

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 818,15 CCL⁽¹⁾: \$ 1.213,05 MEP⁽²⁾: \$ 1.167,78 Brecha: 48,27% Devaluación⁽³⁾: 2,04% Inflación⁽⁴⁾: 25,50% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,63% Tasa Caución: 87,70%

⁽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	\$ 163,75	CER	-66,6%	86,8%	0,09	35	0,24%	0,40%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 772,00	Duales (CER)	-98,7%	-193,6%	0,11	43	-0,52%	0,25%
TDA24	\$ 821,70	Duales (CER)	-86,1%	46,0%	0,28	105	0,21%	-0,22%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (CER)	-67,8%	148,9%	0,45	166	1,91%	2,49%
TDG24	\$ 915,00	Duales (CER)	-65,2%	130,9%	0,62	227	2,58%	2,23%
TDE25	\$ 915,00	Duales (CER)	-45,9%	211,4%	1,04	381	0,55%	1,61%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 804,00	Dólar linked	6,9%	144,7%	0,26	105	0,50%	-0,75%
TZV4	\$ 908,00	Dólar linked	-13,3%	144,9%	0,77	258	3,65%	4,37%
TV25	\$ 870,10	Dólar linked	-4,5%	226,7%	1,21	440	2,61%	3,58%
TDF24	\$ 772,00	Duales (DL)	66,8%	182,4%	0,11	43	-0,52%	0,25%
TDA24	\$ 821,70	Duales (DL)	-1,7%	132,9%	0,28	105	0,21%	-0,22%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (DL)	-20,2%	119,4%	0,45	166	1,91%	2,49%
TDG24	\$ 915,00	Duales (DL)	-16,7%	131,5%	0,62	227	2,58%	2,23%
TDE25	\$ 915,00	Duales (DL)	-10,3%	186,2%	1,04	381	0,55%	1,61%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.288,00	CER	-82,2%	0,18	3,95%	3,12%
T3X4	\$ 330,00	CER	-75,7%	0,24	-2,94%	-0,90%
T6X4	\$ 265,25	CER	-75,5%	0,34	0,28%	0,86%
T2X4	\$ 1.167,00	CER	-61,4%	0,52	2,73%	0,60%
T4X4	\$ 396,50	CER	-49,5%	0,73	0,89%	0,44%
T5X4	\$ 320,00	CER	-41,3%	0,88	5,47%	7,93%
T2X5	\$ 374,50	CER	-33,0%	1,48	6,39%	8,24%
TX25	\$ 712,00	CER	-24,7%	1,80	-30,54%	-28,12%
TX26	\$ 1.159,00	CER	-14,7%	1,87	8,32%	10,38%
TX28	\$ 1.165,50	CER	-10,0%	2,73	2,87%	13,65%
DICP	\$ 23.950,00	CER	-1,8%	4,99	6,44%	11,92%
PARP	\$ 13.650,00	CER	1,6%	9,47	10,17%	16,17%
TO26	\$ 34,20	Fija	100,6%	1,77	-1,72%	-2,01%
BDC24	\$ 111,95	Badlar	100,9%	0,19	2,24%	1,77%
PBA25	\$ 101,80	Badlar	170,9%	0,79	-0,39%	0,34%
BDC28	\$ 126,00	Badlar	151,2%	1,03	0,00%	1,57%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 38,40	38%	41,7%	2,50	1,00%	2,60%	0,00%	0,79%
GD29	\$ 41,80	41%	37,0%	2,56	1,00%	2,39%	-0,24%	1,70%
AL30	\$ 37,40	37%	39,7%	2,55	1,75%	4,68%	-1,06%	-0,53%
GD30	\$ 41,90	42%	33,7%	2,67	1,75%	4,18%	0,00%	0,72%
AL35	\$ 34,00	33%	22,1%	6,20	4,75%	13,97%	-0,56%	-0,85%
GD35	\$ 35,40	35%	21,3%	6,27	4,75%	13,42%	0,14%	0,06%
AE38	\$ 36,54	35%	24,1%	5,11	5,00%	13,68%	-0,57%	-1,24%
GD38	\$ 42,00	42%	20,8%	5,38	5,00%	11,90%	0,00%	0,96%
AL41	\$ 34,00	33%	20,4%	6,22	4,88%	14,34%	-1,65%	-1,45%
GD41	\$ 35,20	35%	19,7%	6,30	4,88%	13,85%	-0,56%	-1,42%
GD46	\$ 36,80	36%	20,9%	5,16	3,63%	9,85%	0,82%	1,38%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
15	31/1/2024	\$ 829,30	1,4%	39,0%	33,2%	2,78%
44	29/2/2024	\$ 866,00	5,8%	60,2%	48,5%	4,01%
71	27/3/2024	\$ 959,00	17,2%	126,3%	88,5%	7,04%
105	30/4/2024	\$ 1.077,50	31,7%	160,4%	110,2%	8,30%
136	31/5/2024	\$ 1.195,00	46,1%	176,4%	123,6%	8,84%
164	28/6/2024	\$ 1.315,00	60,7%	187,5%	135,2%	9,20%
197	31/7/2024	\$ 1.400,00	71,1%	170,5%	131,8%	8,65%
227	30/8/2024	\$ 1.550,00	89,5%	179,4%	143,8%	8,94%
258	30/9/2024	\$ 1.650,00	101,7%	169,8%	143,8%	8,62%
289	31/10/2024	\$ 1.690,00	106,6%	150,0%	134,6%	7,93%
318	29/11/2024	\$ 1.820,00	122,5%	150,4%	140,6%	7,95%
349	30/12/2024	\$ 1.915,00	134,1%	143,4%	140,2%	7,69%

* Supuestos de inflación: 30% enero, 20% febrero y marzo, 15% abril y 12% de mayo en adelante.
Supuestos de Devaluación: 10% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

