

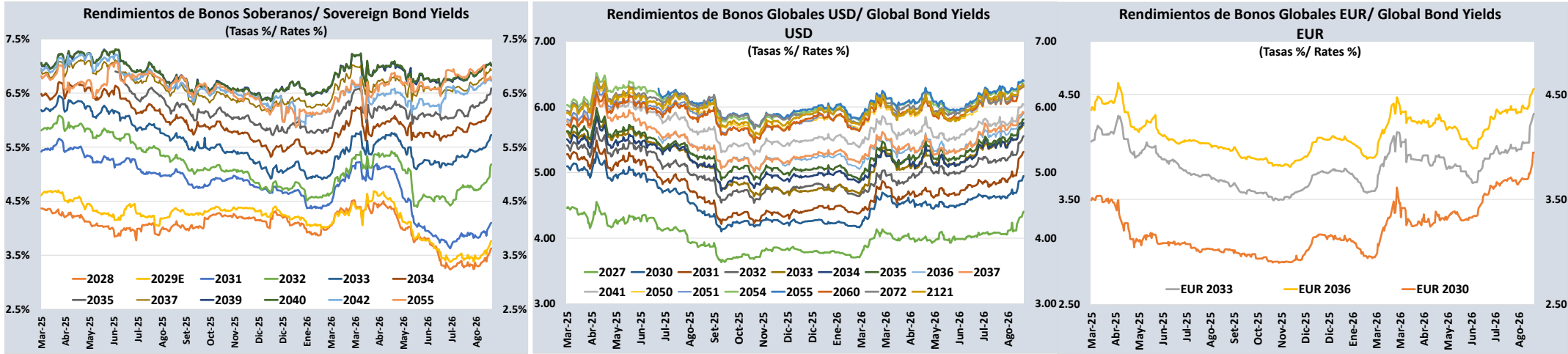


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

16/09/2026

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	0,60	2 804	6,350	-	-	-	104,9211	-	-	-	3,6278	-	8-Jul-26	2	1,84	1,78	1,91
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,56	8 025	5,940	104,20	104,78	104,83	104,8888	4,05	3,80	3,78	3,7650	2	16-Set-26	2	2,31	2,22	2,41
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,66	14 560	6,950	111,03	111,77	112,43	112,4569	4,40	4,24	4,10	4,1000	1	16-Set-26	2	4,32	4,15	4,91
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,58	22 072	6,150	103,94	104,45	104,45	104,8052	5,35	5,25	5,25	5,1824	21	16-Set-26	92	5,11	4,86	5,91
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,69	24 199	7,300	108,39	108,66	108,69	108,8323	5,80	5,76	5,76	5,7273	16	16-Set-26	71	5,66	5,35	6,91
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,51	24 259	5,400	94,78	95,08	95,08	94,9714	6,25	6,20	6,20	6,2167	6	16-Set-26	12	6,56	6,17	7,91
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,65	26 569	6,850	101,68	102,11	101,72	101,9757	6,61	6,54	6,60	6,5610	46	16-Set-26	241	6,89	6,47	8,91
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,66	24 043	6,900	99,65	100,17	100,17	99,9584	6,96	6,89	6,89	6,9184	12	16-Set-26	31	7,90	7,39	10,91
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,72	21 020	7,600	104,83	105,34	105,25	105,0802	7,04	6,98	6,99	7,0109	26	16-Set-26	99	8,63	8,06	12,91
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,51	12 836	5,350	85,26	85,76	85,45	85,5505	7,05	6,98	7,02	7,0063	8	16-Set-26	16	9,70	9,07	13,91
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,65	5 040	6,850	-	-	-	101,2985	-	-	-	6,7222	-	2-Set-26	0,2	9,87	9,25	15,41
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,64	3 543	6,714	-	-	-	99,6997	-	-	-	6,7482	-	8-Set-26	15,0	13,13	12,30	28,41
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,72	115	2,89%+VAC	-	-	-	102,9922	-	-	-	1,5268	-	18-Ago-23	20	3,31	3,26	3,41
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,94	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	125,1086	-	-	-	3,8308	-	17-Dic-24	1	6,68	6,43	8,38
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,87	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,3014	-	-	-	4,3254	-	8-May-26	7	10,97	10,52	13,41
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,36	1 335	3,83% + VAC	-	-	-	98,7666	-	-	-	3,8999	-	11-Oct-24	52	14,22	13,68	19,91
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,31	3 071	3,26%+VAC	-	-	-	91,6574	-	-	-	3,7362	-	4-Set-26	12	18,06	17,41	27,41

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.

