

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1053,92 CCL<sup>(1)</sup>: \$ 1.191,20 MEP<sup>(2)</sup>: \$ 1.177,62 Brecha: 13,03% Devaluación<sup>(3)</sup>: 1,63% Inflación<sup>(4)</sup>: 2,70% Tasa LeFi: 29% Tasa Badlar: 29,3% Tasa Caución: 26,80%

<sup>(1)</sup> Promedio a través de GD30. <sup>(2)</sup> Calculado con GD30. <sup>(3)</sup> Tasa promedio últimos 5 días (mensual). <sup>(4)</sup> Inflación mensual de Diciembre.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 1.042,00	Dólar linked	8,67%	32,86%	0,13	56	0,00%	0,00%
TZV25	\$ 1.040,00	Dólar linked	4,76%	0,00%	0,36	147	0,00%	0,00%
TZV26	\$ 965,00	Dólar linked	6,40%	0,00%	1,22	512	1,05%	1,05%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TZX5	\$ 659,2	CER	-0,84%	0,03	0,05%	0,05%
TZXM5	\$ 145,0	CER	0,32%	0,15	0,00%	0,00%
TZX25	\$ 212,8	CER	2,16%	0,40	0,02%	0,02%
TX26	\$ 1.798,0	CER	6,07%	0,99	0,06%	0,06%
TX25	\$ 1.112,0	CER	6,41%	0,75	0,45%	0,45%
TZXD5	\$ 185,3	CER	5,12%	0,86	-0,67%	-0,67%
TZXM6	\$ 144,6	CER	6,53%	1,15	-0,07%	-0,07%
TZX26	\$ 239,5	CER	6,50%	1,40	0,04%	0,04%
TX28	\$ 1.732,0	CER	6,45%	1,90	-0,52%	-0,52%
TZXD6	\$ 169,2	CER	7,45%	1,86	-0,12%	-0,12%
TZXM7	\$ 124,1	CER	7,53%	2,15	0,45%	0,45%
TZX27	\$ 231,0	CER	5,32%	2,40	4,83%	4,83%
TZXD7	\$ 155,1	CER	8,02%	2,86	-0,06%	-0,06%
DICP	\$ 38.575,0	CER	8,30%	3,82	0,19%	0,19%
TZX28	\$ 202,0	CER	7,90%	3,40	0,02%	0,02%
PARP	\$ 22.930,0	CER	8,02%	7,89	-0,74%	-0,74%
S14F5	\$ 120,28	Fija	33,54%	0,03	0,08%	0,08%
S28F5	\$ 155,46	Fija	31,54%	0,07	-0,15%	-0,15%
S14M5	\$ 122,19	Fija	33,96%	0,10	-0,17%	-0,17%
S31M5	\$ 149,05	Fija	32,92%	0,15	-0,07%	-0,07%
S16A5	\$ 124,42	Fija	31,42%	0,19	0,10%	0,10%
S28A5	\$ 123,00	Fija	31,11%	0,23	-0,04%	-0,04%
S16V5	\$ 127,10	Fija	30,65%	0,28	0,06%	0,06%
S30V5	\$ 125,48	Fija	30,12%	0,32	-0,06%	-0,06%
S18J5	\$ 133,90	Fija	30,62%	0,37	0,11%	0,11%
S30J5	\$ 132,50	Fija	28,78%	0,40	0,08%	0,08%
S31L5	\$ 130,55	Fija	29,06%	0,48	0,19%	0,19%
S29G5	\$ 137,10	Fija	28,16%	0,56	0,26%	0,26%
S12S5	\$ 136,59	Fija	28,63%	0,60	0,47%	0,47%
S30S5	\$ 134,35	Fija	30,40%	0,65	-0,66%	-0,66%
T17O5	\$ 133,00	Fija	28,97%	0,70	0,04%	0,04%
S31O5	\$ 109,75	Fija	29,55%	0,74	-0,09%	-0,09%
T15D5	\$ 136,65	Fija	29,64%	0,86	-0,44%	-0,44%
