

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1004,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.100,61 MEP⁽²⁾: \$ 1.074,93 Brecha: 9,54% Devaluación⁽³⁾: 2,11% Inflación⁽⁴⁾: 2,70% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 36,19% Tasa Caución: 32,80%

(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	\$ 1.250,70	Duales (CER)	6,0%	16,5%	0,19	71	0,06%	0,61%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 977,50	Dólar linked	8,40%	33,69%	0,32	130	-0,05%	-0,56%
TZV25	\$ 982,00	Dólar linked	4,76%	0,00%	0,55	221	0,52%	0,21%
TZVD5	\$ 1.004,40	Dólar linked	-0,11%	0,00%	1,06	389	1,66%	1,46%
TZV26	\$ 905,00	Dólar linked	6,64%	0,00%	1,40	586	1,12%	2,84%
TDE25	\$ 1.250,70	Duales (DL)	-68,32%	-83,66%	0,19	71	0,06%	0,61%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 502,0	CER	3,66%	0,06	0,04%	0,34%
TZ5	\$ 615,6	CER	1,67%	0,22	0,26%	0,42%
TZXM5	\$ 135,1	CER	1,94%	0,35	0,07%	0,00%
TZ25	\$ 195,7	CER	4,78%	0,60	0,13%	0,08%
TX26	\$ 1.650,5	CER	6,96%	1,19	1,01%	0,95%
TX25	\$ 1.036,0	CER	5,72%	0,95	-1,61%	-0,34%
TZXD5	\$ 168,3	CER	7,29%	1,06	0,30%	-0,21%
TZXM6	\$ 131,7	CER	7,82%	1,35	0,23%	-0,11%
TZ26	\$ 217,3	CER	7,86%	1,60	0,35%	-0,02%
TX28	\$ 1.578,0	CER	7,27%	2,09	0,96%	-0,13%
TZXD6	\$ 154,6	CER	8,05%	2,06	0,19%	-0,13%
TZXM7	\$ 113,9	CER	7,85%	2,35	-1,00%	0,40%
TZ27	\$ 199,1	CER	8,35%	2,60	-0,20%	-0,35%
TZXD7	\$ 141,5	CER	8,43%	3,06	0,71%	0,60%
DICP	\$ 37.940,0	CER	8,43%	3,67	-0,16%	-0,08%
TZ28	\$ 182,4	CER	8,56%	3,61	0,44%	-0,05%
PARP	\$ 20.500,0	CER	8,45%	8,05	0,91%	-0,73%
S29N4	\$ 134,05	Fija	39,76%	0,02	0,09%	0,27%
S13D4	\$ 124,20	Fija	43,93%	0,06	-0,04%	0,20%
S17E5	\$ 124,65	Fija	39,52%	0,15	0,04%	0,31%
S31E5	\$ 161,93	Fija	39,73%	0,19	0,08%	0,44%
S14F5	\$ 112,25	Fija	39,74%	0,23	0,15%	0,13%
S28F5	\$ 144,75	Fija	39,51%	0,27	-0,10%	0,00%
S14M5	\$ 113,36	Fija	41,00%	0,31	-0,43%	-0,43%
S31M5	\$ 138,60	Fija	38,70%	0,35	0,03%	0,00%
S16A5	\$ 115,30	Fija	38,46%	0,40	-0,09%	0,17%
S28A5	\$ 113,60	Fija	38,82%	0,43	-0,13%	0,01%
S16V5	\$ 117,00	Fija	38,68%	0,48	-0,33%	-0,51%
S30V5	\$ 115,00	Fija	38,90%	0,52	-0,35%	-0,61%
S18J5	\$ 122,70	Fija	38,45%	0,57	-0,32%	-0,28%
