

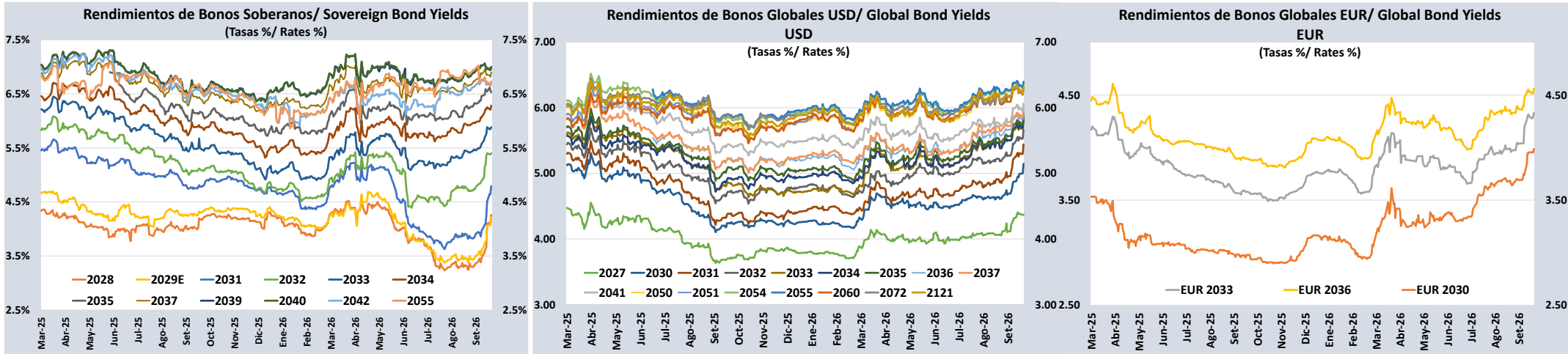


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

23/09/2026

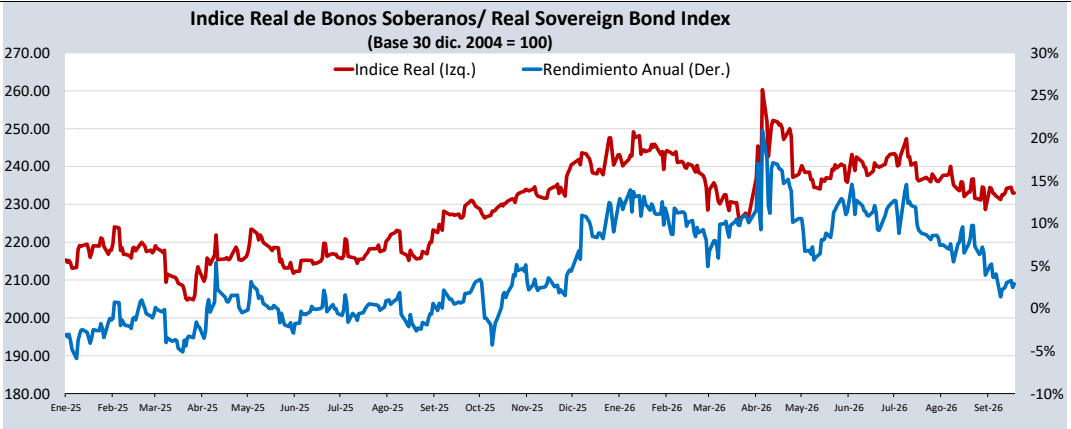
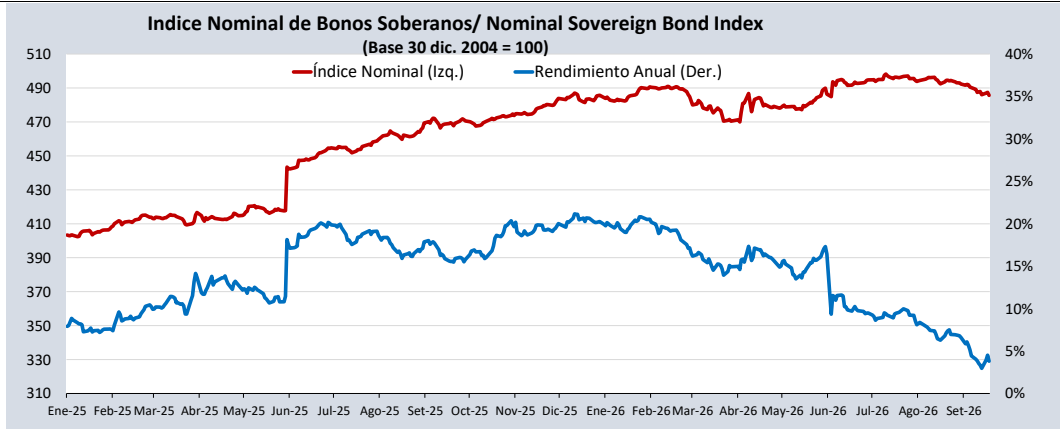
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración / Duración	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	0,72	2 804	6,350	-	-	-	103,7052	-	-	-	4,2616	-	18-Sep-26	2	1,82	1,75	1,89
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,68	8 025	5,940	-	-	-	103,8052	-	-	-	4,2183	-	21-Sep-26	2	2,29	2,19	2,39
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,79	14 560	6,950	109,18	109,72	109,18	109,2299	4,80	4,68	4,80	4,7933	3	23-Sep-26	69	4,29	4,09	4,89
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,70	22 072	6,150	103,68	103,78	103,78	103,6951	5,40	5,38	5,38	5,3986	14	23-Sep-26	59	5,09	4,83	5,89
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,83	24 199	7,300	107,22	108,32	107,80	107,9170	6,00	5,81	5,90	5,8812	14	23-Sep-26	37	5,63	5,32	6,89
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,62	24 259	5,400	93,92	94,62	94,50	94,6029	6,40	6,28	6,30	6,2811	24	23-Sep-26	58	6,53	6,15	7,89
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,78	26 569	6,850	101,25	102,14	101,58	101,9286	6,67	6,54	6,62	6,5676	27	23-Sep-26	263	6,87	6,45	8,89
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,79	24 043	6,900	99,35	100,39	99,87	100,1150	7,00	6,86	6,93	6,8973	9	23-Sep-26	18	7,89	7,38	10,89
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,87	21 160	7,600	104,32	105,08	104,74	105,1843	7,10	7,01	7,05	6,9981	19	23-Sep-26	208	8,61	8,05	12,89
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,61	12 836	5,350	85,31	85,85	85,70	85,6980	7,04	6,97	6,99	6,9889	10	23-Sep-26	47	9,69	9,05	13,89
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,78	5 040	6,850	-	-	-	101,4614	-	-	-	6,7048	-	2-Sep-26	0,2	9,86	9,24	15,39
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,77	3 543	6,714	-	-	-	99,9145	-	-	-	6,7308	-	8-Sep-26	15,0	13,12	12,29	28,39
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,78	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,1639	-	-	-	2,0635	-	18-Ago-23	20	3,29	3,23	3,39
31-Ene-35	PEP01000C8V85	SB31ENE35	1,08	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	124,7670	-	-	-	3,8671	-	17-Dic-24	1	6,66	6,41	8,36
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,94	609	3,14%+VAC	-	-	-	86,4505	-	-	-	4,3106	-	8-May-26	7	10,96	10,50	13,39
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,44	1 336	3,83% + VAC	-	-	-	98,9984	-	-	-	3,8829	-	11-Oct-24	52	14,21	13,68	19,89
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,37	3 139	3,26%+VAC	-	-	-	91,9335	-	-	-	3,7192	-	17-Sep-26	12	18,06	17,41	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).



