

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1003,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.102,51 MEP⁽²⁾: \$ 1.070,65 Brecha: 9,84% Devaluación⁽³⁾: 1,92% Inflación⁽⁴⁾: 2,70% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 34,69% Tasa Caución: 32,40%

(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	\$ 1.250,00	Duales (CER)	5,6%	16,6%	0,19	72	-0,24%	0,56%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 978,00	Dólar linked	8,02%	33,31%	0,33	131	0,56%	-0,51%
TZV25	\$ 976,90	Dólar linked	5,56%	0,00%	0,54	222	0,09%	-0,31%
TZV25	\$ 988,00	Dólar linked	1,40%	0,00%	1,06	390	1,53%	-0,19%
TZV26	\$ 895,00	Dólar linked	7,34%	0,00%	1,39	587	-1,10%	1,70%
TDE25	\$ 1.250,00	Duales (DL)	-67,79%	-82,18%	0,19	72	-0,24%	0,56%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 501,8	CER	2,28%	0,06	0,16%	0,30%
TZ5	\$ 614,0	CER	2,30%	0,22	0,11%	0,16%
TZXM5	\$ 135,0	CER	1,82%	0,36	0,07%	-0,07%
TZXM5	\$ 195,4	CER	4,79%	0,61	0,18%	-0,05%
TX26	\$ 1.634,0	CER	7,75%	1,19	-0,06%	-0,06%
TX25	\$ 1.053,0	CER	3,79%	0,95	0,00%	1,30%
TZXD5	\$ 167,8	CER	7,46%	1,07	-0,18%	-0,50%
TZXM6	\$ 131,4	CER	7,89%	1,36	-0,38%	-0,34%
TZXM6	\$ 216,5	CER	8,00%	1,61	-0,18%	-0,37%
TX28	\$ 1.563,0	CER	7,69%	2,09	-0,57%	-1,08%
TZXD6	\$ 154,3	CER	8,08%	2,07	-0,10%	-0,32%
TZXM7	\$ 115,0	CER	7,33%	2,36	1,05%	1,41%
TZXM7	\$ 199,5	CER	8,21%	2,61	-0,13%	-0,15%
TZXD7	\$ 140,5	CER	8,64%	3,07	0,14%	-0,15%
DICP	\$ 38.000,0	CER	8,51%	3,67	0,22%	0,08%
TZXM8	\$ 181,6	CER	8,65%	3,61	0,06%	-0,49%
PARP	\$ 20.315,0	CER	8,55%	8,04	-0,56%	-1,62%
S29N4	\$ 133,93	Fija	39,88%	0,02	0,10%	0,17%
S13D4	\$ 124,25	Fija	40,68%	0,06	0,16%	0,24%
S17E5	\$ 124,60	Fija	39,07%	0,16	0,28%	0,27%
S31E5	\$ 161,80	Fija	39,62%	0,19	0,23%	0,37%
S14F5	\$ 112,08	Fija	40,10%	0,23	0,20%	-0,02%
S28F5	\$ 144,89	Fija	38,55%	0,27	-0,08%	0,10%
S14M5	\$ 113,85	Fija	38,63%	0,31	0,22%	0,00%
S31M5	\$ 138,56	Fija	38,45%	0,36	0,26%	-0,03%
S16A5	\$ 115,40	Fija	37,85%	0,40	0,26%	0,00%
S28A5	\$ 113,75	Fija	38,11%	0,43	0,26%	0,14%
S16V5	\$ 117,39	Fija	37,47%	0,48	-0,01%	-0,18%
S30V5	\$ 115,40	Fija	37,74%	0,52	0,13%	-0,26%
S18J5	\$ 123,10	Fija	37,45%	0,57	0,24%	0,04%
S30J5	\$ 121,20	Fija	36,93%	0,61	0,50%	0,33%
