

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1066,04 CCL⁽¹⁾: \$ 1.217,78 MEP⁽²⁾: \$ 1.216,13 Brecha: 14,23% Devaluación⁽³⁾: 1,33% Inflación⁽⁴⁾: 2,20% Tasa LeFi: 29% Tasa Badlar: 27,8% Tasa Caución: 29,90%

(1) Promedio a través de GD30. (2) Calculado con GD30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de Enero.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 1.061,60	Dólar linked	9,28%	32,95%	0,05	24	0,15%	0,80%
TZV25	\$ 1.034,50	Dólar linked	12,12%	0,00%	0,23	115	0,34%	0,53%
TZV26	\$ 995,00	Dólar linked	5,29%	0,00%	1,16	480	0,51%	1,53%
D16E6	\$ 101,20	Dólar linked	5,00%	0,00%	0,92	315	0,00%	-0,24%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TZXM5	\$ 148,6	CER	2,33%	0,06	0,24%	0,20%
TZXV5	\$ 111,5	CER	1,92%	0,22	0,45%	0,63%
TZX25	\$ 216,6	CER	5,42%	0,31	0,12%	0,07%
TX26	\$ 1.807,5	CER	9,18%	0,88	0,19%	-0,19%
TX25	\$ 1.134,5	CER	8,24%	0,65	0,40%	-0,22%
TZXD5	\$ 185,9	CER	8,86%	0,77	0,11%	-0,46%
TZXM6	\$ 145,5	CER	9,09%	1,06	0,34%	0,00%
TZX26	\$ 239,0	CER	9,27%	1,31	0,02%	-0,31%
TX28	\$ 1.700,0	CER	9,46%	1,77	0,00%	-0,41%
TZXD6	\$ 169,1	CER	9,45%	1,77	0,09%	-1,54%
TZXM7	\$ 123,3	CER	9,59%	2,06	-0,40%	-1,32%
TZX27	\$ 217,1	CER	9,62%	2,31	-0,85%	-1,34%
TZXD7	\$ 154,2	CER	9,54%	2,77	0,23%	-0,55%
DICP	\$ 38.065,0	CER	9,66%	3,65	0,17%	-0,20%
TZX28	\$ 198,4	CER	9,56%	3,31	-0,08%	-1,81%
PARP	\$ 22.200,0	CER	8,92%	7,70	1,14%	1,14%
S14M5	\$ 125,54	Fija	36,04%	0,01	0,26%	0,43%
S31M5	\$ 152,84	Fija	36,21%	0,06	0,32%	0,36%
S16A5	\$ 127,10	Fija	36,89%	0,10	0,12%	0,20%
S28A5	\$ 125,40	Fija	36,99%	0,13	0,21%	0,14%
S16V5	\$ 129,30	Fija	36,29%	0,18	0,15%	0,04%
S30V5	\$ 127,25	Fija	36,43%	0,22	0,20%	0,04%
S18V5	\$ 135,60	Fija	36,60%	0,27	0,22%	0,04%
S30V5	\$ 132,95	Fija	37,53%	0,31	-0,04%	-0,45%
S31V5	\$ 131,20	Fija	35,40%	0,39	0,27%	-0,23%
S29V5	\$ 136,80	Fija	35,22%	0,47	0,37%	-0,09%
S12V5	\$ 136,35	Fija	35,16%	0,51	0,01%	-0,47%
S30V5	\$ 135,60	Fija	34,05%	0,56	0,67%	-0,80%
T1705	\$ 132,70	Fija	34,62%	0,61	0,53%	0,08%
S3105	\$ 109,71	Fija	34,57%	0,64	0,01%	-0,44%
T15D5	\$ 135,95	Fija	34,69%	0,77	0,85%	-0,55%
T13F6	\$ 109,60	Fija	35,02%	0,93	0,55%	-0,90%
