

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 837,25 CCL⁽¹⁾: \$ 1.128,02 MEP⁽²⁾: \$ 1.077,78 Brecha: 34,73% Devaluación⁽³⁾: 2,01% Inflación⁽⁴⁾: 20,60% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,13% Tasa Caución: 90,01%

(1) Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con AL30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de enero.

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20Y4	\$ 164,50	CER	-70,4%	114,1%	0,24	90	-0,01%	3,20%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 825,50	Duales (CER)	-100,0%	-	0,02	8	0,30%	0,94%
TDA24	\$ 776,00	Duales (CER)	-79,5%	60,7%	0,19	70	-1,65%	-4,84%
TDJ24	\$ 887,50	Duales (CER)	-55,5%	140,5%	0,35	131	-1,44%	-0,84%
TDG24	\$ 888,00	Duales (CER)	-55,1%	105,8%	0,52	192	-3,79%	-5,03%
TDE25	\$ 1.003,50	Duales (CER)	-42,8%	108,4%	0,94	346	0,46%	10,27%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 765,00	Dólar linked	63,5%	191,7%	0,10	70	0,13%	0,13%
T2V4	\$ 900,00	Dólar linked	-10,6%	142,9%	0,66	223	-2,70%	4,17%
TV25	\$ 906,00	Dólar linked	-6,3%	206,2%	1,13	405	-0,98%	-1,52%
TDF24	\$ 825,50	Duales (DL)	127,8%	200,5%	0,02	8	0,30%	0,94%
TDA24	\$ 776,00	Duales (DL)	49,9%	180,0%	0,19	70	-1,65%	-4,84%
TDJ24	\$ 887,50	Duales (DL)	-15,3%	123,5%	0,35	131	-1,44%	-0,84%
TDG24	\$ 888,00	Duales (DL)	-10,8%	136,6%	0,52	192	-3,79%	-5,03%
TDE25	\$ 1.003,50	Duales (DL)	-17,5%	154,3%	0,94	346	0,46%	10,27%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.336,50	CER	-81,8%	0,09	0,11%	0,56%
T3X4	\$ 345,50	CER	-71,5%	0,14	-0,22%	0,73%
T6X4	\$ 267,00	CER	-68,2%	0,24	-1,66%	2,30%
T2X4	\$ 1.225,00	CER	-55,6%	0,42	0,25%	3,38%
T4X4	\$ 405,00	CER	-39,3%	0,64	-0,25%	5,06%
TSX4	\$ 325,00	CER	-30,1%	0,79	2,04%	3,67%
T2X5	\$ 394,90	CER	-24,6%	1,25	-0,65%	3,92%
TX25	\$ 687,00	CER	-14,6%	1,70	2,66%	9,92%
TX26	\$ 1.270,00	CER	-9,8%	1,74	-1,47%	2,42%
TZX26	\$ 128,50	CER	-4,6%	2,35	-0,58%	5,33%
TZX27	\$ 131,00	CER	-3,8%	3,35	0,00%	10,55%
TX28	\$ 1.545,00	CER	-12,9%	2,70	8,42%	13,02%
DICP	\$ 27.740,00	CER	-0,7%	4,80	4,48%	8,04%
PARP	\$ 14.000,00	CER	3,6%	9,14	1,97%	1,60%
TO26	\$ 40,70	Fija	88,4%	1,74	0,52%	3,56%
BDC24	\$ 116,10	Badlar	170,9%	0,10	0,17%	0,35%
PBA25	\$ 109,25	Badlar	179,6%	0,69	-0,27%	2,39%
BDC28	\$ 106,80	Badlar	155,3%	1,16	-4,06%	-20,83%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 46,38	46%	33,0%	2,52	1,00%	2,16%	-0,54%	0,39%
GD29	\$ 48,20	48%	31,0%	2,55	1,00%	2,07%	-1,17%	-3,79%
AL30	\$ 44,85	44%	31,7%	2,62	0,75%	1,67%	-1,71%	-0,58%
GD30	\$ 47,76	48%	28,6%	2,69	0,75%	1,57%	-0,28%	0,34%
AL35	\$ 38,00	36%	20,3%	6,27	3,63%	9,54%	-1,91%	2,73%
GD35	\$ 37,99	38%	20,3%	6,26	3,63%	9,54%	-0,68%	2,66%
AE38	\$ 40,08	38%	22,4%	5,15	4,25%	10,60%	0,20%	2,04%
GD38	\$ 43,15	43%	20,6%	5,30	4,25%	9,85%	0,58%	2,45%
AL41	\$ 37,10	36%	19,1%	6,29	3,50%	9,43%	0,30%	2,20%
GD41	\$ 37,70	38%	18,8%	6,33	3,50%	9,28%	-0,79%	3,01%
GD46	\$ 40,00	39%	19,4%	5,29	3,00%	7,50%	-1,23%	-4,31%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
9	29/2/2024	\$ 843,80	0,8%	37,2%	31,7%	2,67%
40	31/3/2024	\$ 874,50	4,4%	48,8%	40,6%	3,37%
66	26/4/2024	\$ 925,00	10,5%	73,5%	58,0%	4,70%
101	31/5/2024	\$ 975,50	16,5%	73,7%	59,7%	4,71%
131	30/6/2024	\$ 1.029,00	22,9%	77,6%	63,8%	4,90%
160	29/7/2024	\$ 1.102,00	31,6%	87,2%	72,1%	5,36%
193	31/8/2024	\$ 1.180,50	41,0%	91,5%	77,5%	5,56%
222	29/9/2024	\$ 1.315,00	57,1%	110,1%	93,8%	6,38%
254	31/10/2024	\$ 1.375,00	64,2%	104,0%	92,3%	6,12%
284	30/11/2024	\$ 1.500,00	79,2%	111,6%	101,7%	6,44%
314	30/12/2024	\$ 1.590,00	89,9%	110,8%	104,5%	6,41%
345	30/1/2025	\$ 1.660,00	98,3%	106,3%	104,0%	6,22%

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

