



PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

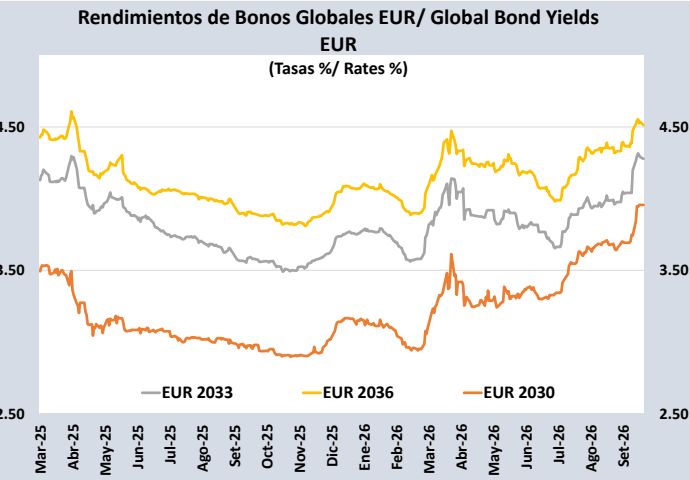
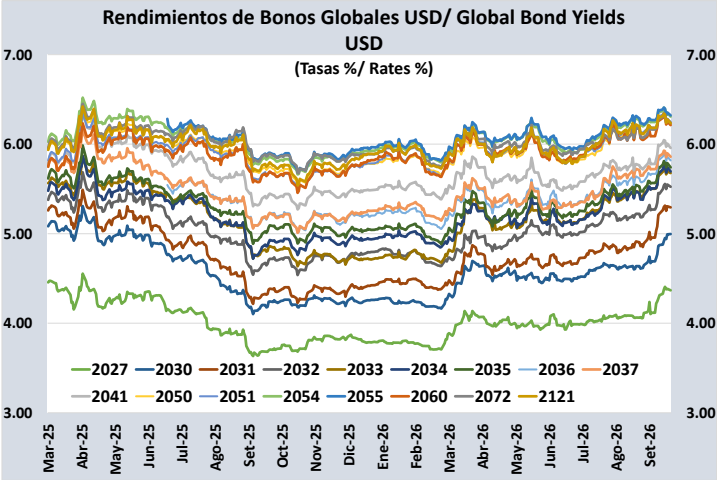
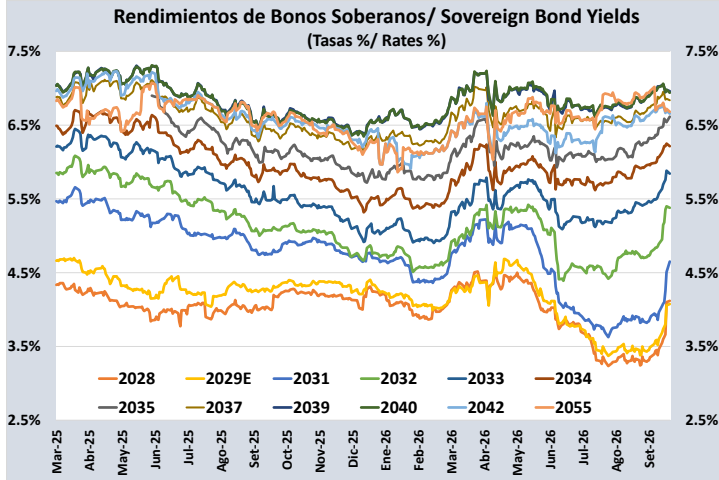
21/09/2026

