

Informe Renta Fija a Nivel Local al 05/09/2024

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	7,020%	1,95	\$ 1,075	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	4,882%	1,47	\$ 1,085	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	2,260%	1,19	\$ 1,025	1	22/05 y 22/11	Bullet
USD	CP17D	Cía. Gral. de Combustibles	9,500%	Nueva York	8/3/2025	5,912%	0,35	\$ 0,496	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	4,464%	1,28	\$ 1,060	1	03/01 y 03/07	Bullet
USD	DNC2D	EDENOR	9,750%	Argentina	22/11/2024	8,126%	0,21	\$ 1,032	1	22/05 y 22/11	Bullet
USD	MRCLD	Generación Mediterránea	9,500%	Argentina	27/7/2025	7,303%	0,87	\$ 1,030	1	27/01 y 27/07	Bullet
USD	MRCAD	Generación Mediterránea	9,875%	Nueva York	1/12/2027	17,625%	1,56	\$ 0,684	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	5,384%	2,28	\$ 0,905	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	3,964%	0,54	\$ 1,030	1	31/01 y 31/07	Bullet
USD	IRCHD	IRSA	7,000%	Argentina	25/7/2025	5,549%	0,87	\$ 1,020	1	31/01 y 31/07	Bullet
USD	IRCID	IRSA	5,000%	Argentina	7/12/2025	5,169%	1,22	\$ 1,011	1	07/06 y 07/12	Bullet
USD	LOC2D	Loma Negra	5,000%	Argentina	7/12/2025	3,657%	1,22	\$ 1,029	1	07/06 y 07/12	Bullet
USD	LOC3D	Loma Negra	7,490%	Argentina	11/3/2026	5,307%	1,41	\$ 1,069	1	11/03 y 11/09	Bullet
USD	MTCGD	Mastellone Hnos.	10,950%	Nueva York	30/6/2026	6,478%	1,65	\$ 1,099	1	30/03, 30/06, 30/09 y 30/12	Bullet
USD	MGC9D	Pampa Energía	9,500%	Nueva York	8/12/2026	4,811%	1,20	\$ 1,080	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	3,163%	1,13	\$ 1,038	1	04/05 y 04/11	Bullet
USD	PNDGD	Pan American Energy	9,125%	Nueva York	30/4/2027	2,108%	1,54	\$ 1,145	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	7,487%	1,76	\$ 1,022	1.000	18/01 y 18/07	Bullet
USD	TLC5D	Telecom Argentina	8,500%	Nueva York	6/8/2025	5,243%	0,90	\$ 0,352	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	1,980%	1,13	\$ 1,070	1	10/05 y 10/11	Bullet
USD	YCA6P	YPF	6,500%	Nueva York	28/7/2025	4,123%	0,88	\$ 1,028	1.000	28/01 y 28/07	Bullet
USD	YMCHD	YPF (Gtizada. c/ Expo.)	9,000%	Nueva York	12/2/2026	5,054%	0,78	\$ 0,479	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	6,554%	1,39	\$ 0,992	1	13/06 y 13/12	Bullet
USD	YMCID	YPF	9,000%	Nueva York	30/6/2029	7,264%	2,89	\$ 1,070	1	30/06 y 30/12	14,29% semestral desde 30/06/2026
USD	YMCJD	YPF	7,000%	Nueva York	30/9/2033	8,037%	5,67	\$ 0,982	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	-1,986%	0,10	\$ 562,000	1	14/04 y 14/10	Bullet
Pesos	T5X4	Tesoro nacional	4,250%	Argentina	13/12/2024	0,914%	0,27	\$ 454,800	1	13/06 y 13/12	Bullet
Pesos	T2X5	Tesoro nacional	4,250%	Argentina	14/2/2025	4,594%	0,44	\$ 550,500	1	14/02 y 14/08	Bullet
Pesos	TC25P	Tesoro nacional	4,000%	Argentina	28/4/2025	5,496%	0,63	\$ 4.955,000	1	27/04 y 27/10	Bullet
Pesos	TZX25	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	5,549%	0,81	\$ 175,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX25	Tesoro nacional	1,800%	Argentina	10/11/2025	6,339%	1,16	\$ 924,000	1	09/05 y 09/11	Bullet
Pesos	TZXD5	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2025	7,987%	1,27	\$ 149,400	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX26	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2026	8,488%	1,81	\$ 192,250	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX26	Tesoro nacional	2,000%	Argentina	9/11/2026	8,253%	1,13	\$ 1.863,000	1	09/05 y 09/11	20% semestral desde 09/11/24
Pesos	TZXD6	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2026	8,980%	2,27	\$ 135,500	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX27	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2027	8,973%	2,81	\$ 175,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZXD7	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	15/12/2027	9,204%	3,27	\$ 123,500	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TZX28	Tesoro nacional	0,000%	Argentina	30/6/2028	1,029%	3,82	\$ 158,450	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TX28	Tesoro nacional	2,250%	Argentina	9/11/2028	9,388%	1,99	\$ 1.564,500	1	09/05 y 09/11	10% semestral desde 09/05/24
