

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 983,83 CCL⁽¹⁾: \$ 1.189,71 MEP⁽²⁾: \$ 1.158,42 Brecha: 20,93% Devaluación⁽³⁾: 1,72%
 (1) Promedio a través de GD30. (2) Calculado con GD30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de Septiembre.

Inflación⁽⁴⁾: 3,50% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 40,44% Tasa Caucción: 35,61%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.181,10	Duales (CER)	10,5%	25,6%	0,28	105	-0,75%	-1,47%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 965,00	Dólar linked	4,53%	20,15%	0,42	164	0,31%	-3,06%
TZV25	\$ 965,00	Dólar linked	3,49%	0,00%	0,65	255	-2,52%	-0,62%
TZVDS	\$ 970,00	Dólar linked	1,04%	0,00%	1,15	423	1,02%	-2,02%
TZV26	\$ 903,00	Dólar linked	5,06%	0,00%	1,53	620	0,00%	-2,90%
TDE25	\$ 1.181,10	Duales (DL)	-48,43%	-35,83%	0,28	105	-0,75%	-1,47%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 479,00	CER	5,93%	0,15	0,00%	0,31%
TZK5	\$ 580,50	CER	7,14%	0,28	-0,09%	0,02%
TZXM5	\$ 127,10	CER	6,37%	0,44	0,32%	0,63%
TZK25	\$ 180,00	CER	10,82%	0,69	0,06%	-1,77%
TX26	\$ 1.924,00	CER	11,97%	0,98	0,31%	0,05%
TZ25	\$ 947,80	CER	10,24%	1,04	-0,23%	-0,23%
TZKDS	\$ 154,50	CER	10,94%	1,15	0,82%	-0,19%
TZXM6	\$ 119,50	CER	11,62%	1,44	0,21%	-0,83%
TZK26	\$ 196,80	CER	11,20%	1,69	0,03%	-0,03%
TX28	\$ 1.610,00	CER	11,68%	1,83	-0,12%	-0,12%
TZK6	\$ 138,00	CER	11,41%	2,15	0,00%	0,00%
TZXM7	\$ 105,00	CER	9,35%	2,44	-0,94%	-0,94%
TZK27	\$ 173,70	CER	11,98%	2,69	0,40%	-1,08%
TZK27	\$ 122,75	CER	11,73%	3,15	-0,20%	-0,61%
DICP	\$ 32.625,00	CER	13,07%	3,46	-0,68%	-0,82%
TZK28	\$ 155,50	CER	11,89%	3,69	1,50%	-1,83%
PARP	\$ 16.000,00	CER	11,19%	7,85	-1,42%	-1,20%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 70,40	18,1%	69,2%	2,11	1,00%	1,42%	1,00%	0,57%
GD29	\$ 72,60	16,4%	71,3%	2,14	1,00%	1,38%	0,97%	0,21%
AL30	\$ 62,12	19,0%	61,3%	2,45	0,75%	1,21%	-0,26%	0,44%
GD30	\$ 63,90	17,7%	63,9%	2,48	0,75%	1,17%	-0,47%	0,08%
AL35	\$ 55,78	14,4%	52,0%	6,33	3,63%	6,50%	1,05%	0,83%
GD35	\$ 56,00	14,4%	56,0%	6,34	3,63%	6,47%	0,63%	-0,18%
AE38	\$ 59,00	15,2%	59,0%	5,35	4,25%	7,20%	1,20%	1,20%
GD38	\$ 60,40	14,7%	60,4%	5,40	4,25%	7,04%	-0,05%	-0,67%
AL41	\$ 51,00	14,4%	48,0%	6,51	3,50%	6,86%	-0,43%	-2,21%
GD41	\$ 51,81	14,1%	51,8%	6,55	3,50%	6,76%	0,23%	-1,87%
GD46	\$ 58,00	13,1%	58,0%	5,97	3,00%	5,17%	1,22%	-2,85%
BPA7D	\$ 74,94	0,2%	74,9%	0,36	0,00%	0,00%	-0,48%	-1,72%
BPA7D	\$ 99,00	15,8%	99,0%	0,50	5,00%	5,05%	0,51%	-0,99%
BPA7D	\$ 93,64	13,1%	93,6%	1,42	5,00%	5,34%	-0,27%	-0,33%
BPA7D	\$ 88,99	12,4%	89,0%	2,28	5,00%	5,62%	0,55%	-0,66%
BPA7D	\$ 87,31	13,1%	87,3%	2,49	5,00%	5,73%	0,70%	-0,44%
BPA7D	\$ 90,88	11,1%	90,9%	0,82	3,00%	3,30%	-0,24%	-0,89%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
13	31/10/2024	\$ 994,0	1,0%	33,5%	29,0%	2,44%
43	30/11/2024	\$ 1.021,0	3,8%	37,0%	32,1%	2,66%
73	30/12/2024	\$ 1.050,0	6,7%	38,5%	33,6%	2,75%
104	30/1/2025	\$ 1.086,5	10,4%	41,7%	36,6%	2,95%
133	28/2/2025	\$ 1.117,0	13,5%	41,7%	37,1%	2,95%
164	31/3/2025	\$ 1.145,0	16,4%	40,2%	36,5%	2,85%
194	30/4/2025	\$ 1.178,0	19,7%	40,3%	37,1%	2,86%
225	31/5/2025	\$ 1.209,0	22,9%	39,7%	37,1%	2,83%
254	29/6/2025	\$ 1.240,0	26,0%	39,5%	37,4%	2,81%
286	31/7/2025	\$ 1.271,0	29,2%	38,7%	37,3%	2,76%
317	31/8/2025	\$ 1.301,0	32,2%	38,0%	37,1%	2,72%
347	30/9/2025	\$ 1.332,0	35,4%	37,5%	37,2%	2,69%

* Supuestos de Inflación propios: 3% a partir de Octubre.

Supuestos de Devaluación: 2% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