Bonos soberanos / Sovereign bonds

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 /	
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / Accrued Interest (%)	Millones S/. / 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. S/) / Amount (Millions PEN)	Años / Years	Años / Years	Años / Years
						Compra / Bid	Venta / Ask			Compra / Bid	Venta / Ask								
12-Ago-28	PEP01000C5D1	SB12AGO28	0,69	2 804	6,350	-	-	-	103,9786	-	-	-	4,1183	-	18-Set-26	2	1,83	1,76	1,90
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,65	8 025	5,940	102,59	104,42	103,96	104,1434	4,75	3,95	4,15	4,0750	2	21-Set-26	2	2,29	2,20	2,40
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,76	14 560	6,950	109,11	109,92	109,87	109,8879	4,82	4,64	4,65	4,6500	2	21-Set-26	4	4,30	4,11	4,90
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,67	22 072	6,150	-	-	-	103,7919	-	-	-	5,3800	-	18-Set-26	9	5,09	4,83	5,90
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,79	24 199	7,300	107,81	108,15	108,10	108,1419	5,90	5,84	5,85	5,8433	3	21-Set-26	6	5,64	5,33	6,90
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,59	24 259	5,400	94,96	95,08	95,02	94,9905	6,22	6,20	6,22	6,2146	14	21-Set-26	25	6,54	6,16	7,90
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,74	26 569	6,850	101,32	102,11	101,98	102,0091	6,66	6,54	6,56	6,5556	15	21-Set-26	77	6,88	6,46	8,90
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,75	24 043	6,900	100,47	100,77	100,62	100,5610	6,85	6,81	6,83	6,8376	3	21-Set-26	16	7,90	7,39	10,90
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,83	21 160	7,600	104,32	180,96	105,51	105,5118	7,10	0,91	6,96	6,9600	3	21-Set-26	6	8,63	8,06	12,90
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,58	12 836	5,350	84,45	86,16	86,08	86,0780	7,15	6,93	6,94	6,9400	5	21-Set-26	15	9,70	9,07	13,90
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,74	5 040	6,850	-	-	-	101,9253	-	-	-	6,6559	-	2-Set-26	0,2	9,88	9,26	15,40
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,73	3 543	6,714	-	-	-	100,5228	-	-	-	6,6819	-	8-Set-26	15,0	13,17	12,34	28,40
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,76	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,6357	-	-	-	1,9234	-	18-Ago-23	20	3,30	3,24	3,40
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,04	1 804	7,39%+VAC	-	-	-	125,1032	-	-	-	3,8272	-	17-Dic-24	1	6,67	6,42	8,37
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,92	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,8420	-	-	-	4,2682	-	8-May-26	7	10,97	10,52	13,40
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,42	1 336	3,83%+VAC	-	-	-	99,6483	-	-	-	3,8353	-	11-Oct-24	52	14,23	13,71	19,90
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,36	3 139	3,26%+VAC	-	-	-	92,7001	-	-	-	3,6717	-	17-Set-26	12	18,11	17,46	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).

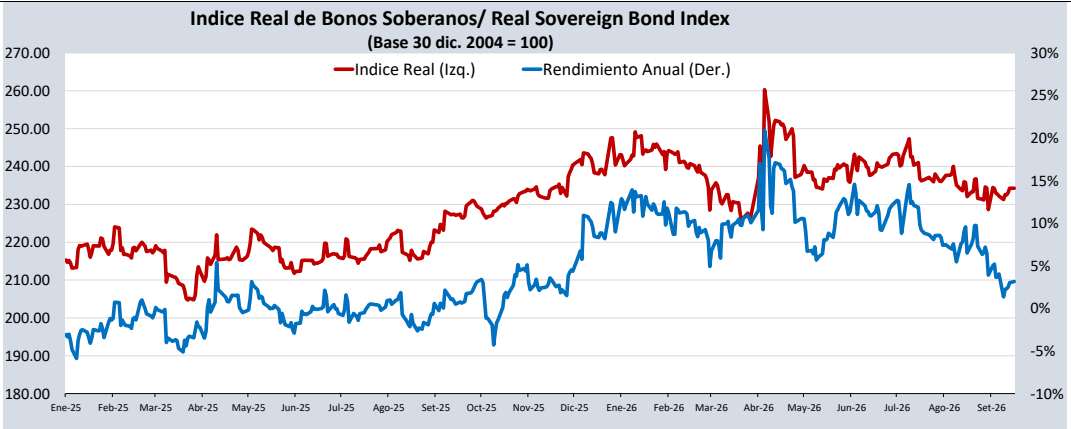
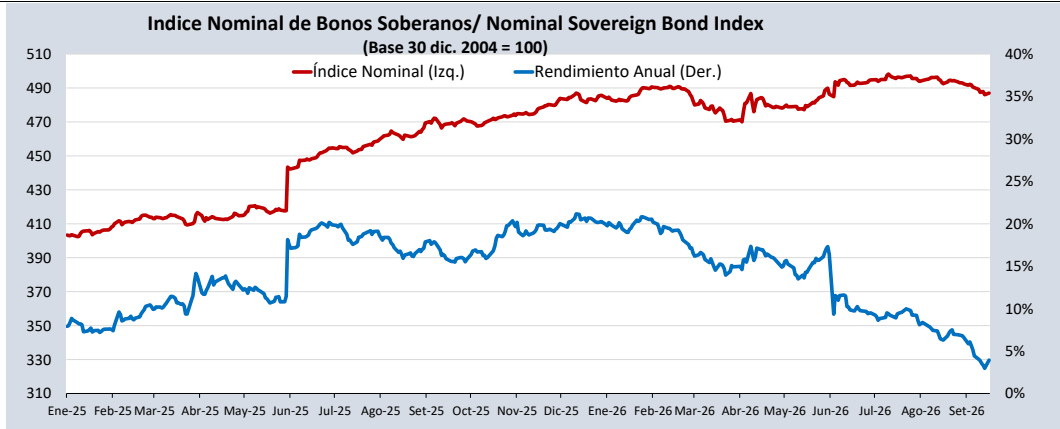
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the Manual for the Valuation of Public Treasury Securities, where: Negotiated (black), Listed (orange), Valued (green) or Auction (blue).



