

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 350,02 CCL⁽¹⁾: \$ 744,26 MEP⁽²⁾: \$ 704,48 Brecha: 112,64% Devaluación⁽³⁾: 135,87% Inflación⁽⁴⁾: 6,30% Tasa Leliq: 118% Tasa Badlar: 113,00% Tasa Caución: 98,00%

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X18S3	\$ 193,55	CER	34,5%	116,5%	0,05	31	-0,18%	0,97%
X18O3	\$ 125,20	CER	0,6%	89,8%	0,15	61	0,48%	2,88%
X23N3	\$ 124,00	CER	-5,5%	86,2%	0,26	97	0,71%	3,81%
S31O3	\$ 82,77	Fija	172%	110,1%	0,19	74	-0,01%	1,31%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDS23	\$ 327,50	Duales (CER)	-57,2%	-15,6%	0,25	43	-2,24%	2,34%
TDF24	\$ 371,90	Duales (CER)	-34,9%	44,4%	0,76	194	3,59%	4,14%
TDA24	\$ 357,00	Duales (CER)	-24,3%	73,1%	0,75	256	1,10%	-0,35%
TDG24	\$ 355,20	Duales (CER)	-15,6%	83,5%	1,06	378	-0,08%	-0,78%
TDE25	\$ 320,50	Duales (CER)	-3,9%	140,3%	1,44	532	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
D31O3	\$ 350,00	Dólar linked	0,0%	36,7%	0,19	74	0,00%	4,17%
TV24	\$ 352,00	Dólar linked	-0,3%	142,1%	0,69	256	1,00%	0,66%
T2V4	\$ 354,00	Dólar linked	-0,4%	177,4%	1,11	409	0,57%	2,28%
TDS23	\$ 327,50	Duales (DL)	89,2%	104,5%	0,10	43	-2,24%	2,34%
TDF24	\$ 371,90	Duales (DL)	-11,1%	108,6%	0,52	194	3,59%	4,14%
TDA24	\$ 357,00	Duales (DL)	-2,8%	134,4%	0,69	256	1,10%	-0,35%
TDG24	\$ 355,20	Duales (DL)	-1,4%	167,4%	1,02	378	-0,08%	-0,78%
TDE25	\$ 320,50	Duales (DL)	6,3%	245,2%	1,44	532	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 591,00	CER	0,2%	0,58	0,17%	4,60%
T3X4	\$ 148,60	CER	1,7%	0,63	-0,44%	2,84%
T2X4	\$ 434,50	CER	3,0%	0,91	-0,23%	3,95%
T4X4	\$ 143,85	CER	6,0%	1,09	0,88%	5,00%
T5X4	\$ 116,50	CER	5,9%	1,26	0,00%	6,88%
T2X5	\$ 138,40	CER	7,7%	1,40	0,58%	4,85%
TX25	\$ 235,00	CER	6,7%	2,13	2,62%	6,82%
TX26	\$ 485,00	CER	5,8%	2,05	2,97%	4,35%
TX28	\$ 470,80	CER	6,3%	2,63	3,00%	7,22%
DICP	\$ 9.440,00	CER	8,6%	4,22	0,21%	1,62%
PARP	\$ 5.077,50	CER	7,4%	8,50	0,94%	-2,34%
TO23	\$ 92,70	Fija	175,6%	0,06	-0,03%	-0,13%
TO26	\$ 23,90	Fija	144,6%	0,68	-3,24%	-16,87%
BDC24	\$ 114,40	Badlar	189,0%	0,44	0,35%	2,46%
PBA25	\$ 95,75	Badlar	241,1%	0,75	0,47%	-1,73%
BDC28	\$ 100,95	Badlar	176,1%	1,10	4,02%	-13,79%