Pesos	TX31	Tesoro nacional	2,500%	Argentina	30/11/2031	-18,711%	22,78	\$ 700,000	1	30/05 y 30/11	10% semestral desde 30/05/27
Pesos	DICP	Tesoro nacional	5,830%	Argentina	2/1/2034	9,545%	3,83	\$ 32.760,000	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	10,522%	7,90	\$ 16.030,000	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	10,191%	0,07	\$ 95.080,000	1	30/03 y 30/09	Bullet
Pesos	TV25	Estado Nacional	0,500%	Argentina	31/3/2025	-5,783%	0,56	\$ 99.200,000	1	31/03 y 30/09	Bullet
Pesos	TZV25	Estado Nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	-6,483%	0,81	\$ 100.800,000	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	0,02	#N/D	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDN24	Tesoro Nacional	3,250%	Argentina	29/11/2024	-10,830%	0,23	\$ 113.000,000	1	Cupón Cero	Bullet
Pesos	TDE25	Tesoro Nacional	3,250%	Argentina	31/1/2025	-6,155%	0,40	\$ 112.910,000	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	74,918%	0,02	\$ 112,230	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S30S4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	30/9/2024	56,697%	0,07	\$ 110,110	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S14O4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	14/10/2024	58,277%	0,11	\$ 126,330	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S11N4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	11/11/2024	53,151%	0,18	\$ 101,150	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S29N4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	29/11/2024	54,805%	0,23	\$ 122,600	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S13D4	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	13/12/2024	52,580%	0,27	\$ 113,550	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S17E5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	17/1/2025	53,632%	0,37	\$ 112,600	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S31E5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/1/2025	57,059%	0,41	\$ 145,500	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S28F5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	28/2/2025	57,871%	0,49	\$ 128,290	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S31M5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	31/3/2025	57,216%	0,57	\$ 120,900	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S18J5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	18/6/2024	57,436%	0,79	\$ 103,650	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S30J5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	30/6/2025	57,861%	0,83	\$ 101,110	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	S29G5	Tesoro Nacional	0,000%	Argentina	29/8/2025	57,510%	0,99	\$ 101,140	1	Cupón cero	Bullet
Pesos	TO26	Estado Nacional	15,500%	Argentina	17/10/2026	44,108%	1,68	\$ 72,800	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	24,012%	2,14	\$ 61,930	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	23,477%	2,47	\$ 55,290	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	17,778%	6,20	\$ 45,699	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	19,253%	5,11	\$ 48,300	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	18,012%	6,16	\$ 41,149	1	09/01 y 09/07	3,571% semestral desde 01/2028
USD	GD29D	Estado Nacional	Ídem AL29D	Nueva York	9/7/2029	23,299%	2,15	\$ 62,700	1	09/01 y 09/07	Ídem AL29D
USD	GD30D	Estado Nacional	Ídem AL30D	Nueva York	9/7/2030	22,500%	2,49	\$ 56,390	1	09/01 y 09/07	Ídem AL30D
USD	GD35D	Estado Nacional	Ídem AL35D	Nueva York	9/7/2035	17,807%	6,20	\$ 45,630	1	09/01 y 09/07	Ídem AL35D
USD	GD38D	Estado Nacional	Ídem AE38D	Nueva York	9/1/2038	18,386%	5,19	\$ 50,150	1	09/01 y 09/07	Ídem AE38D
USD	GD41D	Estado Nacional	Ídem AL41D	Nueva York	9/7/2041	17,179%	6,26	\$ 43,000	1	09/01 y 09/07	Ídem AL41D
USD	GD46D	Estado Nacional	1,50% hasta 09/07/2023;	Nueva York	9/7/2046	16,897%	5,26	\$ 48,500	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 05/09/2024. 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: