

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 827,35 CCL⁽¹⁾: \$ 1.301,48 MEP⁽²⁾: \$ 1.229,30 Brecha: 57,31% Devaluación⁽³⁾: 1,99%
 (1) Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con AL30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de diciembre.

Inflación⁽⁴⁾: 25,50% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,69% Tasa Caución: 84,00%

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20F4	\$ 170,30	CER	-62,0%	96,2%	0,04	18	0,35%	1,82%
X20Y4	\$ 153,50	CER	-68,3%	155,4%	0,28	108	-0,39%	0,33%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 789,00	Duales (CER)	-99,9%	-388,9%	0,06	26	0,27%	1,54%
TDA24	\$ 865,00	Duales (CER)	-88,9%	24,6%	0,23	88	-0,12%	3,33%
TDJ24	\$ 886,00	Duales (CER)	-62,2%	153,2%	0,40	149	0,34%	-2,63%
TDG24	\$ 994,90	Duales (CER)	-67,5%	100,6%	0,56	210	1,47%	4,15%
TDE25	\$ 1.080,00	Duales (CER)	-51,0%	157,8%	0,99	364	1,89%	-1,82%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 820,50	Dólar linked	4,3%	136,7%	0,22	88	0,80%	0,81%
TZV4	\$ 1.010,00	Dólar linked	-26,0%	111,9%	0,81	241	4,12%	3,91%
TV25	\$ 980,00	Dólar linked	-13,2%	187,0%	1,21	423	1,24%	3,16%
TDF24	\$ 789,00	Duales (DL)	117,6%	204,2%	0,06	26	0,27%	1,54%
TDA24	\$ 865,00	Duales (DL)	-17,8%	106,2%	0,23	88	-0,12%	3,33%
TDJ24	\$ 886,00	Duales (DL)	-16,0%	124,7%	0,40	149	0,34%	-2,63%
TDG24	\$ 994,90	Duales (DL)	-28,0%	103,9%	0,56	210	1,47%	4,15%
TDE25	\$ 1.080,00	Duales (DL)	-23,7%	138,8%	0,99	364	1,89%	-1,82%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.276,00	CER	-79,1%	0,13	1,11%	1,92%
T3X4	\$ 323,75	CER	-68,7%	0,19	0,39%	0,39%
T6X4	\$ 248,50	CER	-66,0%	0,28	-0,56%	0,98%
T2X4	\$ 1.107,00	CER	-52,2%	0,47	2,50%	7,22%
T4X4	\$ 366,00	CER	-37,4%	0,68	0,85%	11,59%
T5X4	\$ 289,90	CER	-27,8%	0,83	1,72%	8,98%
T2X5	\$ 347,00	CER	-21,6%	1,25	-0,29%	7,23%
TX25	\$ 597,00	CER	-12,4%	1,74	-0,50%	-2,37%
TX26	\$ 1.093,00	CER	-7,2%	1,77	0,60%	3,45%
TX28	\$ 1.205,00	CER	-7,8%	2,63	0,42%	7,59%
DICP	\$ 22.950,00	CER	1,1%	4,68	-0,22%	7,04%
PARP	\$ 12,500	CER	3,7%	9,17	0,00%	0,00%
TO26	\$ 39,94	Fija	87,5%	1,79	1,76%	3,44%
BDC24	\$ 115,50	Badlar	108,4%	0,14	-0,22%	2,21%
PBA25	\$ 101,10	Badlar	193,7%	0,73	-0,30%	-0,64%
BDC28	\$ 140,00	Badlar	137,4%	1,03	1,82%	6,06%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 41,39	41%	38,5%	2,49	1,00%	2,42%	1,22%	-1,22%
GD29	\$ 44,20	44%	34,9%	2,54	1,00%	2,26%	0,45%	-2,64%
AL30	\$ 39,87	40%	37,1%	2,55	1,75%	4,39%	0,55%	-0,45%
GD30	\$ 43,64	44%	32,4%	2,65	1,75%	4,01%	1,72%	0,32%
AL35	\$ 35,18	34%	21,7%	6,19	4,75%	13,50%	-0,62%	-1,73%
GD35	\$ 36,40	36%	21,0%	6,25	4,75%	13,05%	1,39%	-1,36%
AE38	\$ 37,55	36%	23,7%	5,09	5,00%	13,32%	1,49%	-1,11%
GD38	\$ 42,20	42%	21,0%	5,32	5,00%	11,85%	0,48%	-0,73%
AL41	\$ 34,80	34%	20,2%	6,20	4,88%	14,01%	2,05%	-2,36%
GD41	\$ 36,00	36%	19,5%	6,28	4,88%	13,54%	0,28%	0,00%
GD46	\$ 39,50	38%	19,5%	5,32	3,63%	9,18%	2,07%	0,00%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
27	29/2/2024	\$ 848,60	2,6%	40,9%	34,7%	2,90%
58	31/3/2024	\$ 901,00	8,9%	71,0%	56,0%	4,57%
84	26/4/2024	\$ 1.023,50	23,7%	152,1%	103,0%	8,01%
119	31/5/2024	\$ 1.140,00	37,8%	167,3%	115,9%	8,54%
149	30/6/2024	\$ 1.260,00	52,3%	180,2%	128,1%	8,97%
178	29/7/2024	\$ 1.373,00	66,0%	182,5%	135,2%	9,04%
211	31/8/2024	\$ 1.495,00	80,7%	178,3%	139,6%	8,90%
240	29/9/2024	\$ 1.600,00	93,4%	172,7%	142,0%	8,72%
272	31/10/2024	\$ 1.695,00	104,9%	161,8%	140,7%	8,35%
302	30/11/2024	\$ 1.770,00	113,9%	150,7%	137,7%	7,96%
332	30/12/2024	\$ 1.860,00	124,8%	143,7%	137,2%	7,70%

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

