

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 818,61 CCL⁽¹⁾: \$ 1.277,54 MEP⁽²⁾: \$ 1.225,40 Brecha: 56,06% Devaluación⁽³⁾: 1,96%
 (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	\$ 164,15	CER	-67,2%	86,8%	0,09	34	0,24%	0,64%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 772,00	Duales (CER)	-98,8%	-193,6%	0,11	42	0,00%	0,25%
TDA24	\$ 830,50	Duales (CER)	-86,7%	46,0%	0,28	104	1,07%	0,85%
TDI24	\$ 936,00	Duales (CER)	-70,1%	148,9%	0,45	165	3,43%	6,00%
TDG24	\$ 955,00	Duales (CER)	-67,5%	130,9%	0,61	226	4,37%	6,70%
TDE25	\$ 925,00	Duales (CER)	-46,4%	211,4%	1,04	380	1,09%	2,72%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 817,80	Dólar linked	0,9%	144,7%	0,28	104	1,72%	0,95%
T2V4	\$ 950,00	Dólar linked	-18,7%	144,9%	0,80	257	4,63%	9,20%
TV25	\$ 905,00	Dólar linked	-7,5%	226,7%	1,23	439	4,01%	7,74%
TDF24	\$ 772,00	Duales (DL)	69,9%	182,4%	0,11	42	0,00%	0,25%
TDA24	\$ 830,50	Duales (DL)	-5,2%	132,9%	0,28	104	1,07%	0,85%
TDI24	\$ 936,00	Duales (DL)	-26,0%	119,4%	0,45	165	3,43%	6,00%
TDG24	\$ 955,00	Duales (DL)	-22,3%	131,5%	0,61	226	4,37%	6,70%
TDE25	\$ 925,00	Duales (DL)	-11,2%	186,2%	1,04	380	1,09%	2,72%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.265,00	CER	-80,4%	0,18	-1,79%	1,28%
T3X4	\$ 333,00	CER	-76,6%	0,24	0,91%	0,00%
T6X4	\$ 263,40	CER	-75,0%	0,33	-0,70%	0,15%
T2X4	\$ 1.170,00	CER	-61,5%	0,52	0,26%	0,86%
T4X4	\$ 390,00	CER	-48,2%	0,73	-1,64%	-1,20%
TSX4	\$ 324,00	CER	-42,0%	0,88	1,25%	9,27%
T2X5	\$ 378,50	CER	-33,5%	1,49	1,07%	9,39%
TX25	\$ 613,00	CER	-18,0%	1,79	-13,90%	-38,11%
TX26	\$ 1.180,00	CER	-15,4%	1,87	1,81%	12,38%
TX28	\$ 1.205,00	CER	-10,9%	2,75	3,39%	17,50%
DICP	\$ 25.000,00	CER	-2,6%	5,06	4,38%	16,82%
PARP	\$ 13.205,00	CER	2,0%	9,42	-3,26%	12,38%
TO26	\$ 34,50	Fija	99,9%	1,77	0,88%	-1,15%
BDC24	\$ 111,25	Badlar	109,9%	0,19	-0,63%	1,14%
PBA25	\$ 100,00	Badlar	178,4%	0,78	-1,77%	-1,43%
BDC28	\$ 128,00	Badlar	148,3%	1,04	1,59%	3,18%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 38,20	38%	42,0%	2,50	1,00%	2,62%	-0,52%	0,26%
GD29	\$ 41,50	41%	37,4%	2,55	1,00%	2,41%	-0,72%	0,97%
AL30	\$ 37,38	37%	39,7%	2,55	1,75%	4,68%	-0,05%	-0,59%
GD30	\$ 41,13	41%	34,7%	2,65	1,75%	4,25%	-1,84%	-1,13%
AL35	\$ 34,10	33%	22,1%	6,20	4,75%	13,93%	0,29%	-0,55%
GD35	\$ 35,01	35%	21,6%	6,25	4,75%	13,57%	-1,10%	-1,05%
AE38	\$ 36,20	35%	24,3%	5,08	5,00%	13,81%	-0,93%	-2,16%
GD38	\$ 41,20	41%	21,3%	5,34	5,00%	12,14%	-1,90%	-0,96%
AL41	\$ 33,69	33%	20,6%	6,19	4,88%	14,47%	-0,91%	-2,35%
GD41	\$ 35,00	35%	19,9%	6,29	4,88%	13,93%	-0,57%	-1,99%
GD46	\$ 36,00	35%	21,5%	5,09	3,63%	10,07%	-2,17%	-0,83%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
14	31/1/2024	\$ 829,60	1,3%	41,6%	35,0%	2,94%
43	29/2/2024	\$ 868,00	6,0%	64,4%	51,2%	4,23%
70	27/3/2024	\$ 962,50	17,6%	132,6%	91,7%	7,29%
104	30/4/2024	\$ 1.087,00	32,8%	170,5%	115,1%	8,65%
135	31/5/2024	\$ 1.210,00	47,8%	187,6%	129,3%	9,20%
163	28/6/2024	\$ 1.330,00	62,5%	196,5%	139,9%	9,48%
196	31/7/2024	\$ 1.450,00	77,1%	190,0%	143,6%	9,28%
226	30/8/2024	\$ 1.561,00	90,7%	183,6%	146,5%	9,08%
257	30/9/2024	\$ 1.670,00	104,0%	175,3%	147,7%	8,80%
288	31/10/2024	\$ 1.765,00	115,6%	164,8%	146,5%	8,45%
317	29/11/2024	\$ 1.845,00	125,4%	154,9%	144,4%	8,11%
348	30/12/2024	\$ 1.935,00	136,4%	146,5%	143,0%	7,81%

* 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.

Inflación⁽⁴⁾: 25,50% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,75% Tasa Caución: 88,01%

