

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial:	\$ 1.423,50	CCL:	\$ 1.432,50	MEP:	\$ 1.426,00	Brecha:	0,63%
Caucción 1D:	39%	Caucción 5D:	-	Caucción 12D:	-		

BONOS DEL TESORO NACIONAL AJUSTABLES POR CER						
Ticker	Precio	TIR	TNA	Duration	Días al Vto.	Var.
TXZ05	\$ 125,50	24,6%	22,2%	0,14	51	1,29%
TX25	\$ 1.305,00	26,8%	24,0%	0,16	59	1,87%
TXZ05	\$ 215,50	26,5%	23,8%	0,26	95	1,91%
TXZM6	\$ 164,50	22,9%	20,8%	0,55	201	1,23%
TXZ26	\$ 266,30	20,9%	19,1%	0,80	290	1,44%
TXZ06	\$ 105,05	20,1%	18,5%	1,13	410	1,64%
TX26	\$ 1.479,50	22,6%	20,6%	0,62	59	1,16%
TXZ06	\$ 184,50	18,8%	17,3%	1,26	455	3,30%
TXZM7	\$ 132,75	18,1%	16,8%	1,55	561	1,91%
TXZ27	\$ 228,60	18,4%	17,0%	1,80	650	1,59%
TXZ07	\$ 161,05	16,9%	15,7%	2,26	815	3,13%
TXZ28	\$ 202,00	16,5%	15,4%	2,80	1010	1,71%
TX28	\$ 1.536,00	19,1%	17,6%	1,44	59	1,38%
DICP	\$ 34.750,00	15,3%	14,3%	3,14	111	2,11%
CUAP	\$ 25.200,00	11,8%	11,2%	9,21	111	3,27%
PARP	\$ 20.530,00	12,8%	12,1%	6,73	20	2,62%

LETRAS Y BONOS DEL TESORO NACIONAL EN TASA FIJA						
Ticker	Precio	TNA	TEM	Duration	Días al Vto.	Var.
S1255	\$ 158,80	41,3%	3,44%	0,00	1,00	0,14%
S3055	\$ 156,58	38,9%	3,24%	0,05	19,00	0,43%
T1705	\$ 152,80	40,2%	3,35%	0,10	36,00	0,55%
S3105	\$ 125,10	44,6%	3,71%	0,14	50,00	0,88%
S10N5	\$ 113,60	46,9%	3,91%	0,16	60,00	1,24%
S28N5	\$ 112,70	43,8%	3,65%	0,21	78,00	1,71%
T1505	\$ 152,10	45,5%	3,79%	0,26	95,00	2,11%
S1666	\$ 102,59	43,6%	3,63%	0,35	127,00	1,48%
T3066	\$ 118,65	47,8%	3,99%	0,39	141,00	2,72%
T13F6	\$ 118,80	47,8%	3,98%	0,42	155,00	2,67%
S29V6	\$ 96,40	45,0%	3,75%	0,71	260,00	1,84%
T30J6	\$ 102,50	44,1%	3,67%	0,80	292,00	3,13%
TO26	\$ 78,82	46,0%	3,84%	0,97	36,00	1,21%
T15E7	\$ 92,50	41,7%	3,48%	1,35	491,00	0,65%
TV30P	\$ 90,79	34,9%	2,91%	2,43	80,00	2,01%

BONOS DEL TESORO NACIONAL DUALES						
Ticker	Precio	TNA - TAMAR	TNA - FIJA	Duration	Días al Vto.	Var.
TTM26	\$ 119,35	43,8%	24,1%	0,51	187,00	1,66%
TTJ26	\$ 112,85	48,0%	31,4%	0,80	293,00	0,89%
TTS26	\$ 109,30	48,6%	33,1%	1,01	370,00	0,96%
TTD26	\$ 107,85	47,1%	32,3%	1,26	461,00	1,07%

LETRAS DEL TESORO NACIONAL TAMAR						
Ticker	Precio	TNA	TEM	Duration	Días al Vto.	Var.
M10N5	\$ 105,75	48,0%	4,2%	0,16	60,00	0,90%
M16E6	\$ 110,88	37,3%	3,3%	0,35	126,00	-3,58%

BOPREALES						
Ticker	Precio	TNA	Duration	Paridad	Prox. Cupón	Var.
BPB7D	\$ 98,75	10,1%	0,56	97,0%	31/10/2025	-0,24%
BPC7D	\$ 92,85	11,2%	1,40	91,2%	31/10/2025	-0,58%
BPD7D	\$ 91,71	11,1%	1,60	90,1%	31/10/2025	-1,37%
BPY6D	\$ 100,00	3,2%	0,45	99,9%	30/11/2025	-0,14%

LETRAS Y BONOS DEL TESORO NACIONAL AJUSTABLES POR EL TIPO DE CAMBIO						
Ticker	Precio	TIR	TNA	Duration	Días al Vto.	Var.
D3105	\$ 139.500,00	17,4%	16,7%	0,12	51	-0,09%
TZV05	\$ 138.200,00	12,0%	11,7%	0,23	96	-0,21%
D16E6	\$ 136.740,00	12,2%	11,9%	0,35	128	0,47%
TZV26	\$ 129.500,00	12,6%	12,2%	0,71	293	1,10%

BONOS SOBERANOS						
Ticker	Precio	Paridad	TNA	Duration	Current Yield	Var.
AL29D	\$ 57,60	76%	18,8%	1,53	1,24%	1,96%
AL30D	\$ 54,82	68%	17,7%	1,88	1,04%	1,65%
AL35D	\$ 56,67	56%	14,5%	5,08	7,28%	2,47%
AE38D	\$ 57,80	57%	16,1%	4,08	8,65%	2,08%
AL41D	\$ 52,94	53%	14,2%	5,23	6,61%	2,53%
GD29D	\$ 60,71	76%	15,8%	1,60	1,24%	2,03%
GD30D	\$ 57,40	68%	15,6%	1,95	1,05%	1,50%
GD35D	\$ 58,89	58%	13,8%	5,15	7,00%	2,22%
GD38D	\$ 63,00	62%	14,2%	4,30	7,94%	3,19%
GD41D	\$ 55,37	55%	13,4%	5,36	6,32%	2,59%
GD46D	\$ 55,00	58%	13,1%	5,09	6,92%	1,26%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX						
Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Var.
DLR/SEP25	29/9/2025	1446,00	1,6%	35,2%	30,4%	0,5
DLR/OCT25	30/10/2025	1502,50	5,5%	48,3%	40,5%	-8,5
DLR/NOV25	28/11/2025	1547,00	8,7%	46,9%	40,1%	-12,0
DLR/DIC25	30/12/2025	1586,00	11,4%	42,7%	37,5%	-14,0
DLR/ENE26	30/1/2026	1614,50	13,4%	38,2%	34,5%	-19,5
DLR/FEB26	27/2/2026	1642,50	15,4%	36,0%	33,0%	-18,5
DLR/MAR26	30/3/2026	1693,50	19,0%	37,1%	34,4%	0,0
DLR/ABR26	29/4/2026	1712,00	20,3%	33,9%	32,0%	-10,0
DLR/MAY26	29/5/2026	1740,00	22,2%	32,4%	31,1%	-13,0
DLR/JUN26	29/6/2026	1776,00	24,8%	31,9%	31,0%	-9,0
DLR/JUL26	30/7/2026	1823,50	28,1%	32,3%	31,8%	0,0
DLR/AGO26	28/8/2026	1857,00	30,5%	31,7%	31,6%	-16,0