S30J5	\$ 121,05	Fija	37,41%	0,60	-0,12%	0,21%
S31L5	\$ 119,00	Fija	36,97%	0,69	-0,17%	-0,34%
S29G5	\$ 123,61	Fija	37,37%	0,77	-0,23%	-0,63%
S12S5	\$ 123,36	Fija	37,01%	0,81	-0,52%	-0,39%
S30S5	\$ 123,06	Fija	35,68%	0,85	-0,76%	-0,76%
T17O5	\$ 120,40	Fija	36,02%	0,90	-0,86%	-0,91%
T15D5	\$ 124,60	Fija	34,57%	1,06	-0,56%	-0,60%
TO26	\$ 83,25	Fija	30,60%	1,67	0,31%	0,24%
PBA25	\$ 104,60	Badlar	45,60%	0,77	-0,33%	-0,51%
BDC28	\$ 101,10	Badlar	53,58%	0,81	-0,35%	-0,61%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 78,34	12,9%	76,9%	2,11	1,00%	1,28%	0,37%	2,41%
GD29	\$ 80,21	11,7%	78,7%	2,13	1,00%	1,25%	-1,70%	2,87%
AL30	\$ 70,55	13,7%	69,6%	2,49	0,75%	1,06%	-0,73%	4,74%
GD30	\$ 72,80	12,3%	72,8%	2,53	0,75%	1,03%	-0,55%	3,79%
AL35	\$ 67,25	11,3%	62,4%	6,48	3,63%	5,39%	-1,18%	7,60%
GD35	\$ 66,90	11,4%	66,9%	6,47	3,63%	5,42%	-0,89%	7,04%
AE38	\$ 70,50	11,7%	70,5%	5,60	4,25%	6,03%	-0,14%	7,65%
GD38	\$ 71,40	11,5%	71,4%	5,63	4,25%	5,95%	-0,63%	4,65%
AL41	\$ 62,80	11,1%	58,9%	6,90	3,50%	5,57%	-1,10%	7,35%
GD41	\$ 62,15	11,3%	62,2%	6,88	3,50%	5,63%	-1,54%	6,06%
GD46	\$ 67,63	10,5%	67,6%	6,48	3,00%	4,44%	-0,10%	4,53%
BPJ5D	\$ 68,30	-7,4%	68,3%	0,31	0,00%	0,00%	0,26%	1,19%
BPA7D	\$ 96,40	15,1%	96,4%	0,44	5,00%	5,19%	0,16%	-0,10%
BPB7D	\$ 92,60	11,3%	92,6%	1,40	5,00%	5,40%	0,49%	0,76%
BPC7D	\$ 87,20	11,6%	87,2%	2,31	5,00%	5,73%	0,29%	-1,46%
BPD7D	\$ 87,33	11,4%	87,3%	2,53	5,00%	5,73%	0,26%	0,08%
BPY6D	\$ 94,75	8,2%	94,8%	0,76	3,00%	3,17%	0,16%	1,99%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
9	30/11/2024	\$ 1.013,0	0,8%	39,3%	33,3%	2,80%
40	31/12/2024	\$ 1.038,5	3,4%	35,2%	30,7%	2,54%
70	30/1/2025	\$ 1.061,5	5,6%	33,2%	29,5%	2,42%
98	27/2/2025	\$ 1.081,5	7,6%	31,5%	28,5%	2,31%
130	31/3/2025	\$ 1.102,0	9,7%	29,6%	27,2%	2,19%
160	30/4/2025	\$ 1.119,0	11,4%	27,8%	25,9%	2,07%
191	31/5/2025	\$ 1.237,5	23,2%	48,9%	44,3%	3,37%
221	30/6/2025	\$ 1.154,5	14,9%	25,8%	24,6%	1,93%
251	30/7/2025	\$ 1.171,5	16,6%	25,0%	24,1%	1,88%
283	31/8/2025	\$ 1.189,0	18,3%	24,3%	23,7%	1,83%
313	30/9/2025	\$ 1.205,0	19,9%	23,6%	23,2%	1,78%
344	31/10/2025	\$ 1.226,0	22,0%	23,5%	23,4%	1,78%

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

