



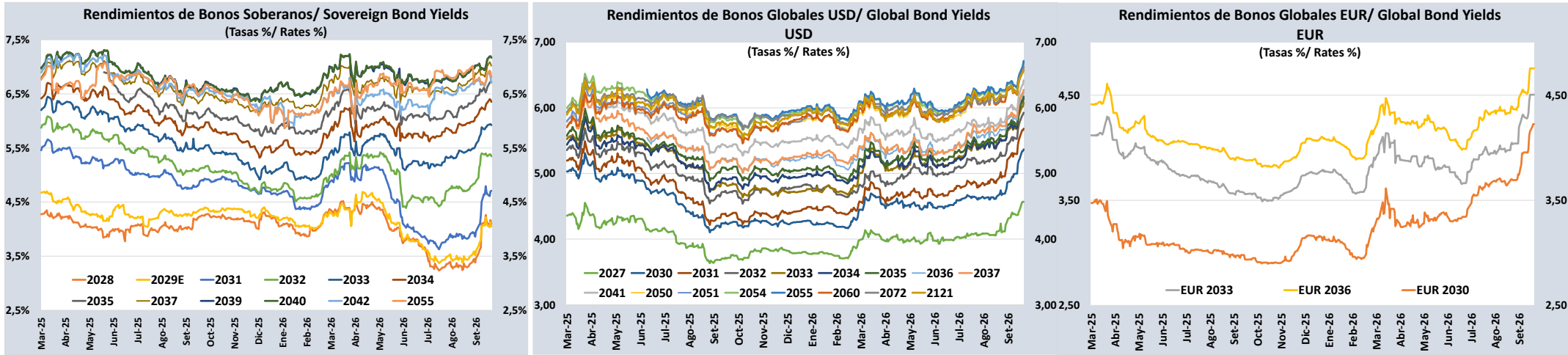
PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

30/09/2026

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 / 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	0,85	2 804	6,350	-	-	-	103,9744	-	-	-	4,0933	-	18-Sep-26	2	1,80	1,73	1,87
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,79	8 025	5,940	103,57	104,14	104,14	104,1599	4,30	4,05	4,05	4,0500	2	30-Sep-26	2	2,27	2,18	2,37
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,93	14 560	6,950	109,41	110,00	109,59	109,5808	4,74	4,61	4,70	4,7082	5	30-Sep-26	8	4,27	4,08	4,87
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,82	22 072	6,150	103,87	104,30	103,92	103,9401	5,36	5,28	5,35	5,3479	3	30-Sep-26	7	5,07	4,81	5,87
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,97	24 199	7,300	107,61	108,01	107,78	107,6640	5,93	5,86	5,90	5,9220	17	30-Sep-26	152	5,61	5,30	6,87
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,72	24 259	5,400	94,10	94,51	94,36	94,1947	6,37	6,30	6,33	6,3529	14	30-Sep-26	166	6,51	6,12	7,87
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,91	26 569	6,850	101,15	101,51	101,32	101,2532	6,69	6,63	6,66	6,6697	21	30-Sep-26	82	6,84	6,42	8,87
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,92	24 143	6,900	98,92	99,58	99,28	99,2065	7,06	6,97	7,01	7,0202	6	30-Sep-26	86	7,85	7,34	10,87
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,01	21 160	7,600	103,68	103,98	103,68	103,7249	7,18	7,14	7,18	7,1703	19	30-Sep-26	57	8,56	7,99	12,87
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,71	12 836	5,350	84,24	84,51	84,31	84,2989	7,18	7,15	7,17	7,1716	42	30-Sep-26	151	9,63	8,98	13,87
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,91	5 040	6,850	100,57	103,42	101,69	101,4649	6,80	6,50	6,68	6,7043	5	30-Sep-26	18,1	9,84	9,22	15,37
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,89	3 543	6,714	-	-	-	99,0114	-	-	-	6,8043	-	29-Sep-26	10,0	13,04	12,21	28,37
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,84	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,5858	-	-	-	1,9316	-	18-Ago-23	20	3,27	3,21	3,37
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,22	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	124,0520	-	-	-	3,9503	-	17-Dic-24	1	6,63	6,38	8,34
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,00	609	3,14%+VAC	-	-	-	84,8756	-	-	-	4,4836	-	8-May-26	7	10,91	10,44	13,37
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,51	1 336	3,83% + VAC	-	-	-	98,6670	-	-	-	3,9074	-	11-Oct-24	52	14,18	13,64	19,87
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,43	3 197	3,26%+VAC	-	-	-	90,8849	-	-	-	3,7852	-	25-Sep-26	8	17,97	17,32	27,37

