

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 829,05 CCL⁽¹⁾: \$ 1.294,56 MEP⁽²⁾: \$ 1.203,60 Brecha: 56,15% 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	\$ 170,41	CER	-57,5%	101,7%	0,04	15	0,06%	0,06%
X20Y4	\$ 153,85	CER	-68,1%	128,2%	0,28	105	0,23%	0,23%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 790,60	Duales (CER)	-99,9%	-410,1%	0,06	23	0,20%	0,20%
TDA24	\$ 849,00	Duales (CER)	-87,9%	1,2%	0,23	85	-1,85%	-1,85%
TDJ24	\$ 881,40	Duales (CER)	-61,3%	137,3%	0,39	146	-0,52%	-0,52%
TDG24	\$ 985,00	Duales (CER)	-66,6%	90,8%	0,56	207	-1,00%	-1,00%
TDE25	\$ 1.075,00	Duales (CER)	-50,4%	147,3%	0,98	361	-0,46%	-0,46%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 803,50	Dólar linked	14,7%	149,1%	0,19	85	-2,07%	-2,07%
T2V4	\$ 978,00	Dólar linked	-22,2%	120,4%	0,77	238	-3,17%	-3,17%
TV25	\$ 989,90	Dólar linked	-14,0%	184,0%	1,21	420	1,01%	1,01%
TDF24	\$ 790,60	Duales (DL)	120,3%	205,1%	0,06	23	0,20%	0,20%
TDA24	\$ 849,00	Duales (DL)	-10,7%	116,4%	0,23	85	-1,85%	-1,85%
TDJ24	\$ 881,40	Duales (DL)	-14,8%	126,5%	0,39	146	-0,52%	-0,52%
TDG24	\$ 985,00	Duales (DL)	-26,7%	106,5%	0,56	207	-1,00%	-1,00%
TDE25	\$ 1.075,00	Duales (DL)	-23,4%	139,7%	0,98	361	-0,46%	-0,46%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.274,00	CER	-78,3%	0,13	-0,16%	-0,16%
T3X4	\$ 324,00	CER	-68,1%	0,18	0,08%	0,08%
T6X4	\$ 250,00	CER	-66,2%	0,28	0,60%	0,60%
T2X4	\$ 1.125,50	CER	-53,4%	0,47	1,67%	1,67%
T4X4	\$ 369,25	CER	-37,7%	0,68	0,89%	0,89%
T5X4	\$ 294,00	CER	-28,4%	0,83	1,41%	1,41%
T2X5	\$ 351,50	CER	-22,1%	1,25	1,30%	1,30%
TX25	\$ 596,90	CER	-12,0%	1,74	-0,02%	-0,02%
TX26	\$ 1.108,00	CER	-7,5%	1,77	1,37%	1,37%
TX28	\$ 1.200,00	CER	-7,4%	2,62	-0,41%	-0,41%
DICP	\$ 24.500,00	CER	-0,1%	4,79	6,75%	6,75%
PARP	\$ 12.500	CER	3,7%	9,16	0,00%	0,00%
TO26	\$ 38,65	Fija	91,2%	1,76	-3,23%	-3,23%
BDC24	\$ 113,20	Badlar	145,0%	0,14	-1,99%	-1,99%
PBA25	\$ 101,25	Badlar	195,0%	0,72	0,15%	0,15%
BDC28	\$ 134,80	Badlar	147,6%	0,99	-3,71%	-3,71%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 42,60	42%	36,9%	2,51	1,00%	2,35%	2,92%	2,92%
GD29	\$ 45,60	45%	33,3%	2,56	1,00%	2,19%	3,17%	3,17%
AL30	\$ 41,50	41%	35,0%	2,59	1,75%	4,22%	4,09%	4,09%
GD30	\$ 45,15	45%	30,8%	2,68	1,75%	3,88%	3,46%	3,46%
AL35	\$ 35,70	34%	21,4%	6,21	4,75%	13,31%	1,48%	1,48%
GD35	\$ 36,96	37%	20,7%	6,27	4,75%	12,85%	1,54%	1,54%
AE38	\$ 38,65	37%	23,0%	5,14	5,00%	12,94%	2,93%	2,93%
GD38	\$ 42,40	42%	20,9%	5,32	5,00%	11,79%	0,47%	0,47%
AL41	\$ 35,60	34%	19,7%	6,25	4,88%	13,69%	2,30%	2,30%
GD41	\$ 36,50	37%	19,2%	6,31	4,88%	13,36%	1,39%	1,39%
GD46	\$ 40,40	39%	19,0%	5,40	3,63%	8,97%	2,28%	2,28%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
24	29/2/2024	\$ 846,00	2,0%	36,0%	31,1%	2,60%
55	31/3/2024	\$ 896,50	8,1%	68,0%	54,0%	4,42%
81	26/4/2024	\$ 1.014,00	22,3%	147,8%	100,5%	7,86%
116	31/5/2024	\$ 1.126,50	35,9%	162,4%	112,9%	8,37%
146	30/6/2024	\$ 1.248,00	50,5%	178,0%	126,3%	8,89%
175	29/7/2024	\$ 1.362,00	64,3%	181,6%	134,1%	9,01%
208	31/8/2024	\$ 1.490,00	79,7%	179,8%	139,9%	8,95%
237	29/9/2024	\$ 1.605,00	93,6%	176,6%	144,1%	8,85%
269	31/10/2024	\$ 1.697,00	104,7%	164,3%	142,1%	8,44%
299	30/11/2024	\$ 1.772,00	113,7%	152,8%	138,8%	8,03%
329	30/12/2024	\$ 1.850,00	123,1%	143,6%	136,6%	7,70%

* 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: 108,88% Tasa Caución: 86,00%

