

Informe Renta Fija a Nivel Local al 05/10/2022											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
<b>Obligaciones Negociables en Dólares</b>											
USD	RCC9D	Arcor	6,000%	Nueva York	6/7/2023	1,305%	0,73	\$ 1,050	1.000	06/01 y 06/07	Bullet
USD	CAC2D	Capex	6,875%	Nueva York	15/5/2024	5,602%	1,51	\$ 1,048	1.000	15/05 y 15/11	Bullet
USD	CP17D	Cía. Gral. de Combustibles	9,500%	Nueva York	8/3/2025	7,840%	1,54	\$ 0,898	1.000	08/03 y 08/09	13,30% semestral desde 08/09/2022 hasta 08/09/2024; y 33,50% al vencimiento
USD	CP21D	Cía. Gral. de Combustibles	7,000%	Argentina	10/6/2023	4,835%	0,66	\$ 1,020	1	10/03, 10/06, 10/09 y 10/12	Bullet
USD	CSDOD	Cresud	6,500%	Argentina	16/2/2023	3,425%	0,36	\$ 1,020	1	16/02 y 16/08	Bullet
USD	CS38D	Cresud	8,000%	Argentina	3/1/2026	7,476%	3,12	\$ 1,020	1	03/01 y 03/07	Bullet
USD	RPC2D	IRSA	8,750%	Nueva York	23/3/2023	1,857%	0,39	\$ 1,035	500	23/03 y 23/09	Bullet
USD	IRC9D	IRSA	10,000%	Argentina	1/3/2023	9,080%	0,39	\$ 1,029	1	12/02, 12/05, 12/08 y 12/11	Bullet
USD	IRCFD	IRSA	8,750%	Nueva York	22/6/2028	8,631%	3,58	\$ 1,010	1	22/06 y 22/12	17,50% anual desde 22/06/2024 hasta 22/06/2027; y 30% al vencimiento
USD	RUC3D	MSU Energy	7,350%	Argentina	21/12/2023	8,554%	1,15	\$ 1,010	1	21/06 y 21/12	Bullet
USD	MGC9D	Pampa Energía	9,500%	Nueva York	8/12/2026	7,236%	2,91	\$ 1,085	1	08/06 y 08/12	33% el 08/12/2024; 33% el 08/12/2025; 34% al vencimiento
USD	PTSTD	Pampa Energía	7,375%	Nueva York	21/7/2023	2,317%	0,77	\$ 1,055	1.000	21/01 y 21/07	Bullet
USD	PNDCCD	Pan American Energy	9,125%	Nueva York	30/4/2027	4,551%	3,05	\$ 1,190	1.000	30/04 y 30/11	20% semestral de 30/04/2025 hasta el vencimiento
USD	PQCDD	Petroquímica Comodoro Rivadavia	9,000%	Argentina	29/1/2023	4,946%	0,31	\$ 1,030	1	29/01, 29/04, 29/07 y 29/10	Bullet
USD	TLC5D	Telecom Argentina	8,500%	Nueva York	6/8/2025	8,558%	0,80	\$ 1,016	1.000	06/02 y 06/08	3% el 06/02/2023; 30% el 06/08/2023; 33% el 06/08/2024; 34% al vencimiento
USD	VSC3D	Vista Energy	3,500%	Argentina	21/2/2024	1,613%	1,35	\$ 1,030	1	21/02 y 21/08	Bullet
USD	YPCUD	YPF	8,750%	Nueva York	4/4/2024	18,598%	1,01	\$ 0,643	1.000	04/04 y 04/10	30% el 04/04/2022; 30% el 04/04/2023; 40% al vencimiento
USD	YMCHD	YPF (Garantizada con Exportaciones)	4,00% hasta 01/2023; 9,00% hasta el vencimiento	Nueva York	12/2/2026	15,488%	1,47	\$ 0,907	1	12/02, 12/05, 12/08 y 12/11	7,6923% trimestral desde 12/02/2023
USD	YMCID	YPF (Garantizada con Exportaciones)	2,50% hasta 01/2023; 9,00% hasta el vencimiento	Nueva York	30/6/2029	20,023%	3,96	\$ 0,670	1	30/06 y 30/12	14,29% semestral desde 30/06/2026
USD	YMCJD	YPF (Garantizada con Exportaciones)	1,50% hasta 01/2023; 7,00% hasta el vencimiento	Nueva York	30/9/2033	16,018%	6,25	\$ 0,580	1	30/03 y 30/09	25% el 30/09/2030; 25% el 31/03/2031; 25% el 30/09/2032; 25% al vencimiento

