

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1017,25 CCL⁽¹⁾: \$ 1.075,00 MEP⁽²⁾: \$ 1.057,38 Brecha: 5,68% Devaluación⁽³⁾: 1,76% Inflación⁽⁴⁾: 2,70% Tasa LeFi: 32% Tasa Badlar: 31,9% Tasa Caución: 29,60%

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

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.275,20	Duales (CER)	3,3%	0,0%	0,13	52	1,10%	0,81%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 989,90	Dólar linked	10,58%	35,57%	0,26	111	-0,26%	-0,31%
TZV25	\$ 977,80	Dólar linked	8,84%	0,00%	0,46	202	0,30%	0,08%
TZVDS	\$ 938,00	Dólar linked	8,40%	0,00%	0,97	370	0,00%	0,86%
TZV26	\$ 887,50	Dólar linked	9,23%	0,00%	1,28	567	-0,28%	-1,93%
TDE25	\$ 1.275,20	Duales (DL)	-81,43%	0,00%	0,13	52	1,10%	0,81%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TZX5	\$ 625,0	CER	5,94%	0,16	0,16%	1,25%
TZXM5	\$ 136,0	CER	7,53%	0,30	0,00%	0,07%
TZX25	\$ 197,2	CER	7,98%	0,55	-0,13%	0,25%
TX26	\$ 1.650,0	CER	9,41%	1,12	-0,24%	0,61%
TX25	\$ 1.020,0	CER	10,57%	0,89	-1,16%	-3,41%
TZXD5	\$ 169,9	CER	9,00%	1,01	-0,29%	0,50%
TZXM6	\$ 132,9	CER	9,20%	1,30	-0,04%	0,64%
TZX26	\$ 220,4	CER	8,65%	1,55	0,64%	1,10%
TX28	\$ 1.555,5	CER	9,39%	2,01	0,10%	0,71%
TZXD6	\$ 154,6	CER	9,45%	2,01	0,06%	-0,03%
TZXM7	\$ 116,5	CER	7,98%	2,30	3,93%	0,52%
TZX27	\$ 199,5	CER	9,36%	2,55	0,03%	-0,30%
TZXD7	\$ 141,2	CER	9,45%	3,01	0,18%	0,14%
DICP	\$ 38.040,0	CER	9,13%	3,57	-1,09%	-0,42%
TZX28	\$ 182,0	CER	9,43%	3,55	0,28%	0,19%
PARP	\$ 20.470,0	CER	8,82%	7,95	-0,41%	0,47%
S17E5	\$ 127,05	Fija	39,65%	0,10	0,10%	1,17%
S31E5	\$ 164,85	Fija	41,13%	0,13	0,28%	1,20%
S14F5	\$ 114,15	Fija	41,75%	0,17	0,18%	1,28%
S28F5	\$ 146,94	Fija	42,28%	0,21	0,03%	0,78%
S14M5	\$ 115,49	Fija	41,65%	0,25	0,21%	1,17%
S31M5	\$ 140,08	Fija	42,59%	0,30	0,04%	1,03%
S16A5	\$ 116,35	Fija	42,47%	0,34	0,04%	0,99%
S28A5	\$ 114,80	Fija	41,97%	0,37	0,04%	1,28%
S16Y5	\$ 118,30	Fija	41,26%	0,42	0,17%	1,20%
S30Y5	\$ 116,35	Fija	41,10%	0,46	-0,13%	1,18%
S18J5	\$ 123,90	Fija	40,90%	0,51	0,04%	1,31%
S30J5	\$ 121,76	Fija	40,58%	0,55	-0,07%	1,10%
S31L5	\$ 119,56	Fija	39,91%	0,63	-0,24%	1,02%
S29G5	\$ 124,50	Fija	39,53%	0,71	-0,19%	1,22%
S12S5	\$ 124,15	Fija	39,18%	0,75	-0,04%	0,93%
