

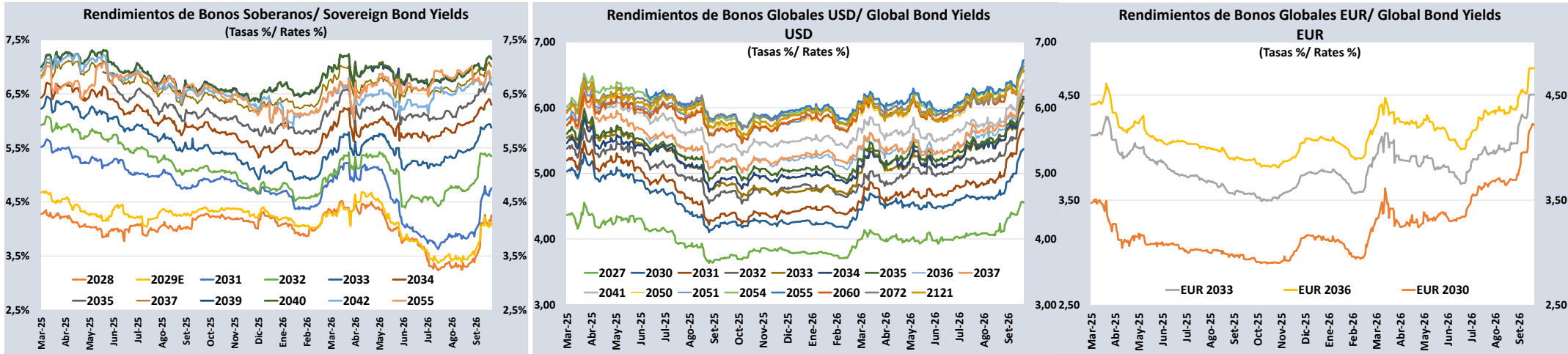


PERU: REPORTE DIARIO / DAILY REPORT

01/10/2026

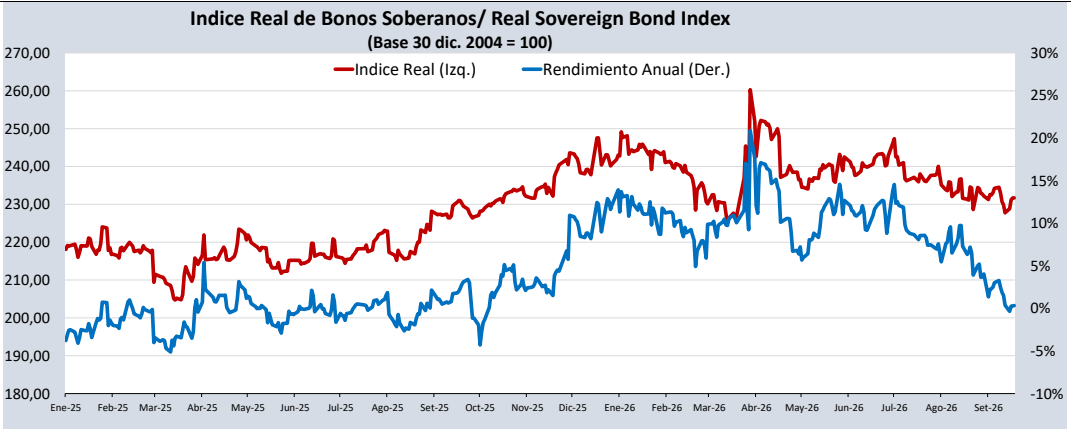
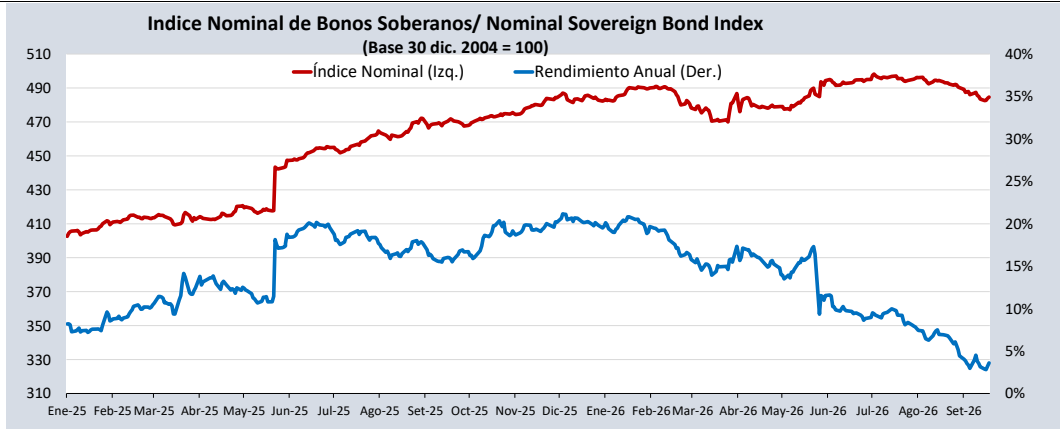
Bonos* / Bonds				Saldo vigente	Cupón / Coupon (%)	Precio / Price				Rendimiento / Yield				N° Operaciones del día / No. Day Operations	Última Negociación*** / Last trade		Duración / Duration	Duración Modificada	Vida media / Average
Descripción / Description	ISIN	Nemónico / Mnemonic	Intereses corridos / 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	0,86	2 804	6,350	103,39	103,84	103,66	103,6850	4,40	4,15	4,25	4,2500	1	1-Oct-26	2	1,80	1,73	1,87
12-Feb-29	PEP01000C5F6	SB12FEB29E	0,81	8 025	5,940	103,57	104,13	104,02	104,0413	4,30	4,05	4,10	4,1000	1	1-Oct-26	1	2,26	2,17	2,37
12-Ago-31	PEP01000C4G7	SB12AGO31	0,94	14 560	6,950	108,92	109,14	109,14	109,3690	4,85	4,80	4,80	4,7542	8	1-Oct-26	13	4,27	4,08	4,87
12-Ago-32	PEP01000C5E9	SB12AGO32	0,84	22 072	6,150	103,79	104,02	103,92	103,9305	5,38	5,33	5,35	5,3495	5	1-Oct-26	44	5,07	4,81	5,87
12-Ago-33	PEP01000C5I0	SB12AGO33	0,99	24 199	7,300	107,89	108,29	107,95	107,9427	5,88	5,81	5,87	5,8732	13	1-Oct-26	84	5,61	5,30	6,87
12-Ago-34	PEP01000C5G4	SB12AGO34	0,73	24 259	5,400	94,34	94,92	94,69	94,5153	6,33	6,23	6,27	6,2981	28	1-Oct-26	102	6,51	6,12	7,87
