

Informe Renta Fija a Nivel Local al 02/09/2024

Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
Obligaciones Negociables en Dólares											
USD	ARC1D	Aeropuertos Argentina 2000	8,500%	Nueva York	1/8/2031	7,268%	1,95	\$ 1,065	1.000	01/02, 02/05, 02/08 y 22/11	Trimestralmente desde Feb./2026 en un % variable
USD	RCCJD	Arcor	8,250%	Nueva York	9/10/2027	4,206%	1,48	\$ 1,095	1	09/04 y 09/10	14,285% semestral desde 09/10/2024; 14,29% al vencimiento
USD	RCCMD	Arcor	3,500%	Argentina	22/11/2025	4,025%	1,20	\$ 1,004	1	22/05 y 22/11	Bullet
USD	CP17D	Cía. Gral. de Combustibles	9,500%	Nueva York	8/3/2025	7,883%	0,36	\$ 0,493	1.000	08/03 y 08/09	13,30% semestral desde 08/09/2022 hasta 08/09/2024; y 33,50% al vencimiento
USD	CS38D	Cresud	8,000%	Argentina	3/3/2026	5,601%	1,28	\$ 1,045	1	03/01 y 03/07	Bullet
USD	DNC2D	EDENOR	9,750%	Argentina	22/11/2024	8,528%	0,22	\$ 1,031	1	22/05 y 22/11	Bullet
USD	MRCLD	Generación Mediterránea	9,500%	Argentina	27/7/2025	25,104%	0,87	\$ 0,900	1	27/01 y 27/07	Bullet
USD	MRCAD	Generación Mediterránea	9,875%	Nueva York	1/12/2027	19,154%	1,55	\$ 0,669	1	01/06 y 01/12	3,5% semestral desde 01/12/2022 hasta 01/06/2023; 7% el 01/12/2023; 10% semestral desde 01/06/2024 hasta 01/06/2027; 14% al vencimiento
USD	IRCFD	IRSA	8,750%	Nueva York	22/6/2028	5,517%	2,28	\$ 0,902	1	22/06 y 22/12	17,50% anual desde 22/06/2024 hasta 22/06/2027; y 30% al vencimiento
USD	IRCGD	IRSA	8,000%	Argentina	25/3/2025	3,903%	0,55	\$ 1,030	1	31/01 y 31/07	Bullet
USD	IRCHD	IRSA	7,000%	Argentina	25/7/2025	5,437%	0,87	\$ 1,021	1	31/01 y 31/07	Bullet
USD	IRCID	IRSA	5,000%	Argentina	7/12/2025	7,036%	1,23	\$ 0,989	1	07/06 y 07/12	Bullet
USD	LOC2D	Loma Negra	5,000%	Argentina	7/12/2025	5,388%	1,23	\$ 1,008	1	07/06 y 07/12	Bullet
USD	LOC3D	Loma Negra	7,490%	Argentina	11/3/2026	6,980%	1,41	\$ 1,045	1	11/03 y 11/09	Bullet
USD	MTCGD	Mastellone Hnos.	10,950%	Nueva York	30/6/2026	7,513%	1,65	\$ 1,081	1	30/03, 30/06, 30/09 y 30/12	Bullet
USD	MGC9D	Pampa Energía	9,500%	Nueva York	8/12/2026	4,062%	1,21	\$ 1,089	1	08/06 y 08/12	33% el 08/12/2024; 33% el 08/12/2025; 34% al vencimiento
USD	MGCHD	Pampa Energía	4,990%	Argentina	4/11/2025	3,846%	1,13	\$ 1,030	1	04/05 y 04/11	Bullet
USD	PNDGD	Pan American Energy	9,125%	Nueva York	30/4/2027	4,696%	1,53	\$ 1,102	1.000	30/04 y 30/10	20% semestral de 30/04/2025 hasta el vencimiento