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	99,7820	0,00	0,04	-0,48	4,3660	0	-4	54	0,91	0,89	0,92
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,2550	-0,48	-0,59	-0,46	5,1460	15	20	14	3,54	3,45	3,74
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	99,2370	-0,11	-0,13	-0,53	3,9870	4	4	17	3,27	3,21	3,52
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	89,8610	-0,52	-0,42	-0,42	5,4410	15	13	12	4,08	3,97	4,33
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,3950	-0,59	-0,44	-0,43	5,6620	13	11	9	5,79	5,63	6,19
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	117,1170	-0,76	-0,47	-0,68	5,7930	12	7	11	5,48	5,32	7,16
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,9570	-0,19	-0,03	-0,63	4,3310	4	2	13	6,20	6,07	6,47
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	83,2910	-0,80	-0,42	-0,48	5,8410	15	9	9	6,49	6,31	7,31
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	96,5450	-1,06	-0,58	-0,51	5,9030	16	9	8	6,77	6,58	8,38
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	96,8020	-0,91	-0,37	-0,35	5,9450	13	5	5	7,30	7,09	9,52
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	79,1600	-0,29	-0,02	-0,92	4,5610	4	1	13	9,04	8,84	10,15
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	104,4750	-0,93	-0,38	-0,61	5,9690	12	5	8	7,80	7,57	10,48
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	73,6360	-0,90	-0,16	-0,64	6,0630	11	2	8	11,02	10,70	14,47
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	91,5140	-1,08	0,00	-0,66	6,3140	9	0	6	12,73	12,34	24,15
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	65,5900	-0,92	0,06	-0,62	6,3360	10	0	7	14,42	13,98	24,46
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	93,3150	-1,20	0,00	-0,62	6,3910	10	0	5	13,47	13,05	27,88
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	97,4270	-1,17	0,01	-0,36	6,3960	9	0	3	13,38	12,97	28,77
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,7370	-0,97	0,01	-0,68	6,3110	12	0	8	16,72	16,21	34,19
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	59,6030	-0,83	0,17	-0,70	6,3120	9	-2	7	16,47	15,97	45,31
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	51,3040	-0,85	0,14	-0,70	6,3120	10	-2	9	16,35	15,85	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	486	-1,8	-2,1	3,81	-70	28	1,52	4,35	8,32	11,96	13,66	11,99	13,92	12,51	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	0,49	2,90	44	58	1,98				28,71		8,99		17,28		43,04	



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.