

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1013,17 CCI^[1]: \$ 1.094,34 MEP^[2]: \$ 1.068,36 Brecha: 8,01% Devaluación^[3]: 2,36%

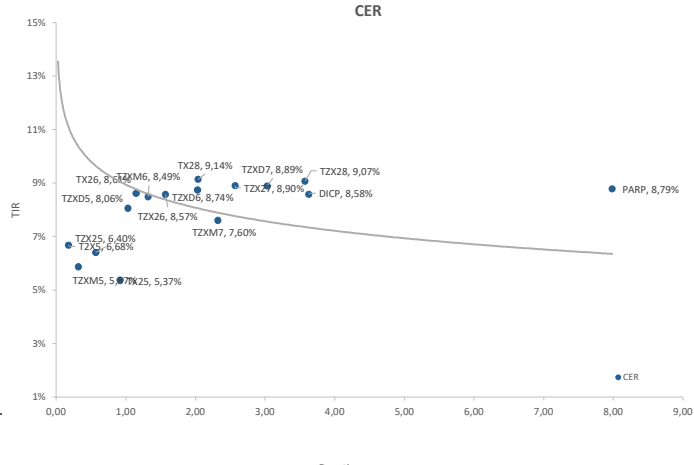
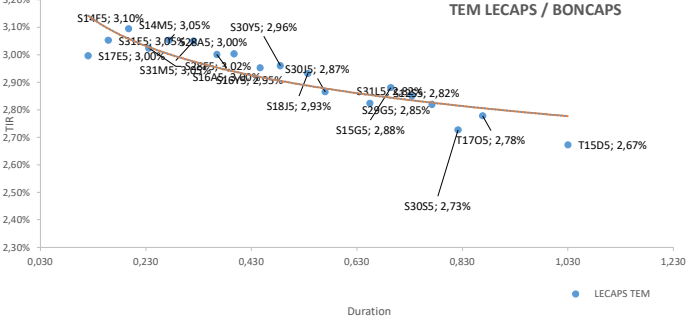
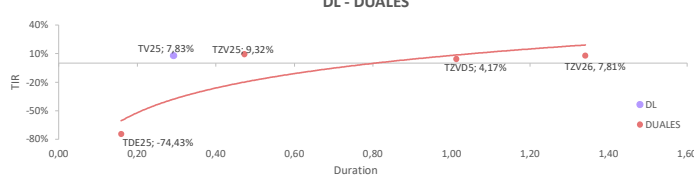
Inflación^[4]: 2,70% Tasa LeFi: 35% Tasa Badlar: 36,50% Tasa Caución: 31,70%

[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	\$ 1.256,50	Duales (CER)	3,3%	0,0%	0,16	59	1,10%	-0,67%