Obligaciones Negociables en Dólares (continuación)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
USD	TLC1D	Telecom Argentina	8,000%	Nueva York	18/7/2026	7,541%	1,76	\$ 1,020	1.000	18/01 y 18/07	Bullet
USD	TLC5D	Telecom Argentina	8,500%	Nueva York	6/8/2025	5,993%	0,90	\$ 0,350	1.000	06/02 y 06/08	30% el 06/08/2023; 33% el 06/08/2024; 34% al vencimiento
USD	VSCFD	Vista Energy	6,250%	Argentina	10/11/2025	3,668%	1,14	\$ 1,050	1	10/05 y 10/11	Bullet
USD	YCA6P	YPF	6,500%	Nueva York	28/7/2025	3,970%	0,89	\$ 1,029	1.000	28/01 y 28/07	Bullet
USD	YMCHD	YPF (Gtizada. c/ Expo.)	9,000%	Nueva York	12/2/2026	5,501%	0,79	\$ 0,477	1	12/02, 12/05, 12/08 y 12/11	7,6923% trimestral desde 12/02/2023
USD	YMCQD	YPF	5,000%	Argentina	13/2/2026	6,823%	1,40	\$ 0,988	1	13/06 y 13/12	Bullet
USD	YMCID	YPF	9,000%	Nueva York	30/6/2029	7,643%	2,89	\$ 1,059	1	30/06 y 30/12	14,29% semestral desde 30/06/2026
USD	YMCJD	YPF	7,000%	Nueva York	30/9/2033	8,210%	5,66	\$ 0,972	1	30/03 y 30/09	25% el 30/09/2030; 25% el 31/03/2031; 25% el 30/09/2032; 25% al vencimiento

Bonos en Pesos ajustados por CER (Inflación)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
Pesos	T4X4	Tesoro nacional	4,000%	Argentina	14/10/2024	1,937%	0,11	\$ 557,500	1	14/04 y 14/10	Bullet
Pesos	T5X4	Tesoro nacional	4,250%	Argentina	13/12/2024	3,154%	0,28	\$ 450,300	1	13/06 y 13/12	Bullet
Pesos	T2X5	Tesoro nacional	4,250%	Argentina	14/2/2025	4,049%	0,45	\$ 549,500	1	14/02 y 14/08	Bullet
Pesos	TC25P	Tesoro nacional	4,000%	Argentina	28/4/2025	5,298%	0,64	\$ 4.940,000	1	27/04 y 27/10	Bullet
Pesos	TZX25	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	5,079%	0,82	\$ 174,900	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX25	Tesoro nacional	1,800%	Argentina	10/11/2025	6,343%	1,17	\$ 920,000	1	09/05 y 09/11	Bullet
Pesos	TZXD5	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2025	7,279%	1,28	\$ 150,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX26	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2026	7,915%	1,82	\$ 193,250	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX26	Tesoro nacional	2,000%	Argentina	9/11/2026	7,552%	1,14	\$ 1.868,500	1	09/05 y 09/11	20% semestral desde 09/11/24
Pesos	TZXD6	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2026	8,276%	2,28	\$ 136,900	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX27	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2027	8,146%	2,82	\$ 178,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZXD7	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2027	8,920%	3,28	\$ 124,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX28	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2028	0,761%	3,82	\$ 159,450	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX28	Tesoro nacional	2,250%	Argentina	9/11/2028	8,267%	2,02	\$ 1.590,000	1	09/05 y 09/11	10% semestral desde 09/05/24
Pesos	TX31	Tesoro nacional	2,500%	Argentina	30/11/2031	-18,384%	22,57	\$ 690,000	1	30/05 y 30/11	10% semestral desde 30/05/27
Pesos	DICP	Tesoro nacional	5,830%	Argentina	2/1/2034	8,868%	3,88	\$ 33.400,000	1	30/06 y 31/12	5% semestral desde 30/06/24
Pesos	PARP	Tesoro nacional	1,77% hasta 30/09/29; 2,48% hasta vencimiento	Argentina	31/12/2038	10,518%	7,91	\$ 15.960,000	1	31/03 y 30/09	5% semestral desde 30/09/29

Letras y Bonos en Pesos vinculados al Dólar Mayorista (Com. A 3500 BCRA)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
Pesos	T2V4	Estado Nacional	0,500%	Argentina	30/9/2024	-0,402%	0,07	\$ 95.550,000	1	30/03 y 30/09	Bullet
Pesos	TV25	Estado Nacional	0,500%	Argentina	31/3/2025	-12,497%	0,57	\$ 103.350,000	1	31/03 y 30/09	Bullet
Pesos	TZV25	Estado Nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	-6,325%	0,82	\$ 100.540,000	1	Cupón cero	Bullet

Bonos duales CER + TNA vs Devaluación del Dólar Mayorista (Com. A 3500 BCRA)											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón de la parte CER (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortización
Pesos	TDG24	Tesoro Nacional	3,250%	Argentina	30/8/2024	#N/D	0,01	#N/D	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDN24	Tesoro Nacional	3,250%	Argentina	29/11/2024	-8,553%	0,24	\$ 112.000,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDE25	Tesoro Nacional	3,250%	Argentina	31/1/2025	-5,874%	0,41	\$ 112.400,000	1	Cupón Cero	Bullet

