

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: 1018,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.076,73 MEP⁽²⁾: \$ 1.053,13 Brecha: 5,69% Devaluación⁽³⁾: 2,12% Inflación⁽⁴⁾: 2,40% Tasa LeFi: 32% Tasa Badlar: 31,3% Tasa Caución: 31,50%

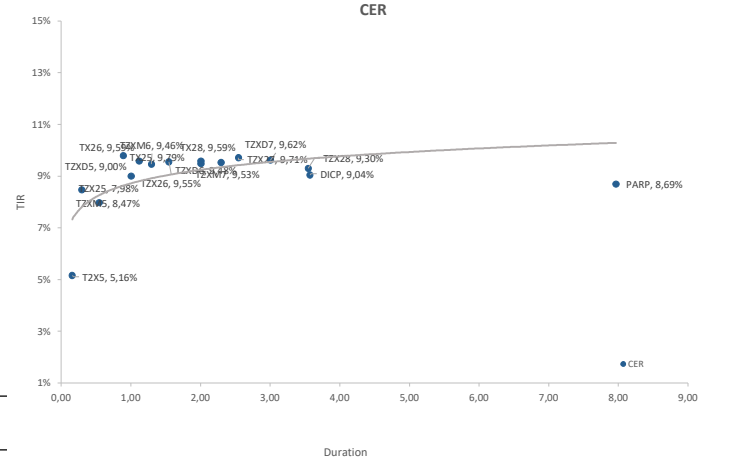
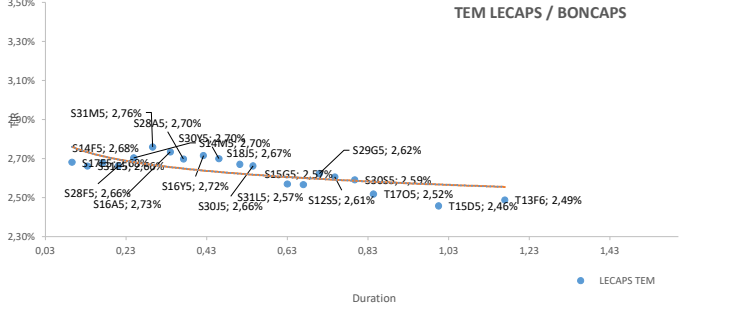
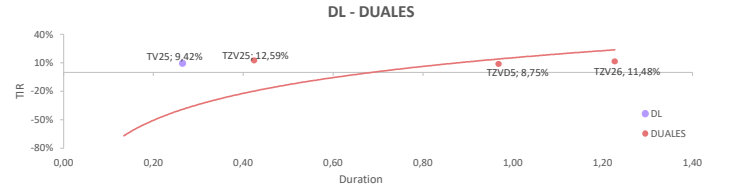
⁽¹⁾ Promedio a través de GD30. ⁽²⁾ Calculado con GD30. ⁽³⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual). ⁽⁴⁾ Inflación mensual de Octubre.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.278,90	Duales (CER)	3,3%	0,0%	0,13	50	1,10%	1,10%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TV25	\$ 993,00	Dólar linked	9,42%	34,40%	0,26	109	0,25%	0,00%
TZV25	\$ 959,90	Dólar linked	12,59%	0,00%	0,42	200	-1,95%	-1,75%
TZV05	\$ 935,00	Dólar linked	8,75%	0,00%	0,97	368	0,00%	0,54%
TZV26	\$ 860,00	Dólar linked	11,48%	0,00%	1,23	565	-2,26%	-4,97%
TDE25	\$ 1.278,90	Duales (DL)	-81,82%	0,00%	0,13	50	1,10%	1,10%

