

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 994,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.164,34 MEP⁽²⁾: \$ 1.140,03 Brecha: 17,05% Devaluación⁽³⁾: 1,99% Inflación⁽⁴⁾: 3,50% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 36,69% Tasa Caución: 30,30%

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

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.200,70	Duales (CER)	17,0%	32,0%	0,23	86	-1,98%	-1,58%
TV25	\$ 973,00	Dólar linked	6,05%	31,44%	0,37	145	0,20%	-0,92%
TZV25	\$ 975,00	Dólar linked	4,00%	0,00%	0,59	236	0,83%	3,71%
TZV05	\$ 905,00	Dólar linked	8,80%	0,00%	1,07	404	-1,63%	-1,63%
TZV26	\$ 890,00	Dólar linked	6,91%	0,00%	1,44	601	2,65%	3,49%
TDE25	\$ 1.200,70	Duales (DL)	-55,70%	-53,95%	0,23	86	-1,98%	-1,86%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 494,0	CER	2,67%	0,10	0,00%	0,32%
TZK5	\$ 602,0	CER	3,99%	0,25	0,43%	0,70%
TZXM5	\$ 131,8	CER	4,24%	0,39	0,00%	0,57%
TZX25	\$ 189,8	CER	6,95%	0,64	0,61%	0,96%
TX26	\$ 2.016,0	CER	10,05%	0,95	0,65%	0,57%
TX25	\$ 1.005,0	CER	7,07%	0,99	0,10%	1,21%
TZXD5	\$ 161,5	CER	9,50%	1,10	0,12%	0,62%
TZXM6	\$ 126,0	CER	9,82%	1,39	0,68%	0,80%
TZX26	\$ 206,9	CER	9,87%	1,64	0,46%	0,46%
TX28	\$ 1.730,0	CER	9,13%	1,82	0,06%	0,82%
TZXD6	\$ 146,0	CER	10,03%	2,10	0,69%	0,31%
TZXM7	\$ 110,0	CER	8,57%	2,39	0,00%	0,92%
TZX27	\$ 190,0	CER	9,49%	2,64	1,88%	2,43%
TZXD7	\$ 133,0	CER	9,95%	3,10	0,76%	0,76%
DICP	\$ 36.500,0	CER	10,49%	3,58	2,10%	1,11%
TZX28	\$ 172,0	CER	9,75%	3,65	0,88%	0,88%
PARP	\$ 18.900,0	CER	9,29%	8,00	5,59%	3,56%

S11N4	\$ 108,78	Fija	31,23%	0,01	0,09%	0,26%
S29N4	\$ 132,20	Fija	40,10%	0,06	0,06%	0,33%
S13D4	\$ 122,70	Fija	39,90%	0,10	0,21%	0,45%
S17E5	\$ 124,10	Fija	33,03%	0,19	1,14%	1,60%
S31E5	\$ 159,50	Fija	40,53%	0,23	0,41%	0,51%
S14F5	\$ 110,35	Fija	41,47%	0,27	0,41%	0,45%
S28F5	\$ 142,10	Fija	41,69%	0,31	0,35%	0,39%
S14M5	\$ 112,08	Fija	39,88%	0,35	0,30%	1,20%
S31M5	\$ 135,56	Fija	41,79%	0,39	0,38%	0,75%
S16A5	\$ 112,39	Fija	42,36%	0,44	0,35%	0,39%
S28A5	\$ 111,70	Fija	39,82%	0,47	1,18%	1,22%
S16V5	\$ 114,10	Fija	41,82%	0,52	0,13%	0,18%
S30V5	\$ 112,80	Fija	40,36%	0,56	1,30%	1,30%
S18I5	\$ 119,50	Fija	41,44%	0,61	0,59%	0,84%
S30I5	\$ 116,95	Fija	42,06%	0,64	0,47%	0,39%
S31I5	\$ 114,70	Fija	41,53%	0,73	0,09%	0,00%
S29G5	\$ 118,95	Fija	41,75%	0,81	0,61%	0,51%
S12S5	\$ 118,80	Fija	41,07%	0,85	0,50%	1,15%
S30S5	\$ 117,50	Fija	40,88%	0,90	0,17%	0,64%
T17O5	\$ 115,25	Fija	40,58%	0,94	0,66%	0,79%
T15D5	\$ 117,85	Fija	39,97%	1,10	1,07%	1,42%
TO26	\$ 77,60	Fija	35,21%	1,70	0,78%	-2,39%
PBA25	\$ 103,05	Badlar	47,47%	0,81	0,13%	0,18%
BDC25	\$ 108,50	Badlar	48,12%	0,85	1,30%	1,30%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 74,80	15,1%	73,5%	2,11	1,00%	1,34%	1,63%	2,06%
GD29	\$ 77,09	13,5%	75,7%	2,14	1,00%	1,30%	2,08%	2,12%
AL30	\$ 66,65	16,0%	65,7%	2,47	0,75%	1,13%	1,29%	2,22%
GD30	\$ 69,27	14,3%	69,3%	2,52	0,75%	1,08%	1,54%	3,30%
AL35	\$ 60,75	13,0%	56,5%	6,39	3,63%	5,97%	1,93%	2,45%
GD35	\$ 61,00	12,9%	61,0%	6,40	3,63%	5,94%	1,92%	3,57%
AE38	\$ 64,17	13,6%	64,2%	5,46	4,25%	6,62%	1,13%	3,17%
GD38	\$ 66,30	12,9%	66,3%	5,53	4,25%	6,41%	0,62%	3,85%
AL41	\$ 56,65	12,7%	53,2%	6,70	3,50%	6,18%	1,25%	3,13%
GD41	\$ 56,79	12,7%	56,8%	6,71	3,50%	6,16%	0,16%	3,35%
GD46	\$ 62,00	12,0%	62,0%	6,17	3,00%	4,84%	-0,72%	1,64%
BPI5D	\$ 67,75	-4,5%	67,8%	0,35	0,00%	0,00%	1,45%	0,98%
BPA7D	\$ 97,50	11,1%	97,5%	0,48	5,00%	5,13%	0,78%	0,93%
BPB7D	\$ 91,68	11,7%	91,7%	1,44	5,00%	5,45%	-0,11%	0,09%
BPC7D	\$ 88,80	10,6%	88,8%	2,35	5,00%	5,63%	0,92%	1,95%
BPD7D	\$ 87,34	11,2%	87,3%	2,57	5,00%	5,72%	0,56%	0,97%
BPY6D	\$ 92,50	10,0%	92,5%	0,79	3,00%	3,24%	-0,12%	0,43%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
------	-----	--------	---------------------	-----	-----	------------------

