

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 826,25 CCL⁽¹⁾: \$ 1.248,74 MEP⁽²⁾: \$ 1.176,00 Brecha: 51,13% Devaluación⁽³⁾: 2,02%
 (1) Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con AL30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de diciembre.

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20F4	\$ 168,85	CER	-69,1%	92,9%	0,05	20	0,33%	0,96%
X20Y4	\$ 154,50	CER	-70,7%	146,5%	0,30	110	-2,22%	0,98%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 784,60	Duales (CER)	-99,8%	-323,0%	0,07	28	0,65%	0,98%
TDA24	\$ 863,00	Duales (CER)	-89,1%	24,5%	0,24	90	2,25%	3,09%
TDJ24	\$ 887,90	Duales (CER)	-64,1%	148,2%	0,41	151	0,55%	-2,42%
TDG24	\$ 964,90	Duales (CER)	-66,7%	107,2%	0,58	212	0,19%	1,00%
TDE25	\$ 1.100,00	Duales (CER)	-52,9%	151,4%	1,00	366	-1,43%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 817,20	Dólar linked	5,3%	138,9%	0,23	90	0,15%	0,41%
TZV4	\$ 945,00	Dólar linked	-17,9%	131,2%	0,76	243	2,16%	-2,78%
TV25	\$ 963,00	Dólar linked	-11,9%	193,2%	1,21	425	2,39%	1,37%
TDF24	\$ 784,60	Duales (DL)	105,0%	199,6%	0,07	28	0,65%	0,98%
TDA24	\$ 863,00	Duales (DL)	-16,7%	108,4%	0,24	90	2,25%	3,09%
TDJ24	\$ 887,90	Duales (DL)	-16,3%	124,7%	0,41	151	0,55%	-2,42%
TDG24	\$ 964,90	Duales (DL)	-23,7%	113,7%	0,58	212	0,19%	1,00%
TDE25	\$ 1.100,00	Duales (DL)	-25,0%	135,6%	1,00	366	-1,43%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.257,50	CER	-78,7%	0,14	-0,12%	0,44%
T3X4	\$ 324,00	CER	-71,4%	0,20	-1,22%	0,47%
T6X4	\$ 248,75	CER	-68,0%	0,30	-0,46%	1,08%
T2X4	\$ 1.090,00	CER	-52,8%	0,48	-2,68%	5,57%
T4X4	\$ 363,50	CER	-39,0%	0,69	-2,15%	10,82%
TSX4	\$ 285,00	CER	-28,5%	0,84	-2,40%	7,14%
TZ5	\$ 351,00	CER	-24,5%	1,30	-0,43%	8,47%
TX25	\$ 604,00	CER	-14,4%	1,75	-2,30%	-1,23%
TX26	\$ 1.065,00	CER	-7,3%	1,78	-1,57%	0,80%
TX28	\$ 1.190,00	CER	-8,4%	2,65	-1,65%	6,25%
DICP	\$ 21.600,00	CER	1,8%	4,64	-1,23%	0,75%
PARP	\$ 12.600	CER	3,2%	9,23	0,80%	0,80%
TO26	\$ 39,80	Fija	87,1%	1,80	6,56%	3,08%
BDC24	\$ 116,35	Badlar	86,9%	0,15	0,52%	2,96%
PBA25	\$ 100,75	Badlar	188,7%	0,74	0,40%	-0,98%
BDC28	\$ 137,50	Badlar	138,0%	1,04	1,85%	4,17%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 41,00	41%	38,8%	2,50	1,00%	2,44%	-0,02%	-2,15%
GD29	\$ 42,20	42%	37,2%	2,52	1,00%	2,37%	-2,09%	-7,05%
AL30	\$ 39,60	39%	37,3%	2,56	1,75%	4,42%	0,23%	-1,12%
GD30	\$ 42,75	43%	33,3%	2,64	1,75%	4,09%	-0,48%	-1,73%
AL35	\$ 35,20	34%	21,6%	6,21	4,75%	13,49%	0,57%	-1,68%
GD35	\$ 35,94	36%	21,2%	6,24	4,75%	13,22%	0,53%	-2,60%
AE38	\$ 37,30	36%	23,8%	5,09	5,00%	13,40%	0,13%	-1,76%
GD38	\$ 41,00	41%	21,6%	5,28	5,00%	12,20%	-0,73%	-3,55%
AL41	\$ 34,00	33%	20,6%	6,16	4,88%	14,34%	-1,02%	-4,60%
GD41	\$ 35,89	36%	19,5%	6,29	4,88%	13,58%	0,03%	-0,31%
GD46	\$ 38,80	38%	19,9%	5,28	3,63%	9,34%	1,31%	-1,77%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
0	31/1/2024	\$ 826,30	0,0%	0,0%	0,0%	0,00%
29	29/2/2024	\$ 853,00	3,2%	49,3%	40,7%	3,40%
56	27/3/2024	\$ 912,00	10,4%	90,3%	67,6%	5,51%
90	30/4/2024	\$ 1.040,00	25,9%	154,2%	104,9%	8,09%
121	31/5/2024	\$ 1.142,50	38,3%	165,8%	115,5%	8,49%
149	28/6/2024	\$ 1.249,00	51,2%	175,2%	125,3%	8,80%
182	31/7/2024	\$ 1.365,00	65,2%	173,7%	130,8%	8,75%
212	30/8/2024	\$ 1.467,00	77,5%	168,7%	133,5%	8,59%
243	30/9/2024	\$ 1.575,00	90,6%	163,5%	136,1%	8,41%
274	31/10/2024	\$ 1.660,00	100,9%	153,3%	134,4%	8,05%
303	29/11/2024	\$ 1.748,00	111,6%	146,6%	134,4%	7,81%
334	30/12/2024	\$ 1.840,00	122,7%	139,9%	134,1%	7,56%

* Supuestos de inflación: 28% enero, 20% febrero, 15% marzo y abril, y 12% de mayo en adelante.
 Supuestos de Devaluación: 10% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

Inflación⁽⁴⁾: 25,50% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,00% Tasa Caución: 81,00%