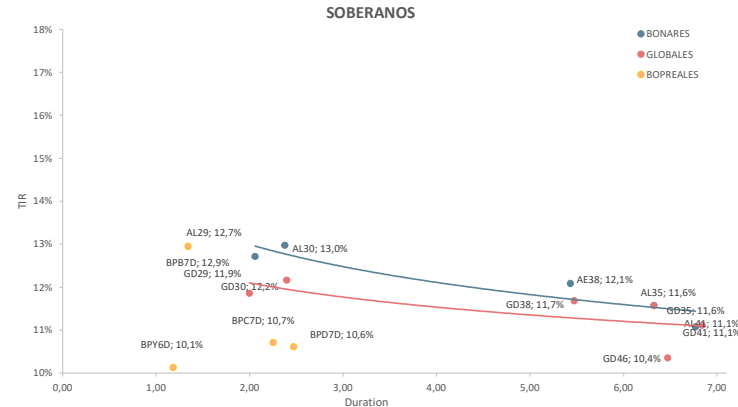
Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TZX5	\$ 625,8	CER	5,16%	0,16	0,13%	1,38%
TZXM5	\$ 135,7	CER	8,47%	0,30	-0,44%	-0,18%
TZX25	\$ 197,2	CER	7,98%	0,55	0,13%	0,25%
TK26	\$ 1.647,0	CER	9,59%	1,12	0,37%	0,43%
TX25	\$ 1.026,5	CER	9,79%	0,89	0,34%	-2,79%
TZXD5	\$ 169,9	CER	9,00%	1,01	0,27%	0,54%
TZXM6	\$ 132,5	CER	9,46%	1,30	0,08%	0,34%
TZX26	\$ 217,6	CER	9,55%	1,55	0,05%	-0,18%
TX28	\$ 1.550,0	CER	9,59%	2,01	0,00%	0,36%
TZXD6	\$ 154,5	CER	9,48%	2,01	-0,03%	-0,10%
TZXM7	\$ 112,8	CER	9,53%	2,30	-0,66%	-2,72%
TZX27	\$ 197,9	CER	9,71%	2,55	0,92%	-1,10%
TZXD7	\$ 140,6	CER	9,62%	3,01	-0,32%	-0,32%
DICP	\$ 38.150,0	CER	9,04%	3,57	-0,21%	-0,13%
TZX28	\$ 182,8	CER	9,30%	3,55	0,41%	0,61%
PARP	\$ 20.660,0	CER	8,69%	7,97	0,34%	1,40%
S17E5	\$ 127,25	Fija	37,37%	0,10	0,08%	1,33%
S31E5	\$ 165,50	Fija	37,05%	0,13	0,14%	1,60%
S14F5	\$ 114,78	Fija	37,31%	0,17	-0,10%	1,84%
S28F5	\$ 148,10	Fija	37,07%	0,21	-0,07%	1,58%
S14M5	\$ 116,30	Fija	37,74%	0,25	0,26%	1,88%
S31M5	\$ 141,25	Fija	38,63%	0,30	0,32%	1,88%
S16A5	\$ 117,55	Fija	38,22%	0,34	0,47%	2,04%
S28A5	\$ 116,13	Fija	37,65%	0,37	0,11%	2,65%
S16Y5	\$ 119,50	Fija	37,92%	0,42	0,21%	2,22%
S30Y5	\$ 117,68	Fija	37,66%	0,46	-0,90%	2,34%
S18J5	\$ 125,60	Fija	37,20%	0,51	0,46%	2,70%
S30J5	\$ 123,45	Fija	37,07%	0,55	-0,20%	2,51%
S31L5	\$ 121,95	Fija	35,59%	0,63	0,78%	3,03%
S29G5	\$ 126,50	Fija	36,43%	0,71	0,00%	2,85%
S12S5	\$ 126,20	Fija	36,17%	0,75	-0,16%	2,60%
S30S5	\$ 125,05	Fija	35,94%	0,80	-0,36%	2,34%
T17O5	\$ 123,50	Fija	34,78%	0,84	0,41%	2,92%
T15D5	\$ 127,50	Fija	33,78%	1,01	0,71%	2,91%
T13F6	\$ 102,70	Fija	34,26%	1,17	0,05%	2,70%
TO26	\$ 84,38	Fija	30,75%	1,61	1,03%	0,06%
PBA25	\$ 107,50	Badlar	33,38%	0,31	0,56%	1,27%
PBY26	\$ 107,00	Badlar	36,07%	1,15	0,38%	3,88%
BDC28	\$ 105,10	Badlar	37,85%	0,33	0,57%	0,14%