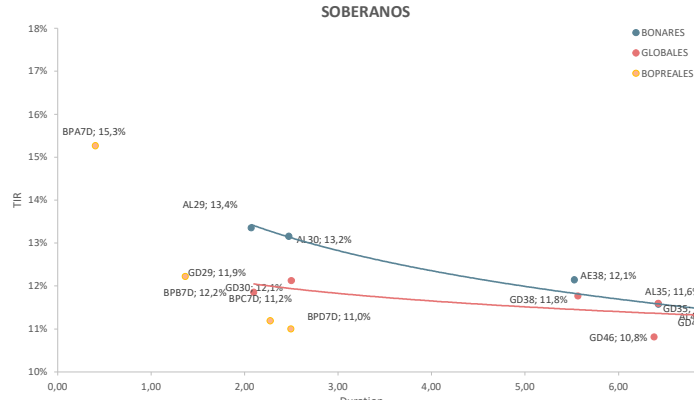
Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 990,00	Dólar linked	7,83%	32,93%	0,29	118	0,00%	-0,30%
TZV25	\$ 968,00	Dólar linked	9,32%	0,00%	0,47	209	0,94%	-0,92%
TZVD5	\$ 970,00	Dólar linked	4,17%	0,00%	1,01	377	4,45%	4,30%
TZV26	\$ 899,00	Dólar linked	7,81%	0,00%	1,34	574	0,00%	-0,66%
TDE25	\$ 1.256,50	Duales (DL)	-74,43%	0,00%	0,16	59	1,10%	-0,67%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TSX4	\$ 507,4	CER	20,93%	0,02	0,02%	0,14%
TZX5	\$ 618,3	CER	6,68%	0,18	0,19%	0,16%
TZXM5	\$ 135,4	CER	5,87%	0,32	-0,37%	-0,40%
TZX25	\$ 196,9	CER	6,40%	0,57	0,28%	0,10%
TX26	\$ 1.647,0	CER	8,61%	1,15	0,30%	0,43%
TX25	\$ 1.055,0	CER	5,37%	0,92	-0,14%	-0,09%
TZXD5	\$ 169,7	CER	8,06%	1,03	0,18%	0,38%
TZXM6	\$ 132,7	CER	8,49%	1,32	0,23%	0,49%
TZX26	\$ 218,5	CER	8,57%	1,57	0,41%	0,21%
TX28	\$ 1.547,0	CER	9,14%	2,04	0,03%	0,16%
TZXD6	\$ 155,0	CER	8,74%	2,03	0,36%	0,26%
TZXM7	\$ 116,3	CER	7,60%	2,32	1,13%	0,35%
TZX27	\$ 199,7	CER	8,90%	2,57	0,88%	-0,22%
TZXD7	\$ 142,0	CER	8,89%	3,03	0,75%	0,67%
DICP	\$ 38.360,0	CER	8,58%	3,63	0,95%	0,42%
TZX28	\$ 182,3	CER	9,07%	3,57	0,41%	0,33%
PARP	\$ 20.315,0	CER	8,79%	7,98	-0,07%	-0,29%
S13D4	\$ 125,65	Fija	46,18%	0,02	0,06%	0,18%
S17E5	\$ 125,70	Fija	42,52%	0,12	0,09%	0,10%
S31E5	\$ 163,03	Fija	43,46%	0,16	0,09%	0,08%
S14F5	\$ 112,80	Fija	44,14%	0,20	-0,04%	0,08%
S28F5	\$ 145,50	Fija	42,98%	0,24	-0,21%	-0,21%
S14M5	\$ 114,10	Fija	43,49%	0,27	-0,04%	-0,04%
S31M5	\$ 138,60	Fija	43,41%	0,32	0,02%	-0,04%
S16A5	\$ 115,29	Fija	42,60%	0,36	0,08%	0,08%
S28A5	\$ 113,60	Fija	42,64%	0,40	0,04%	0,22%
S16Y5	\$ 117,10	Fija	41,79%	0,45	0,17%	0,04%
S30Y5	\$ 115,04	Fija	41,93%	0,48	-0,05%	0,04%
S18J5	\$ 122,60	Fija	41,45%	0,54	0,12%	0,25%
S30J5	\$ 120,85	Fija	40,36%	0,57	0,22%	0,35%
S31L5	\$ 118,70	Fija	39,69%	0,65	0,38%	0,29%
S29G5	\$ 123,10	Fija	40,12%	0,73	0,00%	0,08%
S12S5	\$ 122,85	Fija	39,61%	0,77	-0,16%	-0,12%
S30S5	\$ 122,50	Fija	38,11%	0,82	0,20%	0,25%
T17O5	\$ 119,40	Fija	38,94%	0,87	-0,38%	-0,50%
T15D5	\$ 123,35	Fija	37,19%	1,03	-0,48%	-0,44%
T13F6	\$ 100,45	Fija	33,18%	1,19	0,05%	0,45%
TO26	\$ 82,99	Fija	31,55%	1,64	0,11%	0,24%
PBA25	\$ 106,00	Badlar	49,89%	0,33	-0,61%	-0,14%
PBY26	\$ 104,50	Badlar	48,35%	1,12	1,85%	1,46%
BDC28	\$ 102,90	Badlar	48,38%	0,41	-0,10%	-1,95%



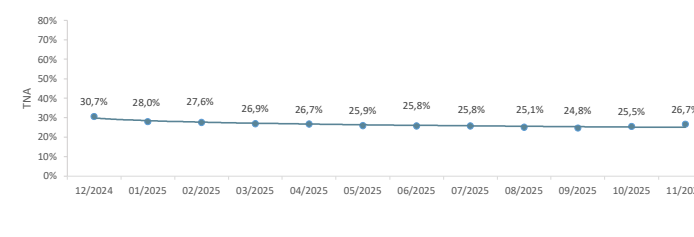
BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 78,00	13,4%	76,5%	2,07	1,00%	1,28%	0,44%	0,49%
GD29	\$ 80,20	11,9%	78,7%	2,10	1,00%	1,25%	0,00%	1,19%
AL30	\$ 71,65	13,2%	70,6%	2,47	0,75%	1,05%	-0,28%	0,90%
GD30	\$ 73,30	12,1%	73,3%	2,50	0,75%	1,02%	0,14%	0,66%
AL35	\$ 66,49	11,6%	61,7%	6,43	3,63%	5,45%	-0,75%	-0,42%
GD35	\$ 66,41	11,6%	66,4%	6,43	3,63%	5,46%	-0,54%	-0,52%
AE38	\$ 69,39	12,1%	69,4%	5,53	4,25%	6,12%	-0,46%	-1,07%
GD38	\$ 70,70	11,8%	70,7%	5,57	4,25%	6,01%	-1,53%	-0,35%
AL41	\$ 62,51	11,2%	58,6%	6,85	3,50%	5,60%	-0,83%	0,08%
GD41	\$ 62,10	11,3%	62,1%	6,83	3,50%	5,64%	-0,72%	-1,35%
GD46	\$ 66,80	10,8%	66,8%	6,38	3,00%	4,49%	-0,15%	-0,73%
BPJ5D	\$ 60,00	-8,4%	60,0%	0,32	0,00%	0,00%	0,54%	2,04%
BPA7D	\$ 96,80	15,3%	96,8%	0,40	5,00%	5,17%	0,31%	0,31%
BPB7D	\$ 91,83	12,3%	91,8%	1,36	5,00%	5,44%	-0,52%	-0,52%
BP7D	\$ 88,30	11,2%	88,3%	2,27	5,00%	5,66%	0,34%	0,34%
BPD7D	\$ 88,49	11,0%	88,5%	2,50	5,00%	5,65%	0,05%	0,05%
BPV6D	\$ 93,90	9,2%	93,9%	1,21	3,00%	3,19%	-0,58%	-0,12%



FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
28	31/12/2024	\$ 1.037,0	2,4%	35,4%	30,7%	2,56%
59	31/1/2025	\$ 1.059,0	4,5%	31,5%	28,0%	2,31%
86	27/2/2025	\$ 1.079,0	6,5%	30,6%	27,6%	2,25%
117	30/3/2025	\$ 1.100,5	8,6%	29,4%	26,9%	2,17%
148	30/4/2025	\$ 1.123,0	10,8%	28,9%	26,7%	2,14%
179	31/5/2025	\$ 1.142,0	12,7%	27,6%	25,9%	2,05%
209	30/6/2025	\$ 1.163,0	14,8%	27,2%	25,8%	2,03%
240	31/7/2025	\$ 1.185,0	17,0%	26,9%	25,8%	2,01%
270	30/8/2025	\$ 1.201,5	18,6%	25,9%	25,1%	1,94%
301	30/9/2025	\$ 1.220,0	20,4%	25,3%	24,8%	1,89%
332	31/10/2025	\$ 1.248,0	23,2%	25,8%	25,5%	1,93%
362	30/11/2025	\$ 1.281,5	26,5%	26,7%	26,7%	1,99%



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