Letras y Bonos en Pesos a tasa fija											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
Pesos	S13S4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	13/9/2024	78,522%	0,03	\$ 111,645	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S30S4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	30/9/2024	61,510%	0,08	\$ 109,450	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S14O4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	14/10/2024	61,151%	0,11	\$ 125,600	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S11N4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	11/11/2024	55,159%	0,19	\$ 100,540	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S29N4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	29/11/2024	54,043%	0,24	\$ 122,300	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S13D4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	13/12/2024	53,792%	0,28	\$ 112,900	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S17E5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	17/1/2025	55,303%	0,38	\$ 111,740	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S31E5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/1/2025	57,353%	0,42	\$ 144,850	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S28F5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	28/2/2025	57,642%	0,49	\$ 127,900	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S31M5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/3/2025	56,645%	0,58	\$ 120,700	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S18J5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	18/6/2024	57,224%	0,80	\$ 103,370	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S30J5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	58,193%	0,83	\$ 100,550	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S29G5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	29/8/2025	57,757%	1,00	\$ 100,600	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	TO26	Estado Nacional	15,500%	Argentina	17/10/2026	46,001%	1,68	\$ 71,000	1	17/10 y 17/04	Bullet

Bonos Soberanos en Dólares											
Moneda	Especie	Emisor	Cupón (TNA)	Legislación	Vencimiento	TIR	Duration	Precio	Cant. Mín.	Intereses	Amortizaciones pendientes
USD	AL29D	Estado Nacional	1,00%	Argentina	9/7/2029	24,588%	2,14	\$ 61,210	1	09/01 y 09/07	10% semestral desde 01/2025
USD	AL30D	Estado Nacional	0,50% hasta 07/2023; 0,75% hasta 07/2027; 1,75% hasta vencimiento	Argentina	9/7/2030	24,203%	2,46	\$ 54,400	1	09/01 y 09/07	4% en 07/2024 y 8% semestral desde 01/2025
USD	AL35D	Estado Nacional	1,50% hasta 07/2023; 3,625% hasta 07/2024; 4,125% hasta 07/2027; 4,75% hasta 07/2028; 5,00% hasta el vencimiento	Argentina	9/7/2035	17,837%	6,20	\$ 45,495	1	09/01 y 09/07	10% semestral desde 01/2031
USD	AE38D	Estado Nacional	3,875% hasta 07/2023; 4,25% hasta 07/2024; 5,00% hasta el vencimiento	Argentina	9/1/2038	19,224%	5,13	\$ 48,290	1	09/01 y 09/07	4,545% semestral desde 07/2027
USD	AL41D	Estado Nacional	3,50% hasta 07/2029; 4,875% hasta el vencimiento	Argentina	9/7/2041	17,925%	6,18	\$ 41,280	1	09/01 y 09/07	3,571% semestral desde 01/2028
USD	GD29D	Estado Nacional	Ídem AL29D	Nueva York	9/7/2029	23,845%	2,15	\$ 62,000	1	09/01 y 09/07	Ídem AL29D
USD	GD30D	Estado Nacional	Ídem AL30D	Nueva York	9/7/2030	23,220%	2,48	\$ 55,480	1	09/01 y 09/07	Ídem AL30D
USD	GD35D	Estado Nacional	Ídem AL35D	Nueva York	9/7/2035	17,669%	6,21	\$ 45,900	1	09/01 y 09/07	Ídem AL35D
USD	GD38D	Estado Nacional	Ídem AE38D	Nueva York	9/1/2038	18,246%	5,21	\$ 50,390	1	09/01 y 09/07	Ídem AE38D
USD	GD41D	Estado Nacional	Ídem AL41D	Nueva York	9/7/2041	16,940%	6,30	\$ 43,499	1	09/01 y 09/07	Ídem AL41D
USD	GD46D	Estado Nacional	1,50% hasta 09/07/2023;	Nueva York	9/7/2046	17,099%	5,23	\$ 48,000	1	09/01 y 09/07	2,273% semestral desde 01/2025

(*) Las tablas y gráficos son de elaboración propia en base a la información de la base de datos de mercado al cierre del 02/09/2024. Este informe tiene el mero propósito de brindar información, por lo que no constituye ni una oferta ni una recomendación de compra o venta de los instrumentos financieros en él mencionado.

Fuentes: