

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 210,33 CCL: \$ 405,65 MEP: \$ 397,50 Brecha: 92,9% Devaluación⁽¹⁾: 6,13% Inflación⁽²⁾: 6,60% Tasa Leliq: 78,0% Tasa Caución: 66,55%

⁽¹⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual). ⁽²⁾ Inflación mensual de Febrero.

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X21A3	\$ 199,75	CER	13,6%	81,3%	0,04	20	0,03%	0,03%
X19Y3	\$ 192,55	CER	0,7%	84,8%	0,12	48	0,39%	0,39%
X16J3	\$ 151,99	CER	2,7%	88,6%	0,19	76	0,52%	0,52%
X18L3	\$ 101,00	CER	4,6%	92,9%	0,28	108	0,40%	0,40%
T2X3	\$ 376,50	CER	6,3%	95,3%	0,35	134	0,00%	0,00%
X18S3	\$ 138,50	CER	6,6%	101,0%	0,44	170	0,00%	0,00%
S28A3	\$ 94,91	Fija	129%	85,1%	0,06	27	0,19%	0,19%
S31Y3	\$ 88,25	Fija	126%	86,8%	0,15	60	0,22%	0,22%
S30J3	\$ 82,15	Fija	130%	92,2%	0,24	90	-0,08%	-0,09%
S31L3	\$ 77,79	Fija	119%	89,1%	0,32	121	-0,26%	-0,26%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDJ23	\$ 213,00	Diales (CER)	1,8%	85,9%	0,23	90	-0,09%	-0,09%
TDL23	\$ 213,25	Diales (CER)	1,5%	86,2%	0,32	121	0,24%	0,24%
TDS23	\$ 213,25	Diales (CER)	2,2%	92,8%	0,48	182	0,12%	0,12%
TDF24	\$ 203,75	Diales (CER)	6,1%	96,8%	0,87	333	0,62%	0,62%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV23	\$ 210,35	Dólar linked	-7,6%	70,1%	0,06	27	-0,31%	-0,31%
T2V3	\$ 213,20	Dólar linked	-6,0%	75,6%	0,32	121	1,52%	1,52%
TV24	\$ 198,00	Dólar linked	5,8%	129,1%	1,04	395	0,53%	0,53%
TDJ23	\$ 213,00	Diales (DL)	-7,7%	70,5%	0,23	90	-0,09%	-0,09%
TDL23	\$ 213,25	Diales (DL)	-6,1%	74,8%	0,32	121	0,24%	0,24%
TDS23	\$ 213,25	Diales (DL)	-4,1%	82,3%	0,48	182	0,12%	0,12%
TDF24	\$ 203,75	Diales (DL)	2,9%	113,9%	0,87	333	0,62%	0,62%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 383,00	CER	12,7%	0,90	0,00%	0,00%
T3X4	\$ 98,50	CER	10,2%	1,01	0,51%	0,51%
T2X4	\$ 275,75	CER	13,4%	1,27	0,00%	0,00%
T4X4	\$ 91,75	CER	13,6%	1,48	0,82%	0,82%
T2X5	\$ 88,90	CER	14,2%	1,79	0,17%	0,17%
TX25	\$ 144,90	CER	12,8%	2,41	2,04%	2,04%
TX26	\$ 285,30	CER	14,4%	2,32	0,00%	0,00%
TX28	\$ 273,60	CER	13,8%	2,81	-0,04%	-0,04%
DCP	\$ 5.535,00	CER	13,7%	4,17	-0,07%	-0,07%
PARP	\$ 2.814,50	CER	10,4%	8,45	3,66%	3,66%
TO23	\$ 79,00	Fija	118,1%	0,34	0,27%	0,27%
TO26	\$ 30,00	Fija	111,7%	1,08	-3,85%	-3,85%
BDC24	\$ 103,90	Badlar	92,3%	0,77	1,17%	1,17%
PBA25	\$ 105,30	Badlar	123,1%	0,95	-0,05%	-0,05%
BDC28	\$ 105,05	Badlar	104,7%	1,37	-0,76%	-0,76%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	MTD
AL29	\$ 26,30	26%	47,7%	3,13	1,00%	3,80%	2,69%	2,69%
GD29	\$ 29,98	30%	41,7%	3,21	1,00%	3,34%	1,63%	1,63%
AL30	\$ 26,10	26%	44,7%	3,20	0,50%	1,92%	1,95%	1,95%
GD30	\$ 30,39	30%	38,1%	3,33	0,50%	1,65%	2,32%	2,32%
AL35	\$ 25,50	25%	26,2%	6,11	1,50%	5,88%	2,00%	2,00%
GD35	\$ 27,35	27%	24,7%	6,26	1,50%	5,48%	1,18%	1,18%
AE38	\$ 29,65	29%	27,8%	5,00	3,88%	13,07%	1,19%	1,19%
GD38	\$ 33,50	33%	24,8%	5,27	3,88%	11,57%	4,36%	4,36%
AL41	\$ 26,30	26%	24,7%	5,79	3,50%	13,31%	1,94%	1,94%
GD41	\$ 30,10	30%	21,9%	6,16	3,50%	11,63%	3,79%	3,79%
GD46	\$ 26,50	26%	26,6%	4,91	1,50%	5,66%	-4,94%	-4,94%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
27	30/4/2023	\$ 224,43	6,7%	140,4%	90,6%	7,58%
58	31/5/2023	\$ 245,25	16,6%	162,9%	104,5%	8,39%
88	30/6/2023	\$ 264,90	25,9%	160,3%	107,6%	8,30%
119	31/7/2023	\$ 285,00	35,5%	153,9%	108,9%	8,07%
150	31/8/2023	\$ 312,50	48,6%	162,1%	118,2%	8,36%
180	30/9/2023	\$ 338,00	60,7%	161,7%	123,1%	8,35%
211	31/10/2023	\$ 363,65	72,9%	157,8%	126,1%	8,21%
241	30/11/2023	\$ 391,85	86,3%	156,6%	130,7%	8,17%
272	31/12/2023	\$ 420,50	99,9%	153,4%	134,1%	8,05%
303	31/1/2024	\$ 451,05	114,4%	150,7%	137,9%	7,96%

* Supuestos de inflación: 7,1% para mar-23 y 6,5% mensual en adelante.

Supuestos de Devaluación: 6,3% para instrumentos que vencen hasta 2023 (DL y Diales) y 6,5% para los que vencen en 2024.