12-Ago-35	PEP01000C5K6	SB12AGO35	0,93	26 569	6,850	101,45	101,71	101,51	101,3881	6,64	6,60	6,63	6,6491	23	1-Oct-26	100	6,84	6,42	8,87
12-Ago-37	PEP01000C2Z1	SB12AGO37	0,94	24 143	6,900	99,14	99,65	99,50	99,3279	7,03	6,96	6,98	7,0037	19	1-Oct-26	197	7,85	7,34	10,87
12-Ago-39	PEP01000C5J8	SB12AGO39	1,03	21 160	7,600	102,24	104,14	104,06	103,9698	7,35	7,12	7,13	7,1410	22	1-Oct-26	163	8,56	7,99	12,87
12-Ago-40	PEP01000C5H2	SB12AGO40	0,73	12 836	5,350	84,40	84,55	84,55	84,4207	7,16	7,14	7,14	7,1559	34	1-Oct-26	127	9,63	8,98	13,87
12-Feb-42	PEP01000C4L7	SB12FEB42	0,93	5 040	6,850	-	-	-	101,6131	-	-	-	6,6886	-	30-Sep-26	18,1	9,84	9,22	15,37
12-Feb-55	PEP01000C4S2	SB12FEB55	0,91	3 543	6,714	-	-	-	99,2032	-	-	-	6,7886	-	29-Sep-26	10,0	13,05	12,22	28,37
12-Feb-30	PEP01000C4U8	SB12FEB30	1,84	115	2,89%+VAC	-	-	-	101,4192	-	-	-	1,9811	-	18-Ago-23	20	3,27	3,21	3,37
31-Ene-35	PEP01000CV85	SB31ENE35	1,25	1 804	7,39% + VAC	-	-	-	124,3230	-	-	-	3,9156	-	17-Dic-24	1	6,63	6,38	8,33
12-Feb-40	PEP01000C4V6	SB12FEB40	2,00	609	3,14%+VAC	-	-	-	85,0555	-	-	-	4,4640	-	8-May-26	7	10,91	10,44	13,37
12-Ago-46	PEP01000C1S8	SB12AGO46	0,52	1 336	3,83% + VAC	-	-	-	98,8432	-	-	-	3,8944	-	11-Oct-24	52	14,18	13,65	19,87
12-Feb-54	PEP01000C4T0	SB12FEB54	0,44	3 197	3,26%+VAC	-	-	-	91,0930	-	-	-	3,7721	-	25-Sep-26	8	17,98	17,33	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).



