

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 829,55 CCL⁽¹⁾: \$ 1.254,44 MEP⁽²⁾: \$ 1.177,75 Brecha: 51,22% 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.

Inflación⁽⁴⁾: 25,50% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 108,88% Tasa Caución: 98,00%

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20F4	\$ 170,90	CER	-54,7%	101,1%	0,03	14	0,29%	0,35%
X20Y4	\$ 156,75	CER	-69,7%	147,7%	0,28	104	1,88%	2,12%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 794,40	Duales (CER)	-99,9%	-437,3%	0,05	22	0,48%	0,68%
TDA24	\$ 855,00	Duales (CER)	-88,2%	30,7%	0,22	84	0,71%	-1,16%
TDJ24	\$ 887,10	Duales (CER)	-61,4%	154,8%	0,39	145	0,65%	0,12%
TDG24	\$ 989,00	Duales (CER)	-66,6%	103,3%	0,56	206	0,41%	-0,59%
TDE25	\$ 1.100,00	Duales (CER)	-51,3%	153,9%	0,98	360	2,33%	1,85%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 808,00	Dólar linked	13,1%	147,0%	0,19	84	0,56%	-1,52%
T2V4	\$ 970,00	Dólar linked	-21,1%	122,9%	0,76	237	-0,82%	-3,96%
TV25	\$ 982,50	Dólar linked	-13,3%	186,2%	1,20	419	-0,75%	0,26%
TDF24	\$ 794,40	Duales (DL)	118,0%	203,3%	0,05	22	0,48%	0,68%
TDA24	\$ 855,00	Duales (DL)	-12,8%	113,3%	0,22	84	0,71%	-1,16%
TDJ24	\$ 887,10	Duales (DL)	-15,9%	124,6%	0,39	145	0,65%	0,12%
TDG24	\$ 989,00	Duales (DL)	-27,1%	105,6%	0,56	206	0,41%	-0,59%
TDE25	\$ 1.100,00	Duales (DL)	-25,0%	134,3%	0,98	360	2,33%	1,85%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.284,00	CER	-79,1%	0,13	0,78%	0,63%
T3X4	\$ 332,00	CER	-71,5%	0,18	2,47%	2,55%
T6X4	\$ 258,00	CER	-69,3%	0,28	3,20%	3,82%
T2X4	\$ 1.148,00	CER	-54,8%	0,46	2,00%	3,70%
T4X4	\$ 374,20	CER	-38,4%	0,67	1,34%	2,24%
T5X4	\$ 301,80	CER	-30,1%	0,82	2,65%	4,10%
T2X5	\$ 365,25	CER	-24,5%	1,28	3,91%	5,26%
TX25	\$ 605,10	CER	-12,4%	1,74	1,37%	1,36%
TX26	\$ 1.151,00	CER	-9,1%	1,78	3,88%	5,31%
TX26	\$ 119,95	CER	-5,6%	2,39	2,52%	7,10%
TX27	\$ 109,00	CER	-0,9%	3,39	1,16%	2,83%
TX28	\$ 1.200,00	CER	-7,2%	2,61	0,00%	-0,41%
DICP	\$ 25.740,00	CER	-1,0%	4,86	5,06%	12,16%
PARP	\$ 13,200	CER	3,2%	9,22	5,60%	5,60%
TO26	\$ 39,00	Fija	90,4%	1,77	0,91%	-2,35%
BDC24	\$ 112,50	Badlar	157,0%	0,14	-0,62%	-2,60%
PBA25	\$ 101,20	Badlar	193,6%	0,72	-0,05%	0,10%
BDC28	\$ 130,80	Badlar	153,6%	0,96	-2,97%	-6,57%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 43,40	43%	36,0%	2,52	1,00%	2,30%	1,88%	4,86%
GD29	\$ 45,52	45%	33,4%	2,55	1,00%	2,20%	-0,18%	2,99%
AL30	\$ 42,60	42%	33,7%	2,62	1,75%	4,11%	2,65%	6,85%
GD30	\$ 45,65	46%	30,3%	2,69	1,75%	3,83%	1,11%	4,61%
AL35	\$ 36,10	35%	21,2%	6,23	4,75%	13,16%	1,12%	2,62%
GD35	\$ 37,49	37%	20,4%	6,29	4,75%	12,67%	1,43%	2,99%
AE38	\$ 39,15	37%	22,7%	5,16	5,00%	12,77%	1,29%	4,26%
GD38	\$ 42,50	43%	20,8%	5,32	5,00%	11,76%	0,24%	0,71%
AL41	\$ 35,81	35%	19,6%	6,26	4,88%	13,61%	0,59%	2,90%
GD41	\$ 36,77	37%	19,1%	6,33	4,88%	13,26%	0,74%	2,14%
GD46	\$ 39,91	39%	19,3%	5,35	3,63%	9,08%	-1,21%	1,04%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
23	29/2/2024	\$ 846,20	2,0%	37,1%	31,9%	2,66%
54	31/3/2024	\$ 887,50	7,0%	57,8%	47,2%	3,88%
80	26/4/2024	\$ 1.007,00	21,4%	142,2%	97,6%	7,65%
115	31/5/2024	\$ 1.118,00	34,8%	157,8%	110,4%	8,21%
145	30/6/2024	\$ 1.238,00	49,2%	174,0%	123,9%	8,76%
174	29/7/2024	\$ 1.360,00	63,9%	182,1%	134,1%	9,03%
207	31/8/2024	\$ 1.485,00	79,0%	179,2%	139,3%	8,93%
236	29/9/2024	\$ 1.600,00	92,9%	176,2%	143,6%	8,83%
268	31/10/2024	\$ 1.690,00	103,7%	163,6%	141,3%	8,41%
298	30/11/2024	\$ 1.773,00	113,7%	153,5%	139,3%	8,06%
328	30/12/2024	\$ 1.847,00	122,7%	143,7%	136,5%	7,71%
359	30/1/2025	\$ 1.920,00	131,5%	134,7%	133,6%	7,37%

* 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.

