

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial:	\$ 838,35	CCL <sup>(1)</sup> :	\$ 1.098,43	MEP <sup>(2)</sup> :	\$ 1.036,88	Brecha:	31,02%	Devaluación <sup>(3)</sup> :	1,98%	Inflación <sup>(4)</sup> :	20,60%	Tasa Pase:	100%	Tasa Bdalar:	108,13%	Tasa Caución:	100,00%
(1) Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con AL30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de enero.																	

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X20Y4	\$ 163,00	CER	-69,1%	124,6%	0,23	88	-1,15%	2,26%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDA24	\$ 792,00	Diales (CER)	-82,1%	51,7%	0,18	68	-0,31%	-2,88%
TDJ24	\$ 911,00	Diales (CER)	-58,0%	133,7%	0,34	129	1,79%	1,79%
TDG24	\$ 903,50	Diales (CER)	-56,1%	102,8%	0,51	190	0,78%	-3,37%
TDE25	\$ 1.000,00	Diales (CER)	-42,1%	110,5%	0,93	344	-0,29%	9,89%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV24	\$ 782,50	Dólar linked	49,4%	177,9%	0,10	68	0,84%	2,42%
TZ24	\$ 880,00	Dólar linked	-7,2%	149,1%	0,63	221	0,02%	1,85%
TV25	\$ 865,00	Dólar linked	-2,2%	218,9%	1,10	403	0,58%	-5,98%
TDF24	\$ 834,30	Diales (DL)	117,0%	193,4%	0,01	6	0,89%	2,02%
TDA24	\$ 792,00	Diales (DL)	37,8%	167,5%	0,18	68	-0,31%	-2,88%
TDJ24	\$ 911,00	Diales (DL)	-21,7%	112,1%	0,34	129	1,79%	1,79%
TDG24	\$ 903,50	Diales (DL)	-13,8%	130,1%	0,51	190	0,78%	-3,37%
TDE25	\$ 1.000,00	Diales (DL)	-17,3%	154,1%	0,93	344	-0,29%	9,89%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 1.348,50	CER	-84,7%	0,08	0,78%	1,47%
T3X4	\$ 347,00	CER	-72,3%	0,13	0,52%	1,17%
T6X4	\$ 270,00	CER	-69,5%	0,23	0,77%	3,45%
T2X4	\$ 1.212,00	CER	-53,8%	0,41	0,12%	2,28%
T4X4	\$ 408,20	CER	-39,2%	0,63	0,54%	5,89%
TSX4	\$ 330,00	CER	-30,5%	0,77	1,85%	5,26%
T2X5	\$ 393,00	CER	-24,5%	1,26	0,00%	3,42%
TX25	\$ 687,00	CER	-14,0%	1,69	1,03%	9,92%
TZ26	\$ 1.260,00	CER	-8,7%	1,73	-0,24%	1,61%
TZX26	\$ 128,50	CER	-4,1%	2,34	0,51%	5,33%
TZK27	\$ 131,00	CER	-3,4%	3,34	-0,38%	10,55%
TX28	\$ 1.392,00	CER	-8,9%	2,60	-2,66%	1,83%
DICP	\$ 26.320,00	CER	0,7%	4,66	-6,33%	2,51%
PARP	\$ 14.160	CER	3,6%	9,12	-0,77%	2,76%
TO26	\$ 40,26	Fija	90,4%	1,72	0,40%	2,44%
BDC24	\$ 118,70	Badlar	133,1%	0,09	1,02%	2,59%
PBA25	\$ 111,00	Badlar	175,1%	0,68	0,63%	4,03%
BDC28	\$ 110,00	Badlar	149,2%	1,17	0,00%	-18,46%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 47,48	47%	31,9%	2,53	1,00%	2,11%	2,33%	2,77%
GD29	\$ 48,70	48%	30,6%	2,55	1,00%	2,05%	1,46%	-2,79%
AL30	\$ 45,81	45%	30,8%	2,63	0,75%	1,64%	4,21%	1,55%
GD30	\$ 48,01	48%	28,5%	2,68	0,75%	1,56%	2,70%	0,86%
AL35	\$ 38,49	37%	20,1%	6,27	3,63%	9,42%	3,19%	4,06%
GD35	\$ 39,20	39%	19,8%	6,30	3,63%	9,25%	4,53%	5,94%
AE38	\$ 41,55	40%	21,6%	5,21	4,25%	10,23%	4,13%	5,78%
GD38	\$ 43,84	44%	20,3%	5,32	4,25%	9,69%	1,48%	4,08%
AL41	\$ 37,11	36%	19,1%	6,28	3,50%	9,43%	0,57%	2,23%
GD41	\$ 38,25	38%	18,5%	6,35	3,50%	9,15%	2,82%	4,51%
GD46	\$ 41,45	40%	18,7%	5,40	3,00%	7,24%	2,98%	-0,84%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
7	29/2/2024	\$ 844,90	0,8%	50,1%	40,7%	3,44%
38	31/3/2024	\$ 878,00	4,7%	55,9%	45,4%	3,77%
64	26/4/2024	\$ 937,00	11,8%	88,6%	67,1%	5,43%
99	31/5/2024	\$ 1.001,50	19,5%	92,6%	71,7%	5,62%
129	30/6/2024	\$ 1.074,00	28,1%	101,6%	79,5%	6,01%
158	29/7/2024	\$ 1.166,50	39,1%	114,5%	90,4%	6,57%
191	31/8/2024	\$ 1.220,00	45,5%	104,8%	87,0%	6,16%
220	29/9/2024	\$ 1.330,00	58,6%	115,0%	97,3%	6,59%
252	31/10/2024	\$ 1.395,00	66,4%	109,1%	96,2%	6,34%
282	30/11/2024	\$ 1.480,00	76,5%	108,7%	99,1%	6,32%
312	30/12/2024	\$ 1.612,00	92,3%	114,9%	108,0%	6,58%
343	30/1/2025	\$ 1.690,00	101,6%	110,9%	108,1%	6,41%

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

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