T13F6	\$ 111,40	Fija	29,31%	1,02	-0,27%	-0,27%
T30J6	\$ 101,55	Fija	28,90%	1,40	-0,05%	-0,05%
TO26	\$ 90,50	Fija	28,01%	1,47	-0,44%	-0,44%
TTM26	\$ 102,20	Dual	28,72%	1,11	-0,20%	-0,20%
TTJ26	\$ 102,15	Dual	28,19%	1,40	-0,15%	-0,15%
TTS26	\$ 102,05	Dual	28,11%	1,61	-0,24%	-0,24%
TTD26	\$ 102,25	Dual	27,70%	1,86	-0,39%	-0,39%
PBA25	\$ 103,70	Badlar	119,76%	1,47	-0,10%	-0,10%
PBY26	\$ 113,50	Badlar	28,92%	1,47	1,98%	1,98%
SFN27	\$ 102,00	Badlar	35,34%	1,40	2,00%	0,99%
BDC28	\$ 113,10	Badlar	36,91%	1,61	2,31%	2,31%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 70,40	12,4%	77,8%	2,22	1,00%	1,42%	0,00%	0,00%
GD29	\$ 71,70	11,5%	79,3%	2,23	1,00%	1,39%	-0,31%	-0,31%
AL30	\$ 65,71	12,4%	74,4%	2,63	0,75%	1,14%	-1,11%	-1,11%
GD30	\$ 66,45	11,9%	75,5%	2,64	0,75%	1,13%	-1,06%	-1,06%
AL35	\$ 68,51	10,8%	63,1%	6,51	4,13%	6,02%	-0,71%	-0,71%
GD35	\$ 68,80	10,8%	68,8%	6,51	4,13%	6,00%	-0,65%	-0,65%
AE38	\$ 70,50	11,5%	70,5%	5,62	5,00%	7,09%	-0,70%	-0,70%
GD38	\$ 72,68	10,9%	72,7%	5,68	5,00%	6,88%	-0,75%	-0,75%
AL41	\$ 63,50	10,8%	59,2%	6,93	3,50%	5,51%	-1,38%	-1,38%
GD41	\$ 64,11	10,7%	64,1%	6,95	3,50%	5,46%	-0,54%	-0,54%
GD46	\$ 66,30	10,4%	66,3%	6,73	3,00%	4,52%	-0,90%	-0,90%
BPJ5D	\$ 42,26	-5,9%	42,3%	0,23	0,00%	0,00%	0,27%	24,97%
BPA7D	\$ 97,00	26,7%	97,0%	0,23	5,00%	5,15%	-0,67%	-0,67%
BPB7D	\$ 94,24	11,6%	94,2%	1,19	5,00%	5,31%	0,36%	0,36%
BPC7D	\$ 91,35	10,4%	91,4%	2,11	5,00%	5,47%	-0,19%	-0,19%
BPD7D	\$ 91,40	10,3%	91,4%	2,33	5,00%	5,47%	-0,52%	-0,52%
BPY6D	\$ 96,05	7,6%	96,1%	1,05	3,00%	3,12%	0,16%	0,16%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEK

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
25	28/2/2025	\$ 1.070,0	1,5%	24,7%	22,3%	1,86%
56	31/3/2025	\$ 1.085,5	3,0%	21,2%	19,5%	1,62%
86	30/4/2025	\$ 1.104,0	4,8%	21,8%	20,2%	1,66%
117	31/5/2025	\$ 1.119,5	6,2%	20,7%	19,4%	1,58%
147	30/6/2025	\$ 1.137,0	7,9%	20,7%	19,6%	1,58%
178	31/7/2025	\$ 1.157,0	9,8%	21,1%	20,1%	1,61%
209	31/8/2025	\$ 1.174,0	11,4%	20,7%	19,9%	1,58%
239	30/9/2025	\$ 1.191,5	13,1%	20,6%	19,9%	1,57%
270	31/10/2025	\$ 1.214,0	15,2%	21,1%	20,5%	1,61%
300	30/11/2025	\$ 1.242,0	17,8%	22,1%	21,7%	1,68%
331	31/12/2025	\$ 1.262,0	19,7%	22,0%	21,8%	1,67%