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	99,6250	0,02	-0,11	-0,48	4,5520	-2	14	55	0,89	0,87	0,90
20-jun-30	US715638DA73	466	2,844	91,5940	0,00	-0,51	-0,46	5,3680	0	17	15	3,52	3,43	3,72
30-mar-30	XS1373156618	€860	3,750	98,5320	0,03	-0,29	-0,54	4,2160	-1	9	18	3,31	3,24	3,50
23-ene-31	US715638DF60	2 799	2,783	89,0930	0,05	-0,54	-0,41	5,6710	-1	17	12	4,05	3,94	4,31
01-dic-32	US715638DP43	1 000	1,862	79,3220	0,06	-0,75	-0,43	5,9130	-1	18	10	5,76	5,60	6,17
21-nov-33	US715638AP79	2 152	8,750	115,2770	0,00	-1,26	-0,70	6,0770	0	19	11	5,44	5,28	7,14
11-mar-33	XS2314020806	€825	1,250	82,1250	0,00	-0,28	-0,63	4,5050	0	6	13	6,18	6,04	6,44
15-ene-34	US715638DU38	2 250	3,000	81,8310	0,13	-0,94	-0,48	6,1280	-2	19	9	6,46	6,27	7,29
08-feb-35	US715638EB48	1 250	5,375	94,9070	0,06	-1,18	-0,54	6,1630	-1	19	9	6,74	6,53	8,35
30-mar-36	US715638FC12	2 080	5,500	94,7040	0,00	-1,52	-0,27	6,2480	0	22	4	7,46	7,23	9,50
17-nov-36	XS2408608219	€1 000	1,950	77,8480	0,00	-0,50	-0,89	4,7550	0	7	13	9,00	8,79	10,13
14-mar-37	US715638AU64	1 130	6,550	102,1160	0,03	-1,53	-0,67	6,2700	0	20	9	7,74	7,50	10,45
11-mar-41	US715638DS81	1 250	3,300	70,9640	0,05	-1,75	-0,69	6,4130	-1	23	9	10,92	10,58	14,44
18-nov-50	US715638BM30	2 545	5,625	87,9560	-0,08	-2,55	-0,62	6,6320	1	23	6	12,48	12,08	24,13
10-mar-51	US715638DT64	1 750	3,550	62,6250	0,12	-2,02	-0,62	6,6710	-1	23	7	14,14	13,69	24,44
08-ago-54	US715638EC21	1 750	5,875	89,4020	-0,07	-2,96	-0,59	6,7210	1	25	5	13,15	12,72	27,85
30-jun-55	US715638FD94	1 400	6,200	93,3550	-0,16	-3,06	-0,27	6,7240	1	25	2	13,06	12,63	28,75
01-dic-60	US715638DQ26	2 000	2,780	48,7340	0,17	-1,29	-0,64	6,5590	-2	16	8	16,33	15,81	34,17
15-ene-72	US715638DW93	1 000	3,600	56,6710	-0,02	-2,13	-0,70	6,6300	0	23	8	15,84	15,34	45,29
28-jul-21	US715638DR09	1 000	3,230	49,4540	0,24	-1,08	-0,60	6,5450	-3	14	8	15,75	15,25	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	485	0,7	-0,4	3,60	37	6	1,52	4,35	8,31	11,97	13,64	11,96	14,07	12,53	11,50	5,66	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	232	0,00	1,89	0,33	4	-118	1,88				27,16		8,39		16,38		46,19	



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.