



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

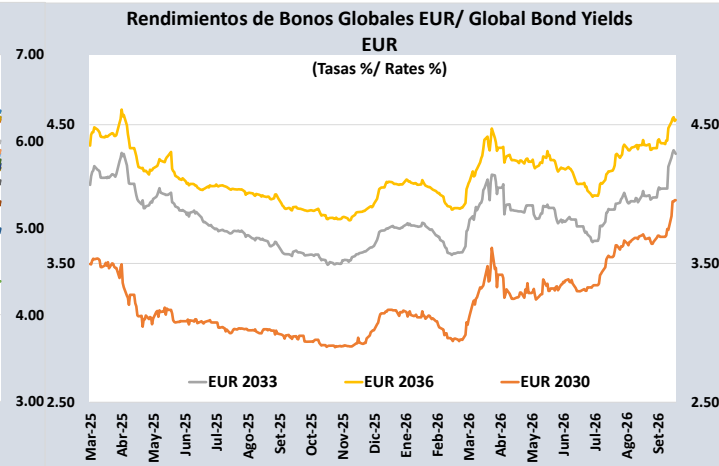
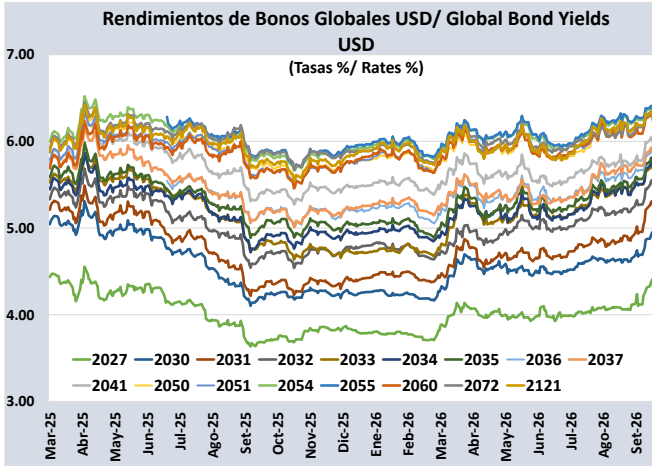
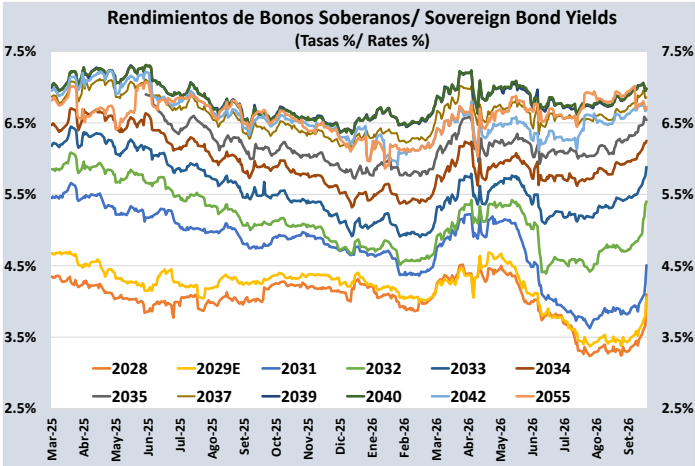
18/09/2026

Bonos soberanos / Sovereign bonds

Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				Nº 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 \$ / Millions PEN		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. \$) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,64	2 804	6,350	103,45	0,00	104,00	104,0290	4,40	0,00	4,10	4,1000	1	18-Sep-26	2	1,84	1,77	1,90
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,60	8 025	5,940	99,77	104,54	103,73	104,1993	6,05	3,90	4,25	4,0567	7	18-Sep-26	15	2,30	2,21	2,40
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,70	14 560	6,950	109,20	110,56	109,88	110,5557	4,80	4,50	4,65	4,5071	3	18-Sep-26	7	4,31	4,12	4,90
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,62	22 072	6,150	103,69	103,89	103,74	103,6954	5,40	5,36	5,39	5,4000	2	18-Sep-26	9	5,10	4,84	5,90
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,73	24 199	7,300	107,92	108,04	108,04	107,9224	5,88	5,86	5,86	5,8825	4	18-Sep-26	8	5,65	5,33	6,90
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,54	24 259	5,400	94,55	94,90	94,96	94,7782	6,29	6,23	6,22	6,2500	2	18-Sep-26	4	6,55	6,16	7,90
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,69	26 569	6,850	101,52	101,98	101,78	101,6140	6,63	6,56	6,59	6,6155	36	18-Sep-26	74	6,88	6,45	8,90
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,69	24 043	6,900	100,09	100,69	100,34	100,4004	6,90	6,82	6,87	6,8591	9	18-Sep-26	193	7,91	7,40	10,90
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,76	21 020	7,600	-	-	-	105,3427	-	-	-	6,9800	-	17-Sep-26	24	8,63	8,07	12,90
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,54	12 836	5,350	85,30	86,00	85,92	85,7609	7,04	6,95	6,96	6,9798	10	18-Sep-26	61	9,70	9,07	13,90
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,69	5 040	6,850	-	-	-	101,5484	-	-	-	6,6957	-	2-Sep-26	0,2	9,87	9,25	15,40
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,68	3 543	6,714	-	-	-	100,0274	-	-	-	6,7217	-	8-Sep-26	15,0	13,14	12,32	28,40
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,74	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,8666	-	-	-	1,8569	-	18-Ago-23	20	3,31	3,25	3,40
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	0,98	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	124,7534	-	-	-	3,8730	-	17-Dic-24	1	6,67	6,42	8,37
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,89	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,5649	-	-	-	4,2974	-	8-May-26	7	10,97	10,52	13,40
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,39	1 335	3,83% + VAC	-	-	-	99,1176	-	-	-	3,8741	-	11-Oct-24	52	14,22	13,69	19,90
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,33	3 071	3,26%+VAC	-	-	-	91,1194	-	-	0,00	3,7104	-	17-Sep-26	12	18,08	17,43	27,40

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).

