

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 350,03 CCI⁽¹⁾: \$ 892,08 MEP⁽²⁾: \$ 873,60 Brecha: 154,86% Devaluación⁽³⁾: 0,00%

⁽¹⁾ Promedio a través de ADRs. ⁽²⁾ Calculado con Lecer Noviembre. ⁽³⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual).

⁽⁴⁾

Inflación mensual de septiembre.

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X23N3	\$ 156,55	CER	28,7%	169,0%	0,02	10	0,15%	0,15%
X18E4	\$ 129,25	CER	6,7%	146,3%	0,17	66	-0,39%	-0,39%
X20F4	\$ 121,20	CER	-5,0%	124,2%	0,27	99	0,21%	0,21%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 451,60	Diales (CER)	-43,3%	52,3%	0,55	107	-1,40%	-1,40%
TO24	\$ 470,00	Diales (CER)	-37,2%	59,0%	0,59	169	-1,05%	-1,05%
TDJ24	\$ 467,50	Diales (CER)	-9,7%	120,8%	0,63	230	-1,53%	-1,53%
TDG24	\$ 460,00	Diales (CER)	-20,2%	100,5%	0,87	291	-2,95%	-2,95%
TDE25	\$ 350,00	Diales (CER)	9,3%	203,9%	1,21	445	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 450,90	Dólar linked	-42,3%	48,3%	0,81	169	-2,40%	-2,40%
T2V4	\$ 455,00	Dólar linked	-25,4%	94,3%	1,01	322	-0,87%	-0,87%
TV25D	\$ 352,07	Dólar linked	0,1%	206,7%	1,37	504	0,00%	0,00%
TD24	\$ 451,60	Diales (DL)	-58,8%	9,4%	0,29	107	-1,40%	-1,40%
TO24	\$ 470,00	Diales (DL)	-47,5%	36,3%	0,46	169	-1,05%	-1,05%
TDJ24	\$ 467,50	Diales (DL)	-37,1%	64,6%	0,62	230	-1,53%	-1,53%
TDG24	\$ 460,00	Diales (DL)	-29,2%	83,1%	0,79	291	-2,95%	-2,95%
TDE25	\$ 350,00	Diales (DL)	0,0%	-82,5%	1,21	445	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 746,00	CER	4,1%	0,34	1,29%	1,29%
T3X4	\$ 185,50	CER	5,9%	0,40	0,82%	0,82%
TX64	\$ 130,30	CER	6,4%	0,50	0,46%	0,46%
T2X4	\$ 546,00	CER	7,7%	0,65	1,47%	1,47%
T4X4	\$ 181,90	CER	7,3%	0,86	0,72%	0,72%
TX5X4	\$ 148,15	CER	8,6%	1,01	1,96%	1,96%
T2X5	\$ 176,90	CER	9,8%	1,14	0,40%	0,40%
TX25	\$ 269,00	CER	13,6%	1,83	-1,82%	-1,82%
TX26	\$ 561,90	CER	12,0%	1,70	0,34%	0,34%
TX28	\$ 540,00	CER	11,4%	2,21	0,93%	0,93%
DICP	\$ 11.135,00	CER	11,4%	3,65	-0,27%	-0,27%
PARP	\$ 4.999,00	CER	10,7%	7,62	0,18%	0,18%
TO26	\$ 21,55	Fija	141,3%	0,67	1,89%	1,89%
BDC24	\$ 117,00	Badlar	207,6%	0,31	0,00%	0,00%
PBA25	\$ 93,00	Badlar	307,9%	0,67	0,00%	0,00%
BDC28	\$ 127,00	Badlar	227,7%	0,74	-1,55%	-1,55%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	MTD
AL29	\$ 26,25	26%	61,6%	2,41	1,00%	3,81%	-0,91%	1,39%
GD29	\$ 29,65	29%	53,8%	2,50	1,00%	3,37%	-8,53%	9,26%
AL30	\$ 26,45	26%	57,0%	2,41	0,75%	2,84%	-0,75%	6,01%
GD30	\$ 30,30	30%	48,6%	2,54	0,75%	2,48%	-1,14%	5,91%
AL35	\$ 24,95	24%	29,3%	5,36	4,13%	16,53%	-1,58%	3,27%
GD35	\$ 27,76	28%	26,8%	5,60	4,13%	14,86%	0,03%	-0,14%
AE38	\$ 27,35	26%	32,6%	4,33	4,25%	15,54%	-2,57%	-0,40%
GD38	\$ 34,49	34%	26,1%	4,83	4,25%	12,32%	1,44%	5,47%
AI41	\$ 25,60	25%	27,0%	5,29	3,50%	13,67%	0,00%	6,26%
GD41	\$ 28,25	28%	24,7%	5,55	3,50%	12,39%	-3,58%	3,71%
GD46	\$ 27,01	26%	29,5%	4,13	3,00%	11,11%	-3,54%	-3,54%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
17	30/11/2023	\$ 375,20	7,2%	344,3%	154,4%	13,23%
46	29/12/2023	\$ 663,00	89,4%	15793,6%	709,5%	52,56%
79	31/1/2024	\$ 740,00	111,4%	3078,3%	514,8%	33,41%
108	29/2/2024	\$ 821,00	134,6%	1683,6%	454,7%	27,14%
135	27/3/2024	\$ 890,00	154,3%	1146,8%	417,1%	23,40%
169	30/4/2024	\$ 965,00	175,7%	793,8%	379,5%	20,02%
200	31/5/2024	\$ 1.055,00	201,4%	649,0%	367,6%	18,27%
228	28/6/2024	\$ 1.105,00	215,7%	529,9%	345,3%	16,57%
261	31/7/2024	\$ 1.200,00	242,8%	460,1%	339,6%	15,44%
291	30/8/2024	\$ 1.310,00	274,3%	423,5%	344,0%	14,79%
322	30/9/2024	\$ 1.360,00	288,5%	365,8%	327,1%	13,68%

* Supuestos de inflación: 12% octubre y 8% de noviembre en adelante (mensuales).

Supuestos de Devaluación: 3% hasta octubre 2023 (DL y Diales) y 8,5% para instrumentos con vencimiento en 2024.

