

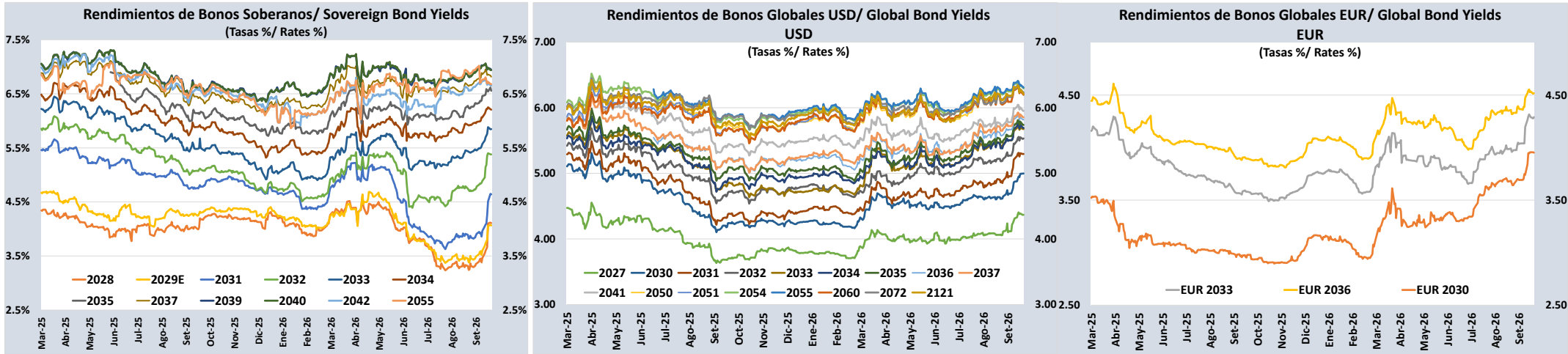


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

22/09/2026

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	0,71	2 804	6,350	-	-	-	103,9915	-	-	-	4,1083	-	18-Sep-26	2	1,83	1,76	1,89
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,66	8 025	5,940	-	-	-	104,1619	-	-	-	4,0650	-	21-Sep-26	2	2,29	2,20	2,39
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,77	14 560	6,950	109,01	110,55	109,96	109,9284	4,84	4,50	4,63	4,6400	2	22-Sep-26	4	4,30	4,11	4,89
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,69	22 072	6,150	103,84	104,34	103,99	103,7970	5,37	5,27	5,34	5,3787	27	22-Sep-26	102	5,09	4,83	5,89
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,81	24 199	7,300	108,15	108,38	108,27	108,1241	5,84	5,80	5,82	5,8459	33	22-Sep-26	178	5,64	5,33	6,89
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,60	24 259	5,400	94,20	95,26	95,14	95,0448	6,35	6,17	6,19	6,2056	29	22-Sep-26	80	6,54	6,16	7,89
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,76	26 569	6,850	101,71	102,51	102,24	102,2005	6,60	6,48	6,52	6,5267	20	22-Sep-26	65	6,88	6,46	8,89
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,77	24 043	6,900	100,17	101,07	100,77	100,7355	6,89	6,77	6,81	6,8143	12	22-Sep-26	96	7,90	7,40	10,89
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,85	21 160	7,600	104,74	106,02	105,77	105,6569	7,05	6,90	6,93	6,9430	7	22-Sep-26	34	8,63	8,07	12,89
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,60	12 836	5,350	85,93	86,48	86,16	86,1103	6,96	6,89	6,93	6,9361	8	22-Sep-26	28	9,70	9,07	13,89
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,76	5 040	6,850	-	-	-	101,9621	-	-	-	6,6520	-	2-Sep-26	0,2	9,88	9,26	15,39
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,75	3 543	6,714	-	-	-	100,5715	-	-	-	6,6780	-	8-Sep-26	15,0	13,17	12,35	28,39
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,77	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,6656	-	-	-	1,9137	-	18-Ago-23	20	3,30	3,23	3,39
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,06	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	125,2421	-	-	-	3,8092	-	17-Dic-24	1	6,66	6,42	8,36
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,93	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,9389	-	-	-	4,2580	-	8-May-26	7	10,97	10,52	13,39
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,43	1 336	3,83% + VAC	-	-	-	99,7005	-	-	-	3,8315	-	11-Oct-24	52	14,23	13,71	19,89
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,36	3 139	3,26%+VAC	-	-	-	92,7624	-	-	-	3,6679	-	17-Sep-26	12	18,11	17,47	27,39

