

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 830,65 CCL⁽¹⁾: \$ 1.245,18 MEP⁽²⁾: \$ 1.174,55 Brecha: 49,90% Devaluación⁽³⁾: 2,01%

⁽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: 95,70%

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20F4	\$ 173,75	CER	-55,3%	98,8%	0,02	12	1,36%	2,03%
X20Y4	\$ 156,00	CER	-68,0%	126,1%	0,26	102	0,16%	1,63%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 806,50	Duales (CER)	-100,0%	-654,6%	0,04	20	1,33%	2,22%
TDA24	\$ 867,00	Duales (CER)	-89,3%	-5,5%	0,21	82	0,53%	0,23%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (CER)	-62,1%	120,8%	0,38	143	1,71%	2,14%
TDG24	\$ 984,00	Duales (CER)	-65,6%	71,1%	0,54	204	-0,71%	-1,10%
TDE25	\$ 1.030,00	Duales (CER)	-46,9%	98,6%	0,96	358	3,00%	-4,63%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 811,50	Dólar linked	12,6%	144,8%	0,18	82	-0,22%	-1,10%
T2V4	\$ 974,50	Dólar linked	-22,0%	119,9%	0,75	235	-0,56%	-3,51%
TV25	\$ 963,00	Dólar linked	-11,8%	189,7%	1,18	417	-2,12%	-1,73%
TDF24	\$ 806,50	Duales (DL)	112,4%	197,3%	0,04	20	1,33%	2,22%
TDA24	\$ 867,00	Duales (DL)	-18,8%	103,5%	0,21	82	0,53%	0,23%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (DL)	-20,5%	115,4%	0,38	143	1,71%	2,14%
TDG24	\$ 984,00	Duales (DL)	-26,9%	105,2%	0,54	204	-0,71%	-1,10%
TDE25	\$ 1.030,00	Duales (DL)	-20,0%	148,5%	0,96	358	3,00%	-4,63%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.294,50	CER	-80,0%	0,11	0,82%	1,45%
T3X4	\$ 333,00	CER	-70,5%	0,16	0,15%	2,86%
T6X4	\$ 261,00	CER	-69,5%	0,26	0,77%	5,03%
T2X4	\$ 1.180,00	CER	-55,9%	0,45	2,30%	6,59%
T4X4	\$ 390,00	CER	-40,2%	0,66	2,28%	6,56%
T5X4	\$ 312,00	CER	-31,0%	0,81	3,14%	7,62%
T2X5	\$ 382,00	CER	-26,1%	1,29	3,57%	10,09%
TX25	\$ 621,00	CER	-12,3%	1,72	0,32%	4,02%
TX26	\$ 1.184,00	CER	-9,1%	1,76	0,00%	8,33%
TZX26	\$ 123,50	CER	-5,6%	2,38	0,49%	10,27%
TZX27	\$ 109,00	CER	-0,4%	3,38	0,00%	2,83%
TX28	\$ 1.233,00	CER	-7,1%	2,59	2,84%	2,32%
DICP	\$ 25.950,00	CER	-0,5%	4,80	0,00%	13,07%
PARP	\$ 12.710	CER	4,0%	9,11	1,68%	1,68%
TO26	\$ 39,10	Fija	91,3%	1,74	0,26%	-2,10%
BDC24	\$ 115,30	Badlar	136,7%	0,12	0,61%	-0,17%
PBA25	\$ 102,30	Badlar	195,3%	0,70	-0,49%	1,19%
BDC28	\$ 131,00	Badlar	156,3%	0,94	-1,87%	-6,43%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 41,95	41%	38,0%	2,48	1,00%	2,38%	0,59%	1,35%
GD29	\$ 43,75	43%	35,7%	2,51	1,00%	2,29%	-0,57%	-1,02%
AL30	\$ 40,70	40%	36,3%	2,55	1,75%	4,30%	0,00%	2,08%
GD30	\$ 44,30	44%	31,9%	2,64	1,75%	3,95%	0,44%	1,51%
AL35	\$ 34,00	33%	22,4%	6,11	4,75%	13,97%	-2,02%	-3,35%
GD35	\$ 34,90	35%	21,9%	6,16	4,75%	13,61%	-1,80%	-4,12%
AE38	\$ 37,00	35%	24,2%	5,03	5,00%	13,51%	-1,20%	-1,46%
GD38	\$ 40,58	41%	21,9%	5,22	5,00%	12,32%	0,72%	-3,84%
AL41	\$ 34,30	33%	20,5%	6,14	4,88%	14,21%	-1,45%	-1,45%
GD41	\$ 34,32	34%	20,5%	6,14	4,88%	14,20%	-1,65%	-4,67%
GD46	\$ 38,01	37%	20,5%	5,16	3,63%	9,54%	-1,53%	-3,77%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
21	29/2/2024	\$ 845,50	1,8%	36,1%	31,1%	2,60%
52	31/3/2024	\$ 883,00	6,3%	53,6%	44,2%	3,64%
78	26/4/2024	\$ 990,00	19,2%	127,3%	89,8%	7,08%
113	31/5/2024	\$ 1.099,00	32,3%	147,0%	104,4%	7,83%
143	30/6/2024	\$ 1.218,00	46,6%	165,6%	119,0%	8,48%
172	29/7/2024	\$ 1.347,00	62,2%	179,0%	131,9%	8,93%
205	31/8/2024	\$ 1.458,00	75,5%	172,3%	134,5%	8,71%
234	29/9/2024	\$ 1.570,00	89,0%	169,9%	138,8%	8,63%
266	31/10/2024	\$ 1.650,00	98,6%	156,4%	135,4%	8,16%
296	30/11/2024	\$ 1.762,00	112,1%	152,8%	138,3%	8,03%
326	30/12/2024	\$ 1.845,00	122,1%	144,4%	136,7%	7,73%
357	30/1/2025	\$ 1.950,00	134,8%	139,3%	137,8%	7,54%

* Supuestos de inflación: Según estimaciones del REM de enero elaborado por el BCRA.
Supuestos de Devaluación: 10% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