Bonos en Pesos ajustados por CER (Inflación)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	TX23	Tesoro nacional	1,400%	Argentina	25/3/2023	1,354%	0,47	\$ 302,000	1	25/03 y 25/09	Bullet
Pesos	T2X3	Tesoro nacional	1,450%	Argentina	13/8/2023	2,909%	0,84	\$ 271,400	1	13/08 y 13/02	Bullet
Pesos	TX24	Tesoro nacional	1,500%	Argentina	25/3/2024	10,742%	1,45	\$ 266,500	1	25/03 y 25/09	Bullet
Pesos	T2X4	Tesoro nacional	1,550%	Argentina	26/7/2024	9,936%	1,77	\$ 198,000	1	26/07 y 26/01	Bullet
Pesos	TC25P	Tesoro nacional	4,000%	Argentina	27/4/2025	10,261%	2,40	\$ 590,000	1	27/04 y 27/10	Bullet
Pesos	TX25	Tesoro nacional	1,800%	Argentina	9/11/2025	8,119%	2,99	\$ 110,000	1	09/05 y 09/11	Bullet
Pesos	TX26	Tesoro nacional	2,000%	Argentina	9/5/2026	7,796%	2,80	\$ 221,400	1	09/05 y 09/11	25% semestral desde 09/11/24
Pesos	TX28	Tesoro nacional	2,250%	Argentina	9/11/2028	9,045%	3,50	\$ 215,000	1	09/05 y 09/11	10% semestral desde 09/05/24
Pesos	DICP	Tesoro nacional	5,830%	Argentina	31/12/2033	9,394%	4,96	\$ 4.540,000	1	30/06 y 31/12	5% semestral desde 30/06/24
Pesos	PARP	Tesoro nacional	1,77% hasta 30/09/29; 2,48% hasta vencimiento	Argentina	31/12/2038	10,000%	9,44	\$ 1.968,000	1	31/03 y 30/09	5% semestral desde 30/09/29

Bonos en Pesos vinculados al Dólar Mayorista (Com. A 3500 BCRA)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	T2V2	Estado Nacional	0,200%	Argentina	30/11/2022	-15,713%	0,15	\$ 15.315,000	1	30/11 y 30/05	Bullet
Pesos	TV23	Estado Nacional	0,300%	Argentina	28/4/2023	-5,869%	0,56	\$ 15.450,000	1	28/04 y 28/10	Bullet
Pesos	T2V3	Estado Nacional	0,000%	Argentina	31/7/2023	-3,262%	0,82	\$ 15.300,000	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	TV24	Estado Nacional	0,400%	Argentina	30/4/2024	3,677%	1,56	\$ 14.185,000	1	30/04 y 30/10	Bullet

Bonos duales CER + TNA vs Devaluación del Dólar Mayorista (Com. A 3500 BCRA)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	TDJ23	Tesoro Nacional	2,000%	Argentina	30/6/2023	-5,225%	0,73	\$ 15.670,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDL23	Tesoro Nacional	2,000%	Argentina	31/7/2023	-4,919%	0,82	\$ 15.700,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDS23	Tesoro Nacional	2,250%	Argentina	29/9/2023	-2,117%	0,98	\$ 15.390,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDF24	Tesoro Nacional	3,000%	Argentina	28/2/2024	1,435%	1,40	\$ 14.600,000	1	Cupón Cero	Bullet

Letras a descuento ajustadas por CER (Inflación)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	X21O2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	21/10/2022	-14,950%	0,04	\$ 159,300	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X23N2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	23/11/2022	-11,365%	0,13	\$ 123,000	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X16D2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	16/12/2022	-4,263%	0,20	\$ 148,150	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X20E3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	20/1/2023	-2,417%	0,29	\$ 155,300	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X17F3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	17/2/2023	-1,290%	0,37	\$ 149,800	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X21A3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	21/4/2023	0,325%	0,54	\$ 142,850	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X19Y3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	19/5/2023	0,992%	0,62	\$ 136,450	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X16J3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	16/6/2023	1,406%	0,70	\$ 107,800	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	X18S3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	18/9/2023	1,883%	0,95	\$ 99,800	1	Cupón cero	Bullet

Letras a descuento en pesos											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	S31O2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/10/2022	69,523%	0,07	\$ 96,310	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S30N2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	30/11/2022	89,614%	0,15	\$ 90,650	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S16D2	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	16/12/2022	98,502%	0,20	\$ 87,350	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S31E3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/1/2023	106,520%	0,32	\$ 79,100	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S28F3	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	28/2/2023	108,735%	0,40	\$ 74,501	1	Cupón cero	Bullet