S30S5	\$ 123,90	Fija	37,53%	0,80	0,57%	1,40%
T17O5	\$ 120,50	Fija	38,77%	0,84	-0,17%	0,42%
T15D5	\$ 123,95	Fija	37,59%	1,01	-0,36%	0,04%
T13F6	\$ 100,70	Fija	36,54%	1,17	-0,25%	0,70%
TO26	\$ 82,40	Fija	32,69%	1,61	-0,78%	0,06%
PBA25	\$ 107,15	Badlar	35,87%	0,31	0,28%	0,94%
PBY26	\$ 107,00	Badlar	36,76%	1,14	0,47%	3,88%
BDC28	\$ 105,55	Badlar	38,28%	0,34	0,43%	0,57%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 78,63	13,0%	77,1%	2,06	1,00%	1,27%	-0,44%	1,30%
GD29	\$ 80,60	11,7%	79,1%	2,08	1,00%	1,24%	-0,37%	1,69%
AL30	\$ 71,71	13,2%	70,7%	2,45	0,75%	1,05%	-1,23%	0,99%
GD30	\$ 73,07	12,4%	73,1%	2,47	0,75%	1,03%	-1,12%	0,34%
AL35	\$ 66,50	11,6%	61,6%	6,41	3,63%	5,45%	-0,75%	-0,40%
GD35	\$ 66,73	11,6%	66,7%	6,41	3,63%	5,43%	-0,70%	-0,04%
AE38	\$ 69,25	12,2%	69,3%	5,50	4,25%	6,14%	-0,35%	-1,27%
GD38	\$ 71,05	11,7%	71,1%	5,55	4,25%	5,98%	-0,63%	0,14%
AL41	\$ 62,60	11,2%	58,7%	6,83	3,50%	5,59%	-1,40%	0,22%
GD41	\$ 63,00	11,1%	63,0%	6,84	3,50%	5,56%	0,02%	0,08%
GD46	\$ 67,00	10,8%	67,0%	6,37	3,00%	4,48%	-0,45%	-0,43%
BPJ5D	\$ 58,79	-2,6%	58,8%	0,30	0,00%	0,00%	-0,36%	-0,02%
BPA7D	\$ 96,50	17,0%	96,5%	0,38	5,00%	5,18%	-0,41%	0,00%
BPB7D	\$ 91,51	12,7%	91,5%	1,35	5,00%	5,46%	-0,59%	-0,87%
BPC7D	\$ 89,40	10,7%	89,4%	2,26	5,00%	5,59%	-0,48%	1,59%
BPD7D	\$ 90,60	10,0%	90,6%	2,48	5,00%	5,52%	-0,32%	2,43%
BPY6D	\$ 93,20	10,1%	93,2%	1,19	3,00%	3,22%	-0,85%	-0,86%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
21	31/12/2024	\$ 1.036,5	1,9%	38,5%	32,9%	2,75%
52	31/1/2025	\$ 1.059,0	4,1%	32,6%	28,8%	2,38%
79	27/2/2025	\$ 1.076,0	5,8%	29,6%	26,7%	2,19%
110	30/3/2025	\$ 1.095,0	7,6%	27,7%	25,4%	2,06%
141	30/4/2025	\$ 1.116,0	9,7%	27,1%	25,1%	2,02%
172	31/5/2025	\$ 1.137,5	11,8%	26,8%	25,1%	2,00%
202	30/6/2025	\$ 1.158,0	13,8%	26,4%	25,0%	1,97%
233	31/7/2025	\$ 1.177,5	15,8%	25,8%	24,7%	1,93%
263	30/8/2025	\$ 1.198,0	17,8%	25,5%	24,7%	1,91%
294	30/9/2025	\$ 1.220,0	19,9%	25,3%	24,7%	1,90%
325	31/10/2025	\$ 1.246,0	22,5%	25,6%	25,3%	1,92%
355	30/11/2025	\$ 1.269,0	24,7%	25,5%	25,4%	1,91%

* Supuestos de Inflación propios: 3% a partir de Noviembre
Supuestos de Devaluación: 2% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

