

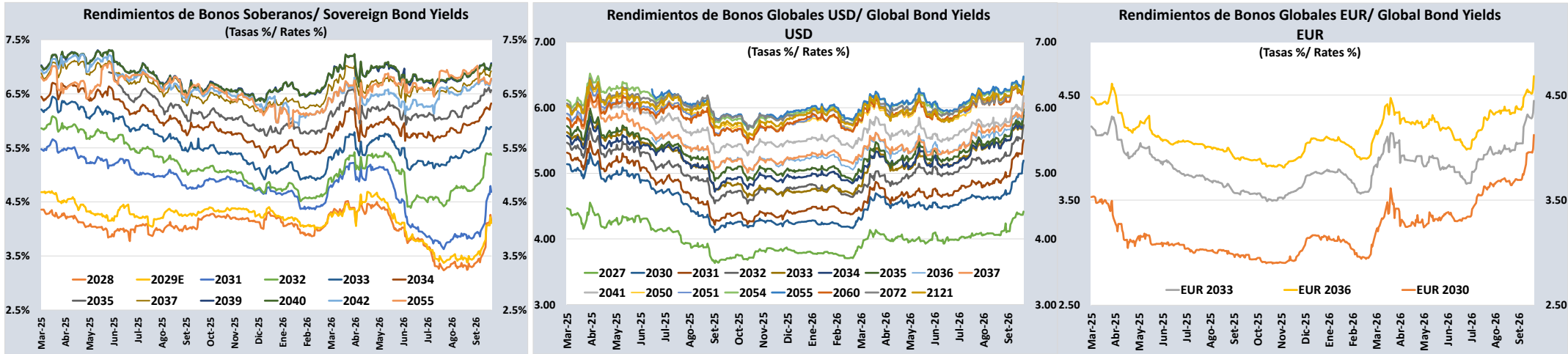


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

24/09/2026

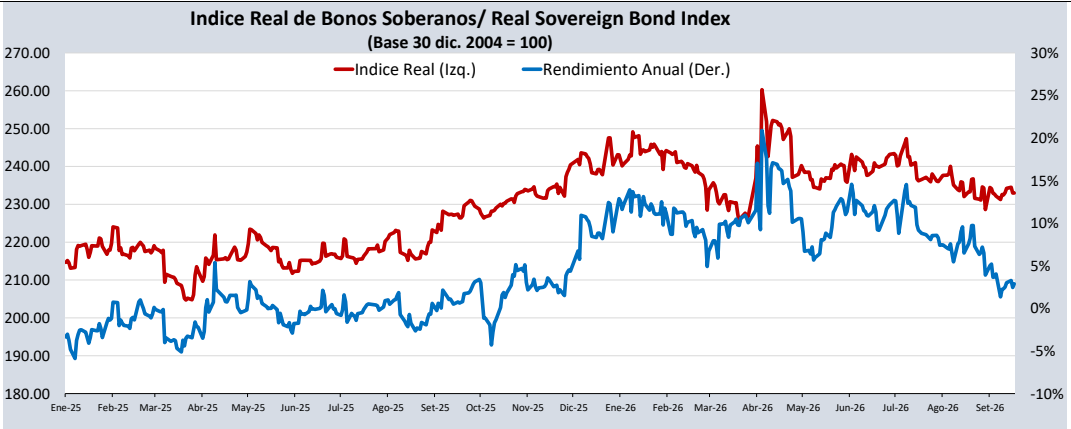
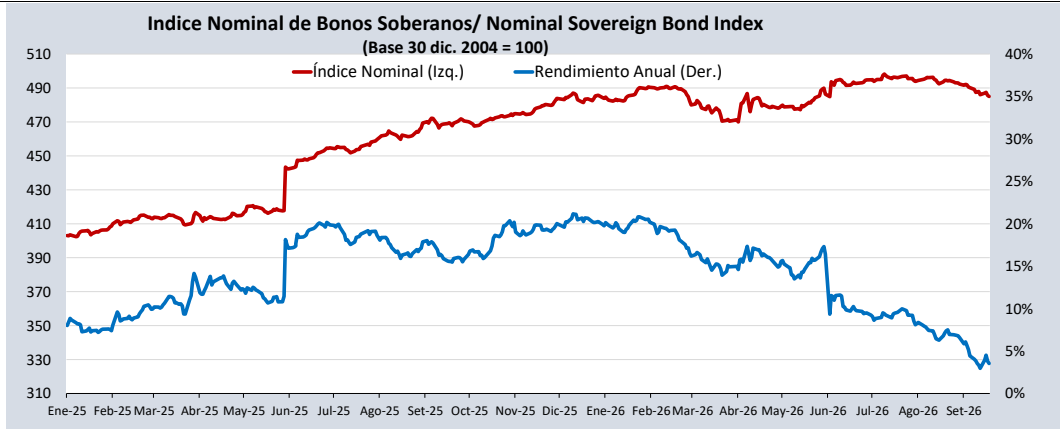
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	0,74	2 804	6,350	-	-	-	103,9024	-	-	-	4,1509	-	18-Sep-26	2	1,82	1,75	1,89
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,69	8 025	5,940	-	-	-	104,0549	-	-	-	4,1076	-	21-Sep-26	2	2,28	2,19	2,39
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,81	14 560	6,950	109,40	109,96	109,85	109,7253	4,75	4,63	4,65	4,6826	2	24-Sep-26	6	4,29	4,10	4,89
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,72	22 072	6,150	103,55	104,18	103,78	103,8419	5,43	5,30	5,38	5,3692	7	24-Sep-26	50	5,08	4,83	5,89
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,85	24 199	7,300	107,51	108,08	107,62	107,8717	5,95	5,85	5,93	5,8886	38	24-Sep-26	146	5,63	5,32	6,89
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,63	24 259	5,400	94,15	94,53	94,27	94,3578	6,36	6,30	6,34	6,3233	74	24-Sep-26	371	6,53	6,14	7,89
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,80	26 569	6,850	101,12	101,51	101,12	101,5497	6,69	6,63	6,69	6,6249	39	24-Sep-26	134	6,86	6,44	8,89
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,81	24 043	6,900	99,43	99,80	99,80	99,9536	6,99	6,94	6,94	6,9190	6	24-Sep-26	60	7,88	7,37	10,89
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	0,89	21 160	7,600	103,90	104,53	104,48	104,6139	7,15	7,08	7,08	7,0651	17	24-Sep-26	85	8,60	8,03	12,89
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,63	12 836	5,350	84,81	85,47	84,85	85,3040	7,11	7,02	7,10	7,0397	20	24-Sep-26	86	9,67	9,04	13,89
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,80	5 040	6,850	-	-	-	100,9830	-	-	-	6,7556	-	2-Sep-26	0,2	9,84	9,22	15,39
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,78	3 543	6,714	-	-	-	99,2889	-	-	-	6,7816	-	8-Sep-26	15,0	13,07	12,24	28,39
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,79	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,5217	-	-	-	1,9553	-	18-Ago-23	20	3,29	3,23	3,39
31-Ene-35	PEP01000C8V85	SB31ENE35	1,10	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	124,3731	-	-	-	3,9152	-	17-Dic-24	1	6,65	6,40	8,36
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	1,94	609	3,14%+VAC	-	-	-	85,9214	-	-	-	4,3680	-	8-May-26	7	10,94	10,49	13,39
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,45	1 336	3,83% + VAC	-	-	-	98,3298	-	-	-	3,9323	-	11-Oct-24	52	14,18	13,64	19,89