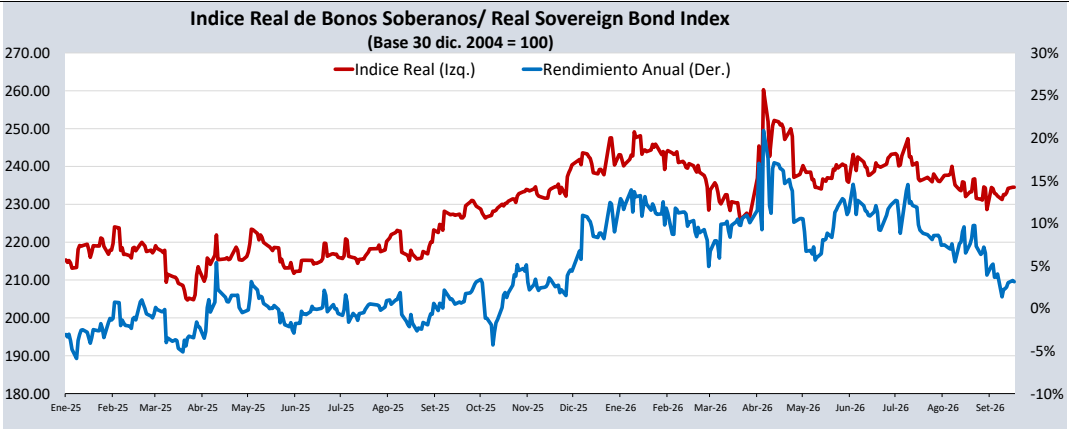
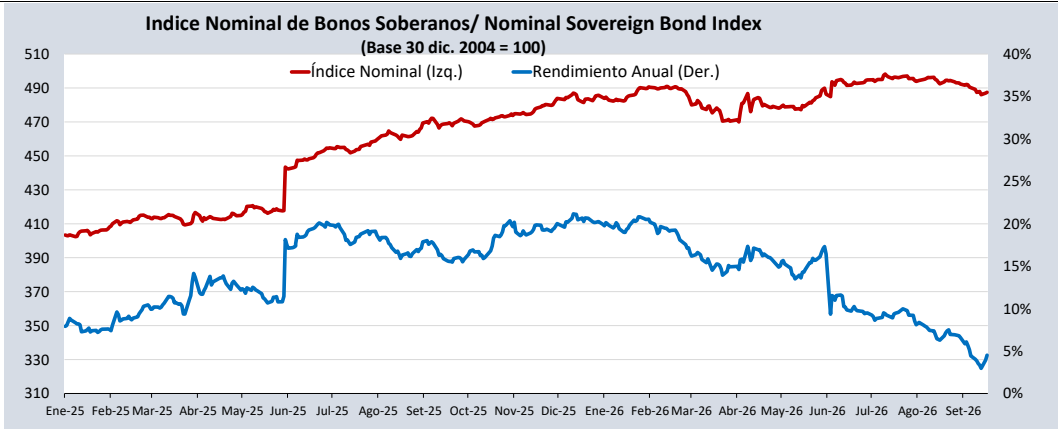
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the 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	0,00	0,01	-0,48	4,3680	0	-1	54	0,91	0,90	0,93	
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,7300	0,00	-0,22	-0,42	4,9970	0	8	13	3,54	3,46	3,74	
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,3440	0,01	-0,01	-0,54	3,9520	0	0	17	3,27	3,21	3,52	
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	90,3830	0,00	0,05	-0,42	5,2950	0	0	12	4,08	3,98	4,34	
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,9860	-0,03	0,09	-0,42	5,5310	1	-1	9	5,79	5,64	6,19	
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,8750	0,01	0,27	-0,72	5,6750	0	-5	11	5,49	5,34	7,16	
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	83,1500	-0,06	0,08	-0,63	4,2900	1	-1	13	6,20	6,07	6,47	
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	84,0900	0,04	0,41	-0,47	5,6900	0	-7	9	6,50	6,32	7,31	
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	97,6080	0,01	0,48	-0,54	5,7380	0	-7	8	6,79	6,60	8,38	
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	97,6960	0,00	0,49	-0,22	5,8180	0	-7	3	7,31	7,11	9,52	
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,4540	-0,03	0,21	-0,92	4,5180	0	-3	13	9,04	8,84	10,15	
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	105,4050	0,06	0,59	-0,70	5,8520	-1	-7	9	7,81	7,59	10,48	
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	74,5340	0,07	0,79	-0,63	5,9500	-1	-10	8	11,05	10,73	14,47	
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	92,5970	0,12	1,28	-0,67	6,2210	-1	-11	6	12,80	12,42	24,16	
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	66,5120	0,11	1,19	-0,63	6,2360	-1	-13	7	14,50	14,07	24,47	
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	94,5150	0,17	1,41	-0,61	6,2940	-1	-11	5	13,56	13,14	27,88	
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	98,5770	0,18	1,32	-0,28	6,3070	-1	-10	2	13,47	13,06	28,77	
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	51,7040	0,14	1,11	-0,68	6,1960	-2	-13	8	16,89	16,39	34,19	
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	60,4370	0,12	1,06	-0,71	6,2260	-1	-11	7	16,64	16,14	45,31	
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	52,1590	0,20	1,12	-0,71	6,2090	-3	-14	8	16,62	16,12	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
Índice de bonos soberanos nominal / Nominal sovereign bond index	487	0,5	0,1	4,51	57	66	1,52	4,35	8,34	11,93	13,63	12,00	13,91	12,54	11,50	5,76	2,68
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	235	0,01	1,95	3,13	-14	90	1,98				28,63		8,97		17,29		43,13



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.