S31L5	\$ 119,20	Fija	36,47%	0,69	0,08%	-0,17%
S29G5	\$ 123,90	Fija	36,80%	0,77	0,08%	-0,40%
S12S5	\$ 124,00	Fija	35,99%	0,81	0,16%	0,13%
S30S5	\$ 124,00	Fija	34,35%	0,86	0,20%	0,00%
T17O5	\$ 121,45	Fija	34,59%	0,90	0,00%	-0,04%
T15D5	\$ 125,30	Fija	33,76%	1,07	0,44%	-0,04%
TO26	\$ 82,99	Fija	30,79%	1,67	-0,01%	-0,07%
PBA25	\$ 104,80	Badlar	41,90%	0,77	-0,01%	-0,18%
BDC28	\$ 112,00	Badlar	42,56%	0,81	0,13%	-0,26%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 78,05	13,1%	76,6%	2,11	1,00%	1,28%	-0,29%	0,58%
GD29	\$ 81,60	10,7%	80,1%	2,15	1,00%	1,23%	1,17%	1,57%
AL30	\$ 71,07	13,3%	70,1%	2,50	0,75%	1,06%	0,17%	1,85%
GD30	\$ 73,20	12,0%	73,2%	2,54	0,75%	1,02%	-0,14%	0,97%
AL35	\$ 68,05	11,1%	63,2%	6,50	3,63%	5,33%	1,89%	3,01%
GD35	\$ 67,50	11,3%	67,5%	6,49	3,63%	5,37%	0,75%	2,04%
AE38	\$ 70,60	11,7%	70,6%	5,61	4,25%	6,02%	0,61%	0,86%
GD38	\$ 71,85	11,4%	71,9%	5,64	4,25%	5,92%	0,91%	1,30%
AL41	\$ 63,50	10,9%	59,6%	6,93	3,50%	5,51%	1,11%	-0,16%
GD41	\$ 63,12	11,0%	63,1%	6,92	3,50%	5,54%	1,32%	1,79%
GD46	\$ 67,70	10,5%	67,7%	6,49	3,00%	4,43%	1,12%	0,74%
BPI5D	\$ 68,12	-6,6%	68,1%	0,32	0,00%	0,00%	-0,18%	0,32%
BPA7D	\$ 96,25	15,4%	96,3%	0,44	5,00%	5,19%	0,26%	0,05%
BPB7D	\$ 92,15	11,6%	92,2%	1,40	5,00%	5,43%	-0,70%	-0,49%
BPC7D	\$ 86,95	11,8%	87,0%	2,31	5,00%	5,75%	-0,87%	-1,06%
BDP7D	\$ 87,10	11,5%	87,1%	2,53	5,00%	5,74%	-0,80%	-0,81%
BPY6D	\$ 94,60	8,3%	94,6%	0,76	3,00%	3,17%	-0,47%	-0,42%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
10	30/11/2024	\$ 1.013,0	0,9%	39,8%	33,6%	2,83%
41	31/12/2024	\$ 1.038,0	3,4%	34,8%	30,4%	2,52%
71	30/1/2025	\$ 1.063,0	5,9%	34,3%	30,3%	2,49%
99	27/2/2025	\$ 1.081,0	7,7%	31,4%	28,4%	2,30%
131	31/3/2025	\$ 1.099,5	9,5%	28,9%	26,6%	2,14%
161	30/4/2025	\$ 1.118,0	11,4%	27,7%	25,8%	2,06%
192	31/5/2025	\$ 1.140,0	13,6%	27,4%	25,8%	2,04%
222	30/6/2025	\$ 1.155,0	15,1%	26,0%	24,8%	1,94%
252	30/7/2025	\$ 1.174,0	17,0%	25,5%	24,6%	1,91%
284	31/8/2025	\$ 1.195,0	19,1%	25,1%	24,5%	1,89%
314	30/9/2025	\$ 1.208,0	20,3%	24,0%	23,7%	1,81%
345	31/10/2025	\$ 1.235,0	23,0%	24,5%	24,4%	1,84%

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

Inflación⁽⁴⁾: 2,70% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 34,69% Tasa Caución: 32,40%

