

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 998,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.158,81 MEP⁽²⁾: \$ 1.124,56 Brecha: 16,03% Devaluación⁽³⁾: 1,76% Inflación⁽⁴⁾: 2,70% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 35,50% Tasa Caución: 31,00%

⁽¹⁾ Promedio a través de GD30. ⁽²⁾ Calculado con GD30. ⁽³⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual). ⁽⁴⁾ Inflación mensual de Octubre.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.240,00	Duales (CER)	5,2%	25,6%	0,22	80	-1,20%	1,22%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 982,60	Dólar linked	4,68%	20,15%	0,36	139	-1,23%	0,16%
TZV25	\$ 970,00	Dólar linked	5,63%	0,00%	0,56	230	-1,01%	-0,72%
TZVDS	\$ 950,00	Dólar linked	4,56%	0,00%	1,07	398	0,00%	0,32%
TZV26	\$ 885,00	Dólar linked	7,61%	0,00%	1,40	595	0,00%	0,57%
TDE25	\$ 1.255,90	Duales (DL)	-65,54%	-35,83%	0,22	80	0,07%	2,52%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 498,2	CER	0,96%	0,08	0,08%	0,27%
TZXS	\$ 608,7	CER	2,46%	0,24	0,25%	0,64%
TZXM5	\$ 134,0	CER	1,63%	0,38	0,98%	0,79%
TZK25	\$ 191,6	CER	6,62%	0,63	0,16%	0,58%
TX26	\$ 1.605,0	CER	8,51%	1,21	0,19%	1,49%
TX25	\$ 1.030,0	CER	5,24%	0,98	1,08%	2,79%
TZXD5	\$ 165,5	CER	7,87%	1,09	0,30%	1,78%
TZXM6	\$ 128,8	CER	8,75%	1,38	0,19%	1,42%
TZK26	\$ 212,3	CER	8,69%	1,63	0,12%	1,65%
TX28	\$ 1.582,0	CER	6,60%	2,13	2,46%	3,81%
TZXD6	\$ 151,1	CER	8,66%	2,09	0,73%	1,75%
TZXM7	\$ 112,5	CER	7,91%	2,38	0,00%	-0,44%
TZK27	\$ 194,9	CER	8,78%	2,63	-0,08%	2,55%
TZK27	\$ 138,0	CER	8,93%	3,09	0,00%	1,47%
DICP	\$ 37.500,0	CER	9,91%	3,60	0,67%	2,10%
TZK28	\$ 178,9	CER	8,81%	3,63	0,22%	2,35%
PARP	\$ 20.260,0	CER	8,46%	8,07	0,55%	0,35%