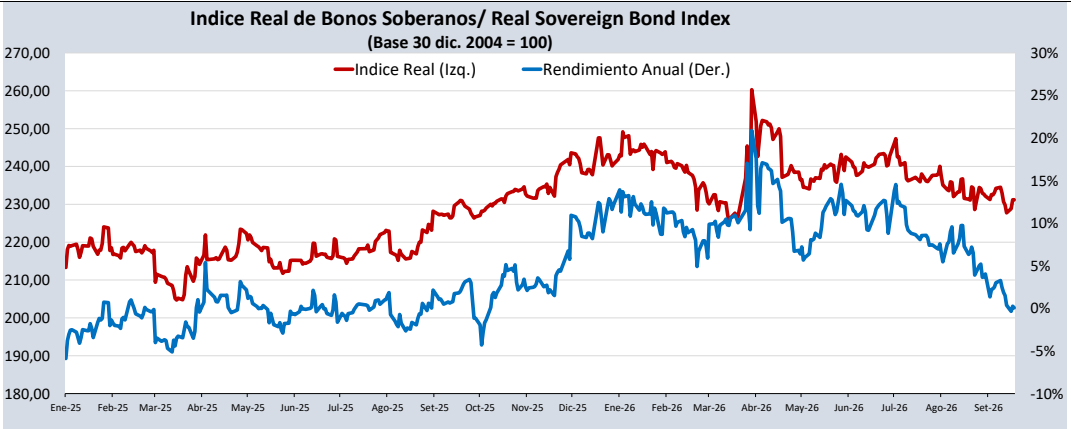
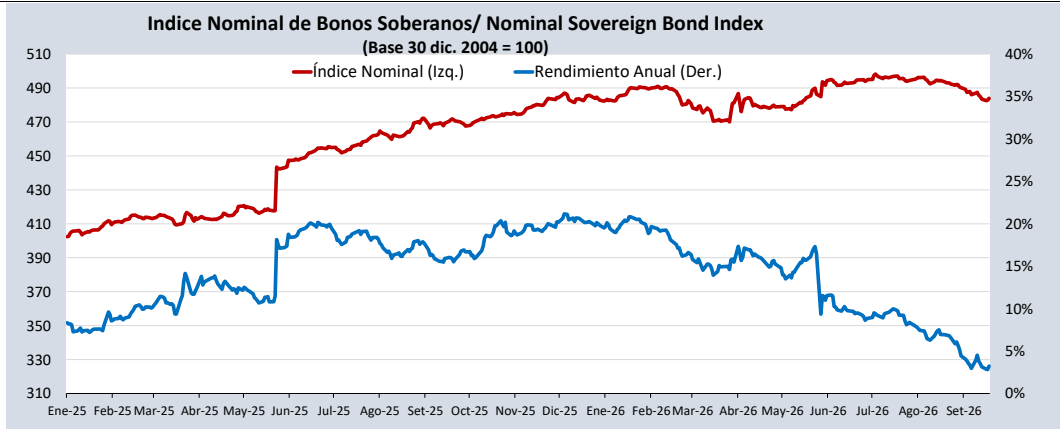
Nota: Precios y rendimientos calculados de acuerdo a los criterios establecidos en el Manual de Valorización de Títulos de Tesoro Público, donde: Negociado (negro), Cotizado (naranja), Valorizado (verde) o Subasta (azul).
Note: Prices and returns calculated according to the criteria established in the 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	99,6100	0,00	-0,17	-0,49	4,5680	0	20	56	0,89	0,87	0,90
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	91,5940	-0,07	-0,66	-0,46	5,3660	2	22	15	3,52	3,43	3,72
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	98,5000	0,00	-0,74	-0,53	4,2250	0	24	17	3,31	3,24	3,50
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	89,0470	-0,08	-0,81	-0,42	5,6820	3	24	12	4,06	3,94	4,31
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,2610	-0,12	-1,13	-0,46	5,9250	3	26	10	5,76	5,60	6,17
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	115,2760	-0,38	-1,84	-0,71	6,0780	6	29	11	5,44	5,28	7,14
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,1250	0,00	-0,83	-0,63	4,5050	0	17	13	6,18	6,04	6,45
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,7090	-0,26	-1,58	-0,49	6,1510	5	31	10	6,46	6,27	7,29
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	94,8530	-0,32	-1,69	-0,54	6,1720	5	27	9	6,74	6,54	8,36
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	94,7150	-0,38	-2,09	-0,17	6,2460	6	30	2	7,46	7,23	9,50
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,8480	0,00	-1,31	-0,89	4,7550	0	19	13	9,00	8,80	10,13
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	102,0940	-0,39	-2,38	-0,65	6,2730	5	30	9	7,74	7,51	10,46
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	70,9170	-0,50	-2,72	-0,70	6,4190	7	36	9	10,93	10,59	14,45
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	88,0390	-0,67	-3,47	-0,62	6,6240	6	31	6	12,49	12,09	24,13
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,5100	-0,60	-3,08	-0,65	6,6840	7	35	8	14,14	13,68	24,44
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	89,4700	-0,87	-3,85	-0,61	6,7150	8	32	5	13,16	12,73	27,86
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	93,5210	-0,93	-3,93	-0,24	6,7100	8	32	2	13,07	12,65	28,75
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	48,5650	-0,32	-2,17	-0,61	6,5800	4	27	8	16,30	15,78	34,17
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,7320	-0,62	-2,87	-0,65	6,6230	7	31	7	15,86	15,35	45,29
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	49,2150	-0,30	-2,09	-0,59	6,5770	4	27	8	15,67	15,18	94,83

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	484	1,2	-1,7	3,23	41	-59	1,52	4,36	8,34	11,98	13,62	11,93	14,07	12,53	11,48	5,65	2,67	1,83
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	231	0,01	0,52	0,07	-18	-181	1,89				27,16		8,39		16,38		46,18	



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.