Títulos BADLAR											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR estimada	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	PBA25	Prov. Bs. As.	3,750%	Argentina	12/4/2025	105,612%	1,12	\$ 107,650	1.000	12/01, 12/04, 12/07 y 12/10	Bullet
Pesos	TB24	Tesoro Nacional	5,000%	Argentina	18/4/2024	86,512%	1,16	\$ 108,500	1	18/01, 18/04, 18/07 y 18/10	Bullet

Bonos en Pesos a tasa fija											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
Pesos	TO23	Estado Nacional	16,000%	Argentina	17/10/2023	111,499%	0,85	\$ 63,000	1	17/10 y 17/04	Bullet
Pesos	TO26	Estado Nacional	15,500%	Argentina	17/10/2026	101,347%	1,35	\$ 30,480	1	17/10 y 17/05	Bullet

Bonos Soberanos en Dólares											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cantidad mínima	Intereses	Amortización
USD	AL29D	Estado Nacional	1,00%	Argentina	9/7/2029	52,036%	3,50	\$ 20,000	1	09/01 y 09/07	10% semestral desde 01/2025
USD	AL30D	Estado Nacional	0,50% hasta 07/2023; 0,75% hasta 07/2027; 1,75% hasta vencimiento	Argentina	9/7/2030	50,170%	3,55	\$ 19,211	1	09/01 y 09/07	4% en 07/2024 y 8% semestral desde 01/2025
USD	AL35D	Estado Nacional	1,125% hasta 07/2022; 1,50% hasta 07/2023; 3,625% hasta 07/2024; 4,125% hasta 07/2027; 4,75% hasta 07/2028; 5,00% hasta el vencimiento	Argentina	9/7/2035	30,235%	5,97	\$ 19,250	1	09/01 y 09/07	10% semestral desde 01/2031
USD	AE38D	Estado Nacional	2,50% hasta 07/2022; 3,875% hasta 07/2023; 4,25% hasta 07/2024; 5,00% hasta el vencimiento	Argentina	9/1/2038	31,994%	4,77	\$ 23,900	1	09/01 y 09/07	4,545% semestral desde 07/2027
USD	AL41D	Estado Nacional	2,00% hasta 07/2022; 3,50% hasta 07/2029; 4,875% hasta el vencimiento	Argentina	9/7/2041	27,866%	5,48	\$ 21,900	1	09/01 y 09/07	3,571% semestral desde 01/2028
USD	GD29D	Estado Nacional	Ídem AL29D	Nueva York	9/7/2029	49,535%	3,53	\$ 21,200	1	09/01 y 09/07	Ídem AL29D
USD	GD30D	Estado Nacional	Ídem AL30D	Nueva York	9/7/2030	45,172%	3,65	\$ 21,700	1	09/01 y 09/07	Ídem AL30D
USD	GD35D	Estado Nacional	Ídem AL35D	Nueva York	9/7/2035	29,304%	6,07	\$ 20,100	1	09/01 y 09/07	Ídem AL35D
USD	GD38D	Estado Nacional	Ídem AE38D	Nueva York	9/1/2038	29,721%	4,97	\$ 26,011	1	09/01 y 09/07	Ídem AE38D
USD	GD41D	Estado Nacional	Ídem AL41D	Nueva York	9/7/2041	26,260%	5,69	\$ 23,501	1	09/01 y 09/07	Ídem AL41D
USD	GD46D	Estado Nacional	0,125% hasta 09/07/2021; 1,125% hasta 09/07/2022; 1,50% hasta 09/07/2023; 3,625% hasta 09/07/2024; 4,125% hasta 09/07/2027; 4,375% hasta 09/07/2028; 5,00% hasta el vencimiento	Argentina	9/7/2046	31,042%	4,70	\$ 21,400	1	09/01 y 09/07	2,273% semestral desde 01/2025

(\*) Las tablas y gráficos son de elaboración propia en base a la información de la base de datos de mercado al cierre del 05/10/2022. Este informe tiene el mero propósito de brindar información, por lo que no constituye ni una oferta ni una recomendación de compra o venta de los instrumentos financieros en él mencionado.

Fuentes:

1) Prospectos de Títulos Públicos: <https://www.argentina.gob.ar/economia/finanzas/estructura-financiera-de-titulos-publicos>

2) Prospectos de Obligaciones Negociables: <https://www.cnv.gov.ar/sitioweb/empresas?seccion=buscador>