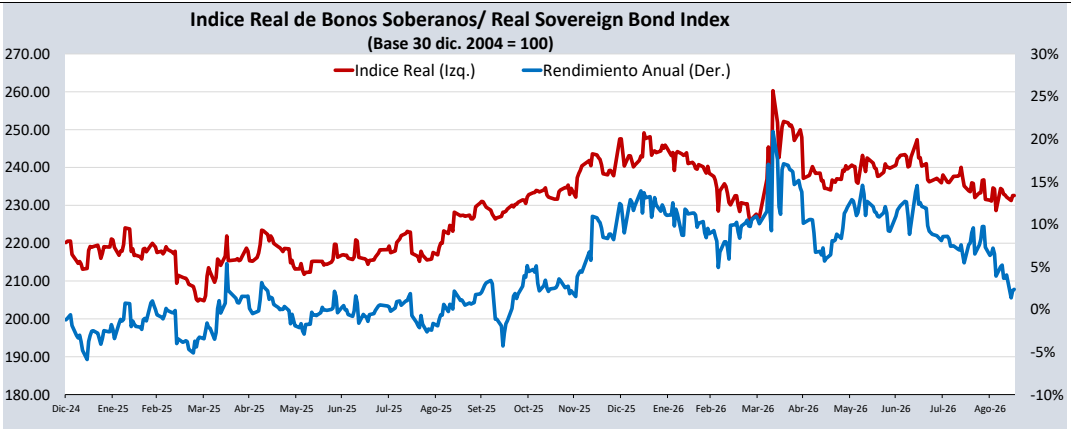
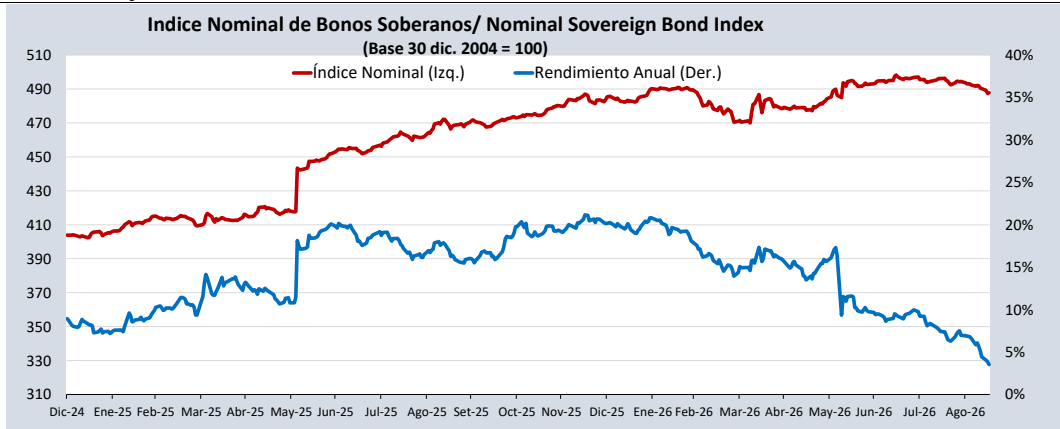
Bonos globales**** / Global bonds															
Bonos / Bonds	ISIN	Saldo vigente Millones USD / Outstanding mills. USD	Cupón % / Coupon %	Precio / Price	Cambio / Change		Diferencial Precios compra- venta / Price spread bid-ask	Rendimiento% / Yields %	Cambio / Change (bps.)		Diferencial Tasas compra- 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	99,7420	-0,03	-0,15	-0,45	4,4060	3	16	50	0,93	0,91	0,94	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,8550	-0,10	-0,56	-0,39	4,9490	3	18	12	3,56	3,47	3,76	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,3630	0,01	-0,77	-0,48	3,9450	0	24	15	3,29	3,23	3,54	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,2720	-0,06	-0,82	-0,42	5,3160	2	23	11	4,10	3,99	4,35	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,8250	-0,07	-0,93	-0,42	5,5570	2	21	9	5,81	5,65	6,21	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,5900	-0,02	-1,17	-0,63	5,7250	0	18	10	5,50	5,35	7,18	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,9880	-0,08	-1,33	-0,63	4,3160	2	28	13	6,22	6,09	6,49	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,7190	0,04	-1,08	-0,44	5,7540	-1	21	8	6,52	6,33	7,33	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,1320	0,00	-1,20	-0,47	5,8110	0	19	7	6,80	6,61	8,39	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,1490	-0,06	-1,30	-0,15	5,8950	1	18	2	7,32	7,11	9,54	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,1780	-0,06	-1,14	-0,89	4,5540	1	17	13	9,06	8,86	10,17	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	104,9010	0,08	-1,17	-0,62	5,9160	-1	15	8	7,82	7,60	10,49	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	73,8050	0,06	-1,24	-0,62	6,0390	-1	16	8	11,05	10,73	14,49	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,5090	0,19	-1,19	-0,66	6,3140	-2	10	6	12,75	12,36	24,17	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,5430	0,22	-0,96	-0,66	6,3400	-2	11	7	14,44	14,00	24,48	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	93,3370	0,23	-1,16	-0,60	6,3890	-2	9	5	13,49	13,07	27,89	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	97,3920	0,13	-1,23	-0,23	6,3980	-1	9	2	13,40	12,99	28,79	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,7580	0,16	-1,00	-0,63	6,3070	-2	12	8	16,74	16,23	34,21	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,4670	0,09	-1,01	-0,68	6,3260	-1	11	7	16,46	15,96	45,33	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,1880	0,15	-0,81	-0,71	6,3260	-2	10	9	16,33	15,83	94,87	

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	488	0,4	-4,1	3,53	-32	-212	1,53	4,37	8,51	12,02	13,70	11,97	13,85	12,42	11,41	5,71	2,66	1,84
---	-----	-----	------	------	-----	------	------	------	------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	------	------	------

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	-0,36	2,35	12	-131	2,02				28,80		8,98		17,26		42,95	
---	-----	------	-------	------	----	------	------	--	--	--	-------	--	------	--	-------	--	-------	--



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.