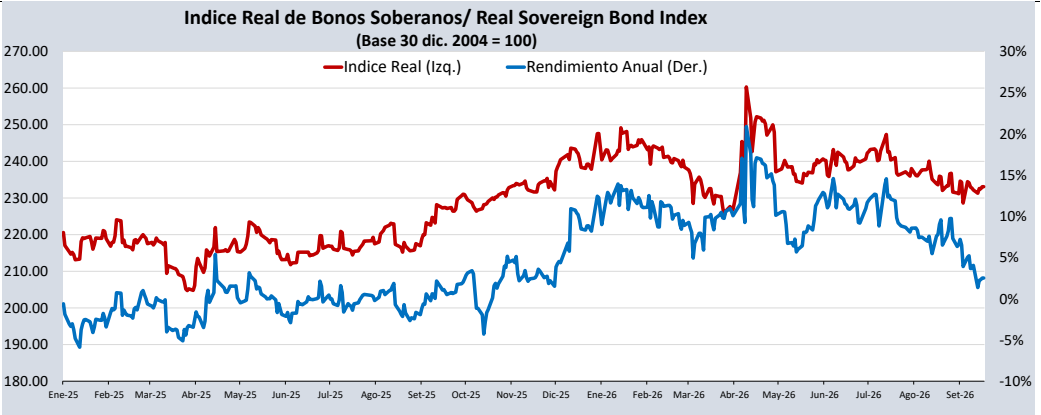
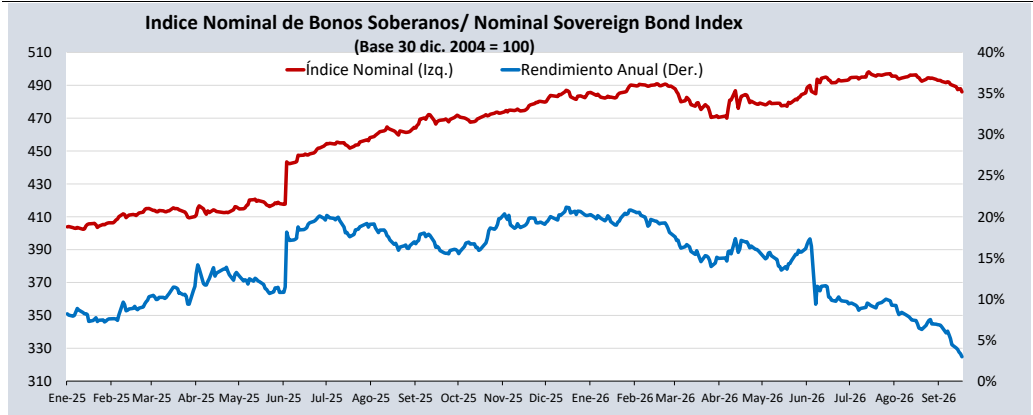


Fuente/Source: MEF, BCRP, BLOOMBERG, DATATEC.

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 / 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	99,7630	0,00	-0,06	-0,49	4,3850	1	7	54	0,93	0,91	0,94
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,7330	-0,16	-0,36	-0,44	4,9930	5	12	14	3,56	3,47	3,76
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,3310	0,00	-0,68	-0,47	3,9560	0	21	15	3,28	3,22	3,53
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,3320	-0,17	-0,26	-0,43	5,3060	5	8	12	4,09	3,99	4,35
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,8920	-0,21	-0,42	-0,45	5,5490	5	10	10	5,80	5,65	6,20
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,7530	-0,23	-0,31	-0,69	5,6960	3	4	11	5,50	5,35	7,18
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	83,1380	0,07	-0,42	-0,63	4,2900	-1	9	13	6,21	6,08	6,48
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,7970	-0,31	-0,30	-0,49	5,7430	6	6	9	6,51	6,33	7,33
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,2750	-0,31	-0,34	-0,49	5,7890	5	5	8	6,80	6,60	8,39
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,3980	-0,32	-0,22	-0,20	5,8600	4	3	3	7,32	7,11	9,53
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,3280	-0,05	-0,39	-0,92	4,5350	1	6	13	9,05	8,85	10,16
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,0420	-0,34	-0,26	-0,66	5,8980	4	3	8	7,82	7,59	10,49
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,0790	-0,27	-0,18	-0,68	6,0060	4	3	9	11,05	10,73	14,48
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	92,1250	-0,25	0,31	-0,66	6,2610	2	-3	6	12,79	12,40	24,17
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,0440	-0,30	0,24	-0,67	6,2860	3	-3	7	14,48	14,04	24,48
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	93,8500	-0,32	0,13	-0,61	6,3480	3	-1	5	13,52	13,10	27,89
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	97,9700	-0,35	0,29	-0,25	6,3540	3	-2	2	13,44	13,02	28,78
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,2230	-0,28	0,13	-0,67	6,2520	3	-2	8	16,82	16,31	34,20
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,9300	-0,33	0,03	-0,72	6,2780	3	0	7	16,55	16,05	45,33
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,5820	-0,35	0,16	-0,72	6,2780	4	-2	9	16,45	15,95	94,86

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	486	-1,9	-4,2	2,96	-37	-147	1,52	4,36	8,40	11,94	13,64	11,99	13,86	12,53	11,49	5,75	2,67	1,85

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	0,89	2,50	-1	-154	1,99				28,67		8,99		17,29		43,06	



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.