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 (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	99,7800	0,02	-0,03	-0,48	4,3670	-2	4	53	0,92	0,90	0,93
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,7280	-0,01	-0,35	-0,41	4,9960	0	12	13	3,55	3,46	3,75
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,3310	0,00	-0,36	-0,53	3,9560	0	12	17	3,28	3,21	3,53
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,3810	0,05	-0,07	-0,41	5,2940	-1	3	11	4,08	3,98	4,34
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	81,0130	0,12	-0,07	-0,42	5,5240	-3	3	9	5,79	5,64	6,19
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,8690	0,11	0,06	-0,71	5,6770	-2	-2	11	5,49	5,34	7,17
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	83,2070	0,07	-0,03	-0,63	4,2780	-1	1	13	6,21	6,08	6,47
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,0540	0,26	0,16	-0,48	5,6950	-5	-2	9	6,50	6,32	7,32
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,5940	0,32	0,20	-0,48	5,7400	-5	-3	8	6,79	6,60	8,38
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,6980	0,29	0,31	-0,27	5,8180	-4	-4	4	7,32	7,11	9,53
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4850	0,16	0,08	-0,92	4,5130	-2	-1	13	9,05	8,85	10,16
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,3440	0,30	0,25	-0,69	5,8600	-4	-3	9	7,81	7,59	10,48
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,4620	0,38	0,48	-0,65	5,9580	-5	-6	8	11,05	10,73	14,47
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	92,4730	0,34	0,89	-0,66	6,2310	-3	-8	6	12,80	12,41	24,16
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,3970	0,35	0,81	-0,66	6,2480	-4	-9	7	14,50	14,06	24,47
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	94,3410	0,49	0,81	-0,58	6,3080	-4	-7	5	13,55	13,13	27,88
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	98,3950	0,41	0,86	-0,31	6,3210	-3	-7	2	13,46	13,05	28,78
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,5640	0,34	0,70	-0,66	6,2130	-4	-8	8	16,87	16,36	34,19
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	60,3180	0,39	0,67	-0,70	6,2380	-4	-7	7	16,62	16,12	45,32
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,9540	0,37	0,69	-0,73	6,2340	-4	-8	9	16,56	16,06	94,85

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	487	1,0	-2,2	3,94	98	-10	1,52	4,35	8,34	11,94	13,65	12,00	13,89	12,53	11,49	5,76	2,68	1,86
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	234	0,02	2,98	3,15	14	180	1,98				28,61		8,97		17,29		43,14	



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.