

**PRINCIPALES VARIABLES**

TC Oficial: \$ 835,05 CCL<sup>(1)</sup>: \$ 1.116,40 MEP<sup>(2)</sup>: \$ 1.063,83 Brecha: 33,69% Devaluación<sup>(3)</sup>: 2,01%

Inflación<sup>(4)</sup>: 20,60% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 109,63% Tasa Caución: 89,75%

<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	\$ 159,40	CER	-69,4%	128,1%	0,25	94	1,53%	2,84%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDF24	\$ 817,80	Duales (CER)	-100,0%	-1192,9%	0,02	12	0,15%	1,10%
TDA24	\$ 815,50	Duales (CER)	-85,8%	30,8%	0,19	74	-4,06%	-6,40%
TDJ24	\$ 895,00	Duales (CER)	-59,4%	134,9%	0,36	135	-2,40%	-2,24%
TDG24	\$ 935,00	Duales (CER)	-61,2%	89,8%	0,53	196	-0,01%	-3,75%
TDE25	\$ 910,00	Duales (CER)	-38,3%	129,8%	0,95	350	-6,28%	-9,09%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 764,00	Dólar linked	60,2%	189,8%	0,10	74	-1,61%	-4,88%
TZV4	\$ 864,00	Dólar linked	-4,8%	155,5%	0,63	227	-5,77%	-10,84%
TV25	\$ 920,00	Dólar linked	-7,8%	201,7%	1,14	409	-1,30%	-5,15%
TDF24	\$ 817,80	Duales (DL)	152,4%	212,3%	0,02	12	0,15%	1,10%
TDA24	\$ 815,50	Duales (DL)	12,8%	143,5%	0,19	74	-4,06%	-6,40%
TDJ24	\$ 895,00	Duales (DL)	-17,7%	119,7%	0,36	135	-2,40%	-2,24%
TDG24	\$ 935,00	Duales (DL)	-19,4%	119,9%	0,53	196	-0,01%	-3,75%
TDE25	\$ 910,00	Duales (DL)	-8,7%	181,1%	0,95	350	-6,28%	-9,09%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.329,00	CER	-84,4%	0,09	0,23%	1,61%
T3X4	\$ 343,00	CER	-74,3%	0,15	0,96%	1,74%
T6X4	\$ 261,00	CER	-68,3%	0,25	0,31%	1,56%
T2X4	\$ 1.185,00	CER	-54,7%	0,43	-0,59%	0,85%
T4X4	\$ 385,50	CER	-37,1%	0,64	0,65%	1,98%
TSX4	\$ 313,50	CER	-29,3%	0,79	0,48%	1,49%
T2X5	\$ 380,00	CER	-23,8%	1,24	0,00%	2,43%
TX25	\$ 625,00	CER	-11,3%	1,70	-0,32%	-0,02%
TX26	\$ 1.240,00	CER	-10,1%	1,75	2,23%	6,99%
TZX26	\$ 122,00	CER	-3,7%	2,36	2,31%	2,09%
TZX27	\$ 118,50	CER	-1,8%	3,36	1,07%	3,95%
TX28	\$ 1.367,00	CER	-9,8%	2,64	2,01%	7,85%
DICP	\$ 25.675,00	CER	0,3%	4,72	1,48%	1,48%
PARP	\$ 13.780	CER	3,4%	9,16	0,44%	8,42%
TO26	\$ 39,30	Fija	91,9%	1,72	-0,76%	-1,75%
BDC24	\$ 115,70	Badlar	168,3%	0,10	-0,60%	-0,60%
PBA25	\$ 106,70	Badlar	188,3%	0,69	1,04%	3,59%
BDC28	\$ 134,90	Badlar	155,3%	0,92	2,98%	2,98%

**BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)**

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 46,20	46%	33,1%	2,53	1,00%	2,16%	2,67%	9,48%
GD29	\$ 50,10	50%	29,0%	2,59	1,00%	2,00%	-2,72%	13,86%
AL30	\$ 45,11	45%	31,3%	2,63	1,75%	3,88%	1,83%	10,56%
GD30	\$ 47,60	48%	28,7%	2,69	1,75%	3,68%	0,85%	9,30%
AL35	\$ 36,99	35%	20,8%	6,23	4,75%	12,84%	3,32%	9,12%
GD35	\$ 37,00	37%	20,8%	6,23	4,75%	12,84%	0,82%	6,48%
AE38	\$ 39,28	38%	22,8%	5,12	5,00%	12,73%	0,72%	6,63%
GD38	\$ 42,12	42%	21,2%	5,26	5,00%	11,87%	2,48%	2,73%
AL41	\$ 36,30	35%	19,5%	6,25	4,88%	13,43%	2,80%	7,68%
GD41	\$ 36,60	37%	19,3%	6,27	4,88%	13,32%	3,15%	7,74%
GD46	\$ 41,80	40%	18,4%	5,46	3,63%	8,67%	3,21%	7,87%

**FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX**

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
13	29/2/2024	\$ 845,30	1,2%	40,9%	34,5%	2,90%
44	31/3/2024	\$ 880,50	5,4%	55,2%	45,2%	3,73%
70	26/4/2024	\$ 937,50	12,3%	82,8%	64,0%	5,16%
105	31/5/2024	\$ 996,00	19,3%	84,5%	67,0%	5,24%
135	30/6/2024	\$ 1.072,00	28,4%	96,5%	76,7%	5,79%
164	29/7/2024	\$ 1.175,00	40,7%	113,9%	90,6%	6,54%
197	31/8/2024	\$ 1.265,00	51,5%	115,9%	95,4%	6,62%
226	29/9/2024	\$ 1.425,00	70,6%	137,1%	114,1%	7,46%
258	31/10/2024	\$ 1.570,00	88,0%	144,3%	124,5%	7,73%
288	30/11/2024	\$ 1.580,00	89,2%	124,4%	113,1%	6,97%
318	30/12/2024	\$ 1.671,50	100,2%	121,8%	115,0%	6,86%
349	30/1/2025	\$ 1.760,00	110,8%	118,1%	115,8%	6,71%

\* Supuestos de inflación: Según estimaciones del REM de febrero elaborado por el BCRA.

Supuestos de Devaluación: 10% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