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,38	3 139	3,26%+VAC	-	-	-	90,3334	-	-	3,82	3,8200	-	24-Sep-26	12	17,96	17,30	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	99,7370	-0,05	-0,03	-0,45	4,4170	5	4	51	0,91	0,89	0,92
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	92,1050	-0,15	-0,78	-0,43	5,1950	5	26	14	3,54	3,45	3,74
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	98,8190	-0,42	-0,51	-0,54	4,1210	13	17	17	3,27	3,20	3,52
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	89,6380	-0,22	-0,86	-0,40	5,5050	6	25	11	4,07	3,96	4,33
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	80,0690	-0,33	-1,04	-0,39	5,7360	7	24	9	5,78	5,62	6,19
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	116,5350	-0,58	-1,44	-0,66	5,8830	9	22	11	5,47	5,31	7,16
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,4070	-0,55	-0,66	-0,63	4,4460	11	14	13	6,20	6,06	6,46
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	82,7720	-0,52	-1,34	-0,43	5,9400	10	26	8	6,49	6,30	7,31
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	96,0830	-0,46	-1,50	-0,49	5,9750	7	23	8	6,77	6,57	8,37
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	96,2030	-0,60	-1,51	-0,23	6,0300	9	22	3	7,29	7,07	9,52
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	78,3470	-0,81	-1,03	-0,91	4,6810	12	15	13	9,03	8,82	10,15
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	103,6510	-0,82	-1,74	-0,56	6,0730	10	22	7	7,78	7,55	10,47
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	72,7150	-0,92	-1,63	-0,66	6,1810	12	21	8	11,00	10,67	14,46
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	90,5310	-0,98	-1,84	-0,57	6,4000	9	16	5	12,67	12,28	24,15
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	64,6490	-0,94	-1,70	-0,66	6,4390	10	19	7	14,34	13,89	24,46
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	92,3650	-0,95	-1,80	-0,53	6,4690	8	15	4	13,39	12,97	27,87
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	96,4120	-1,04	-1,91	-0,28	6,4760	8	15	2	13,31	12,89	28,77
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	50,0270	-0,71	-1,48	-0,68	6,3960	9	18	8	16,59	16,08	34,19
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	58,8040	-0,80	-1,46	-0,70	6,3960	8	15	7	16,31	15,80	45,31
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	50,5340	-0,77	-1,40	-0,74	6,4070	9	17	9	16,11	15,61	94,84

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	485	-0,7	-2,9	3,54	-27	20	1,53	4,37	8,37	12,00	13,67	11,98	13,89	12,51	11,44	5,73	2,67	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	#N/D	#N/D	#N/D	#N/D	#N/D	#N/D	2,01					28,91		9,02		17,34		42,72



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.