T30I6	\$ 98,50	Fija	34,36%	1,31	0,25%	-2,04%
T15E7	\$ 96,40	Fija	31,16%	1,89	0,01%	-2,63%
TO26	\$ 87,51	Fija	33,40%	1,37	-1,23%	-1,91%
TTM26	\$ 101,20	Dual	33,01%	1,02	0,80%	-1,08%
TTI26	\$ 100,00	Dual	32,63%	1,31	1,01%	-0,79%
TTS26	\$ 98,51	Dual	33,13%	1,52	0,83%	-1,98%
TTD26	\$ 98,50	Dual	32,12%	1,77	0,92%	-1,94%
PBA25	\$ 106,10	Badlar	20,91%	0,09	0,76%	0,90%
PBY26	\$ 106,10	Badlar	40,82%	0,93	-1,76%	-1,99%
SFN27	\$ 105,00	Badlar	28,35%	2,03	0,48%	0,00%
BDC28	\$ 108,50	Badlar	36,38%	0,32	-0,64%	-1,68%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 70,58	12,8%	78,0%	2,12	1,00%	1,42%	0,89%	2,89%
GD29	\$ 72,02	11,7%	79,6%	2,14	1,00%	1,39%	0,15%	2,16%
AL30	\$ 65,65	12,9%	74,3%	2,53	0,75%	1,14%	0,55%	2,74%
GD30	\$ 66,32	12,4%	75,4%	2,54	0,75%	1,13%	-0,08%	2,84%
AL35	\$ 66,80	11,4%	61,3%	6,38	4,13%	6,18%	2,06%	5,25%
GD35	\$ 67,62	11,2%	67,6%	6,39	4,13%	6,10%	1,84%	5,81%
AE38	\$ 69,25	12,0%	69,3%	5,48	5,00%	7,22%	1,09%	5,40%
GD38	\$ 71,21	11,5%	71,2%	5,53	5,00%	7,02%	1,66%	4,87%
AL41	\$ 62,24	11,3%	57,9%	6,78	3,50%	5,62%	1,42%	4,94%
GD41	\$ 62,54	11,2%	62,5%	6,79	3,50%	5,60%	1,53%	5,29%
GD46	\$ 65,85	10,7%	65,9%	6,58	3,00%	4,56%	2,92%	5,19%
BPJ5D	\$ 35,70	-30,6%	35,7%	0,19	0,00%	0,00%	0,00%	4,97%
BPA7D	\$ 96,96	46,6%	97,0%	0,15	5,00%	5,16%	-0,42%	0,11%
BPB7D	\$ 93,00	14,0%	93,0%	1,11	5,00%	5,38%	0,32%	-1,95%
BPC7D	\$ 90,27	11,5%	90,3%	2,02	5,00%	5,54%	-0,13%	0,30%
BPD7D	\$ 90,57	11,2%	90,6%	2,24	5,00%	5,52%	-0,03%	0,85%
BPY6D	\$ 95,20	9,3%	95,2%	0,96	3,00%	3,15%	0,42%	0,73%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
24	31/3/2025	\$ 1.083,0	1,6%	27,1%	24,2%	2,02%
54	30/4/2025	\$ 1.106,5	3,8%	28,6%	25,7%	2,12%
85	31/5/2025	\$ 1.127,5	5,8%	27,2%	24,8%	2,03%
115	30/6/2025	\$ 1.148,0	7,7%	26,5%	24,4%	1,98%
146	31/7/2025	\$ 1.166,0	9,4%	25,1%	23,4%	1,88%
177	31/8/2025	\$ 1.192,5	11,9%	26,0%	24,5%	1,95%
207	30/9/2025	\$ 1.213,5	13,8%	25,7%	24,4%	1,92%
238	31/10/2025	\$ 1.254,0	17,6%	28,3%	27,0%	2,10%
268	30/11/2025	\$ 1.288,5	20,9%	29,4%	28,4%	2,17%
299	31/12/2025	\$ 1.326,5	24,4%	30,6%	29,8%	2,25%
330	31/1/2026	\$ 1.355,0	27,1%	30,4%	30,0%	2,24%