Inflación⁽⁴⁾: 2,40% Tasa LeFi: 32% Tasa Badlar: 31,3% Tasa Caución: 31,50%



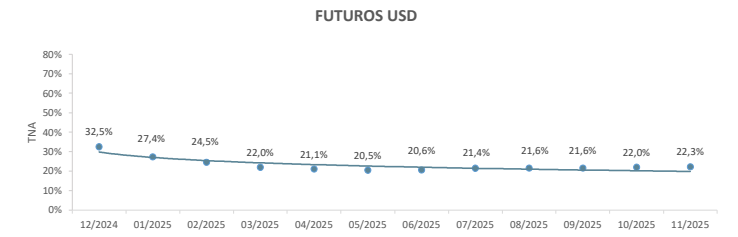
BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 79,16	12,7%	77,7%	2,06	1,00%	1,26%	0,46%	1,98%
GD29	\$ 81,11	11,9%	79,5%	2,00	1,00%	1,23%	0,41%	2,33%
AL30	\$ 72,84	13,0%	71,8%	2,38	0,75%	1,03%	0,11%	2,58%
GD30	\$ 74,10	12,2%	74,1%	2,40	0,75%	1,01%	-0,20%	1,76%
AL35	\$ 67,25	11,6%	62,1%	6,33	3,63%	5,39%	0,07%	0,72%
GD35	\$ 67,27	11,6%	67,3%	6,33	3,63%	5,39%	-0,04%	0,76%
AE38	\$ 70,40	12,1%	70,4%	5,43	4,25%	6,04%	0,23%	0,37%
GD38	\$ 71,80	11,7%	71,8%	5,47	4,25%	5,92%	0,00%	1,20%
AL41	\$ 63,75	11,1%	59,6%	6,77	3,50%	5,49%	0,41%	2,07%
GD41	\$ 63,10	11,1%	63,1%	6,84	3,50%	5,55%	0,56%	0,24%
GD46	\$ 68,80	10,4%	68,8%	6,47	3,00%	4,36%	1,78%	2,24%
BPJ5D	\$ 58,86	-3,0%	58,9%	0,30	0,00%	0,00%	0,29%	0,10%
BPA7D	\$ 96,06	18,7%	96,1%	0,38	5,00%	5,21%	-0,49%	-0,46%
BPB7D	\$ 91,30	12,9%	91,3%	1,34	5,00%	5,48%	-0,36%	-1,09%
BPC7D	\$ 89,40	10,7%	89,4%	2,25	5,00%	5,59%	0,22%	1,59%
BPD7D	\$ 89,50	10,6%	89,5%	2,47	5,00%	5,59%	0,16%	1,19%
BPY6D	\$ 93,20	10,1%	93,2%	1,18	3,00%	3,22%	0,11%	-0,86%



FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
19	31/12/2024	\$ 1.036,0	Directa	38,1%	32,5%	2,72%
50	31/1/2025	\$ 1.057,0	3,8%	30,9%	27,4%	2,27%
77	27/2/2025	\$ 1.071,5	5,2%	27,0%	24,5%	2,01%
108	30/3/2025	\$ 1.085,0	6,5%	23,7%	22,0%	1,79%
139	30/4/2025	\$ 1.100,5	8,0%	22,5%	21,1%	1,70%
170	31/5/2025	\$ 1.116,0	9,5%	21,6%	20,5%	1,64%
200	30/6/2025	\$ 1.134,0	11,3%	21,6%	20,6%	1,64%
231	31/7/2025	\$ 1.157,0	13,6%	22,3%	21,4%	1,69%
261	30/8/2025	\$ 1.176,0	15,4%	22,2%	21,6%	1,69%
292	30/9/2025	\$ 1.195,0	17,3%	22,1%	21,6%	1,68%
323	31/10/2025	\$ 1.217,0	19,5%	22,3%	22,0%	1,69%
353	30/11/2025	\$ 1.238,0	21,5%	22,3%	22,3%	1,69%



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