

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 848,25 CCL<sup>(1)</sup>: \$ 1.022,47 MEP<sup>(2)</sup>: \$ 979,60 Brecha: 20,54% Devaluación<sup>(3)</sup>: 2,08% Inflación<sup>(4)</sup>: 20,60% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 108,94% Tasa Caución: 92,00%

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

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20Y4	\$ 169,20	CER	-60,3%	128,6%	0,19	70	0,42%	0,42%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDA24	\$ 795,00	Duales (CER)	-72,5%	65,8%	0,13	50	0,13%	0,13%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (CER)	-40,6%	156,6%	0,30	111	0,78%	0,78%
TDG24	\$ 900,00	Duales (CER)	-45,3%	113,8%	0,47	172	0,45%	0,45%
TDE25	\$ 910,00	Duales (CER)	-27,0%	138,2%	0,89	326	1,68%	1,68%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 790,30	Dólar linked	71,6%	189,0%	0,06	50	-0,14%	-0,14%
TZV4	\$ 843,10	Dólar linked	1,7%	162,1%	0,54	203	-1,85%	-1,85%
TV25	\$ 845,00	Dólar linked	0,9%	222,9%	1,04	385	-0,59%	-0,59%
TDA24	\$ 795,00	Duales (DL)	61,5%	181,4%	0,13	50	0,13%	0,13%
TDJ24	\$ 905,00	Duales (DL)	-20,0%	113,5%	0,30	111	0,78%	0,78%
TDG24	\$ 900,00	Duales (DL)	-12,3%	129,8%	0,47	172	0,45%	0,45%
TDE25	\$ 910,00	Duales (DL)	-7,8%	176,7%	0,89	326	1,68%	1,68%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.405,50	CER	-78,1%	0,03	0,57%	0,57%
T3X4	\$ 361,25	CER	-56,8%	0,09	0,63%	0,63%
T6X4	\$ 276,00	CER	-57,5%	0,19	0,84%	0,84%
T2X4	\$ 1.210,00	CER	-39,0%	0,37	1,38%	1,38%
T4X4	\$ 402,00	CER	-24,1%	0,58	2,16%	2,16%
T5X4	\$ 330,50	CER	-20,2%	0,74	5,76%	5,76%
T2X5	\$ 394,00	CER	-13,9%	1,06	1,61%	1,61%
TZX25	\$ 127,65	CER	-11,1%	1,30	0,27%	0,27%
TX25	\$ 697,00	CER	-8,8%	1,64	2,15%	2,15%
TX26	\$ 1.323,50	CER	-4,1%	1,66	0,80%	0,80%
TZX26	\$ 143,50	CER	-3,1%	2,30	0,07%	0,07%
TZX27	\$ 152,00	CER	-3,9%	3,30	-1,30%	-1,30%
TX28	\$ 1.390,00	CER	-4,0%	2,45	2,51%	2,51%
DICP	\$ 27.290,00	CER	3,0%	4,43	-1,48%	-1,48%
PARP	\$ 15.335	CER	4,3%	9,00	-0,29%	-0,29%
TO26	\$ 46,40	Fija	78,1%	1,74	2,54%	2,54%
BDC24	\$ 123,00	Badlar	150,3%	0,04	0,57%	0,57%
PBA25	\$ 118,00	Badlar	170,2%	0,64	0,85%	0,85%
BDC28	\$ 117,40	Badlar	145,3%	1,15	4,36%	4,36%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 47,93	32,1%	47,4%	2,48	1,00%	2,09%	-1,86%	-1,86%
GD29	\$ 49,50	30,4%	48,9%	2,51	1,00%	2,02%	-3,23%	-3,23%
AL30	\$ 46,85	30,2%	46,4%	2,60	0,75%	1,60%	0,22%	0,22%
GD30	\$ 49,00	28,0%	49,0%	2,65	0,75%	1,53%	0,20%	0,20%
AL35	\$ 39,50	19,8%	37,7%	6,26	3,63%	9,18%	-0,63%	-0,63%
GD35	\$ 39,82	19,6%	39,8%	6,27	3,63%	9,10%	-0,33%	-0,33%
AE38	\$ 41,00	22,1%	39,0%	5,12	4,25%	10,37%	-1,06%	-1,06%
GD38	\$ 43,50	20,7%	43,5%	5,24	4,25%	9,77%	-0,86%	-0,86%
AL41	\$ 37,50	19,1%	36,0%	6,24	3,50%	9,33%	0,26%	0,26%
GD41	\$ 37,00	19,3%	37,0%	6,21	3,50%	9,46%	-2,79%	-2,79%
GD46	\$ 42,30	18,4%	40,9%	5,40	3,00%	7,09%	-1,63%	-1,63%
BPI5D	\$ 92,00	10,5%	92,0%	0,37	0,00%	0,00%	0,44%	3,78%
BPA7D	\$ 88,00	18,8%	88,0%	1,11	5,00%	5,68%	0,11%	0,00%
BPB7D	\$ 76,00	20,8%	76,0%	2,02	5,00%	6,58%	0,61%	1,33%
BPC7D	\$ 69,50	19,5%	69,5%	2,86	5,00%	7,19%	-0,57%	10,32%
BPD7D	\$ 68,50	19,4%	68,5%	3,06	5,00%	7,30%	0,88%	24,55%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
20	31/3/2024	\$ 868,50	2,4%	53,8%	43,6%	3,65%
50	30/4/2024	\$ 917,00	8,1%	76,6%	59,2%	4,86%
77	27/5/2024	\$ 987,00	16,4%	105,1%	77,5%	6,17%
111	30/6/2024	\$ 1.065,00	25,6%	111,3%	84,0%	6,43%
142	31/7/2024	\$ 1.152,00	35,8%	119,6%	92,0%	6,78%
171	29/8/2024	\$ 1.222,00	44,1%	118,0%	94,0%	6,71%
203	30/9/2024	\$ 1.296,00	52,8%	114,3%	94,9%	6,56%
233	30/10/2024	\$ 1.376,00	62,2%	113,4%	97,5%	6,52%
264	30/11/2024	\$ 1.452,00	71,2%	110,3%	98,4%	6,39%
295	31/12/2024	\$ 1.525,00	79,8%	106,6%	98,7%	6,23%
325	30/1/2025	\$ 1.619,00	90,9%	106,7%	102,0%	6,24%

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

