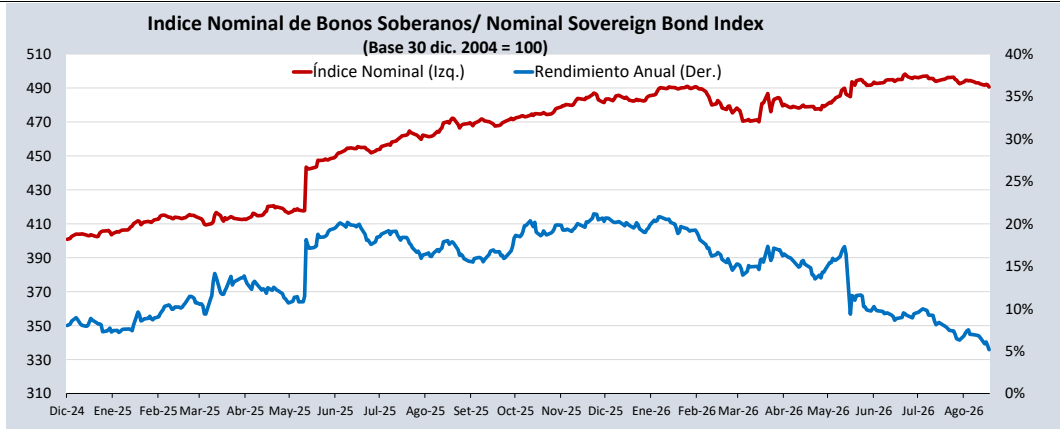
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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	99,8270	-0,06	-0,19	-0,48	4,3100	7	21	52	0,95	0,93	0,96	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	93,1070	-0,31	-0,60	-0,45	4,8640	9	19	14	3,58	3,49	3,78	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,9880	-0,15	-0,18	-0,53	3,7480	5	6	17	3,31	3,25	3,56	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,6300	-0,46	-0,97	-0,42	5,2090	13	27	11	4,11	4,01	4,37	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	81,2550	-0,50	-0,85	-0,36	5,4550	11	19	8	5,83	5,67	6,23	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	118,0370	-0,72	-1,10	-0,66	5,6610	11	16	10	5,52	5,37	7,20	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	84,3160	0,00	-0,02	-0,69	4,0400	0	1	14	6,19	6,07	6,50	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,0700	-0,72	-1,00	-0,44	5,6820	14	19	8	6,53	6,35	7,35	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,5500	-0,78	-1,21	-0,42	5,7460	12	19	6	6,82	6,63	8,41	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,6280	-0,82	-1,24	-0,20	5,8270	11	17	3	7,35	7,14	9,56	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	80,3220	0,00	-0,06	-0,96	4,3870	0	1	14	9,08	8,89	10,19	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,2890	-0,78	-1,21	-0,67	5,8680	10	15	8	7,61	7,39	10,51	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,1730	-0,87	-1,71	-0,62	5,9900	11	21	8	10,84	10,52	14,50	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,7430	-0,95	-1,40	-0,62	6,2930	8	12	5	12,78	12,39	24,19	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,6770	-0,83	-1,26	-0,65	6,3240	9	14	7	14,47	14,03	24,50	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	93,5090	-0,99	-1,61	-0,57	6,3750	8	13	5	13,52	13,10	27,91	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	97,6140	-1,00	-1,42	-0,41	6,3810	8	11	3	13,43	13,02	28,81	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,8990	-0,86	-1,73	-0,64	6,2890	10	20	8	16,79	16,28	34,23	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,6630	-0,82	-1,36	-0,68	6,3050	8	14	7	16,52	16,02	45,35	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,2490	-0,75	-1,15	-0,68	6,3180	9	14	8	16,37	15,87	94,88	

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	491	-1,3	-2,4	5,16	-50	-163	1,53	4,37	8,54	12,14	13,75	12,00	13,85	12,37	11,32	5,67	2,64	1,82
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	233	0,01	-1,36	3,80	14	-271	2,03				28,97		8,95		17,21		42,84	



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.