S29N4	\$ 132,90	Fija	41,00%	0,04	0,06%	0,19%
S13D4	\$ 123,33	Fija	40,65%	0,08	0,13%	0,24%
S17E5	\$ 123,50	Fija	40,35%	0,18	0,12%	0,16%
S31E5	\$ 160,15	Fija	41,53%	0,22	0,12%	0,19%
S14F5	\$ 111,34	Fija	39,69%	0,25	0,26%	0,40%
S28F5	\$ 143,70	Fija	39,07%	0,29	0,28%	0,28%
S14M5	\$ 112,65	Fija	40,07%	0,33	0,20%	-0,18%
S31M5	\$ 137,10	Fija	39,72%	0,38	0,18%	0,44%
S16A5	\$ 114,30	Fija	38,68%	0,42	0,44%	0,44%
S28A5	\$ 112,65	Fija	38,91%	0,45	0,44%	0,50%
S16V5	\$ 115,95	Fija	38,94%	0,50	0,22%	0,39%
S30V5	\$ 115,75	Fija	35,21%	0,54	1,85%	2,17%
S18J5	\$ 121,90	Fija	38,11%	0,59	0,83%	1,37%
S30J5	\$ 120,30	Fija	37,06%	0,63	1,31%	1,48%
S31L5	\$ 118,50	Fija	36,29%	0,71	1,59%	1,72%
S29G5	\$ 123,80	Fija	35,75%	0,79	2,02%	2,02%
S1255	\$ 123,30	Fija	35,82%	0,83	1,61%	2,28%
S30S5	\$ 123,00	Fija	34,60%	0,88	2,84%	3,10%
T17O5	\$ 120,20	Fija	35,15%	0,93	2,60%	2,78%
T15D5	\$ 123,50	Fija	34,76%	1,09	2,62%	3,35%
TO26	\$ 79,80	Fija	33,39%	1,69	1,00%	1,01%
PBA25	\$ 103,90	Badlar	43,54%	0,79	0,22%	0,39%
BDC28	\$ 112,00	Badlar	43,13%	0,83	1,85%	2,17%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 77,00	13,7%	75,6%	2,12	1,00%	1,30%	0,20%	0,65%
GD29	\$ 77,90	13,0%	76,5%	2,13	1,00%	1,28%	0,01%	-0,09%
AL30	\$ 68,33	15,0%	67,4%	2,48	0,75%	1,10%	0,41%	1,44%
GD30	\$ 71,18	13,1%	71,2%	2,53	0,75%	1,05%	0,48%	1,48%
AL35	\$ 63,42	12,3%	58,9%	6,43	3,63%	5,72%	0,09%	1,47%
GD35	\$ 63,62	12,2%	63,6%	6,44	3,63%	5,70%	-0,13%	1,79%
AE38	\$ 67,07	12,7%	67,1%	5,53	4,25%	6,34%	1,62%	2,41%
GD38	\$ 68,82	12,2%	68,8%	5,58	4,25%	6,18%	0,32%	0,86%
AL41	\$ 59,00	12,1%	55,4%	6,78	3,50%	5,93%	0,14%	0,85%
GD41	\$ 59,29	12,0%	59,3%	6,79	3,50%	5,90%	0,94%	1,18%
GD46	\$ 64,31	11,4%	64,3%	6,30	3,00%	4,66%	-0,29%	-0,60%
BPJ5D	\$ 67,13	-2,0%	67,1%	0,34	0,00%	0,00%	-0,86%	-0,55%
BPA7D	\$ 97,10	12,5%	97,1%	0,46	5,00%	5,15%	0,10%	0,62%
BPB7D	\$ 91,85	11,7%	91,9%	1,42	5,00%	5,44%	-0,48%	-0,05%
BPC7D	\$ 88,36	10,9%	88,4%	2,33	5,00%	5,66%	-0,48%	-0,15%
BPD7D	\$ 87,99	11,0%	88,0%	2,55	5,00%	5,68%	0,68%	0,84%
BPY6D	\$ 94,70	8,1%	94,7%	0,78	3,00%	3,17%	1,55%	1,94%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
18	30/11/2024	\$ 1.016,0	1,7%	41,5%	35,0%	2,94%
49	31/12/2024	\$ 1.044,5	4,6%	39,6%	34,1%	2,82%
79	30/1/2025	\$ 1.079,5	8,1%	43,2%	37,4%	3,04%
107	27/2/2025	\$ 1.102,5	10,4%	40,1%	35,4%	2,85%
139	31/3/2025	\$ 1.122,0	12,3%	35,7%	32,4%	2,58%
169	30/4/2025	\$ 1.147,0	14,8%	34,8%	32,1%	2,52%
200	31/5/2025	\$ 1.170,0	17,1%	33,5%	31,3%	2,44%
230	30/6/2025	\$ 1.187,5	18,9%	31,6%	30,0%	2,32%
260	30/7/2025	\$ 1.209,5	21,1%	30,8%	29,6%	2,27%
292	31/8/2025	\$ 1.228,0	23,0%	29,5%	28,7%	2,18%
322	30/9/2025	\$ 1.252,0	25,4%	29,2%	28,7%	2,16%
353	31/10/2025	\$ 1.280,0	28,2%	29,2%	29,1%	2,16%

* Supuestos de Inflación propios: 3% a partir de Noviembre
Supuestos de Devaluación: 2% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