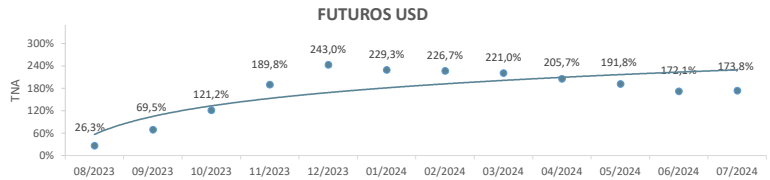
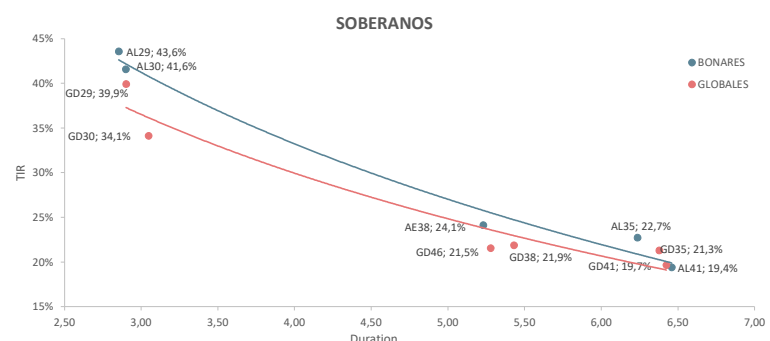
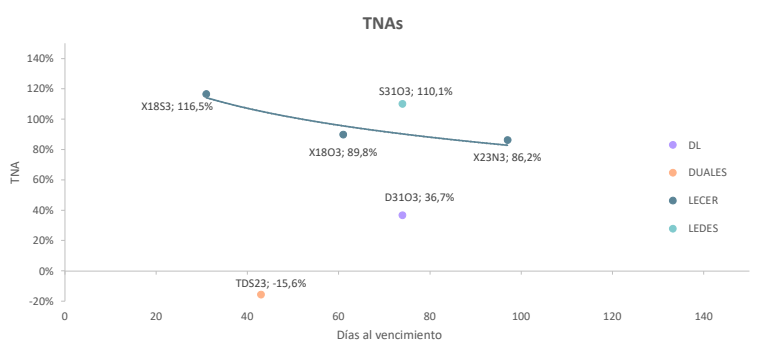
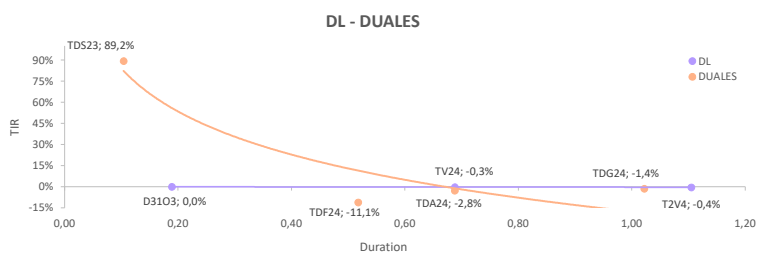
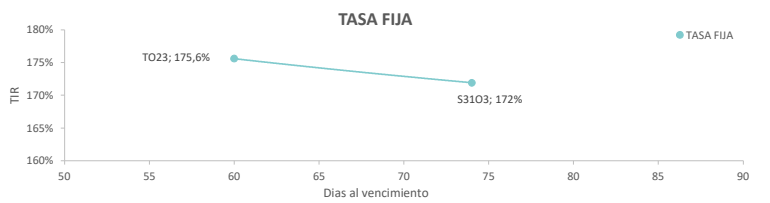
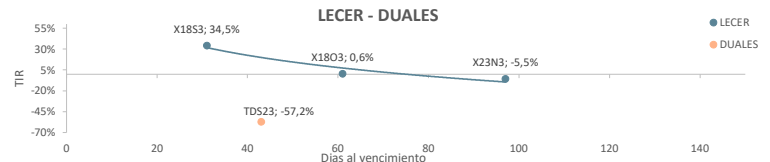
BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	MTD
AL29	\$ 32,49	32%	43,6%	2,85	1,00%	3,08%	4,13%	0,59%
GD29	\$ 35,00	35%	39,9%	2,90	1,00%	2,86%	2,64%	-3,66%
AL30	\$ 31,68	32%	41,6%	2,90	0,75%	2,37%	4,35%	3,19%
GD30	\$ 37,21	37%	34,1%	3,05	0,75%	2,02%	2,68%	-0,91%
AL35	\$ 32,04	31%	22,7%	6,24	4,13%	12,87%	1,71%	0,12%
GD35	\$ 34,49	34%	21,3%	6,38	4,13%	11,96%	4,67%	1,44%
AE38	\$ 35,40	34%	24,1%	5,23	4,25%	12,01%	2,02%	2,91%
GD38	\$ 39,00	39%	21,9%	5,43	4,25%	10,90%	3,72%	-2,50%
AL41	\$ 35,00	34%	19,4%	6,46	3,50%	10,00%	14,75%	12,90%
GD41	\$ 34,52	35%	19,7%	6,42	3,50%	10,14%	4,60%	-1,37%
GD46	\$ 34,50	34%	21,5%	5,28	3,00%	8,70%	1,47%	0,79%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
13	31/08/2023	\$ 353,30	0,9%	30,0%	26,3%	2,21%
42	29/09/2023	\$ 378,00	8,0%	95,1%	69,5%	5,73%
74	31/10/2023	\$ 436,00	24,6%	195,5%	121,2%	9,45%
104	30/11/2023	\$ 539,30	54,1%	355,9%	189,8%	13,48%
133	29/12/2023	\$ 660,00	88,6%	470,1%	243,0%	15,61%
166	31/01/2024	\$ 715,00	104,3%	381,0%	229,3%	13,98%
195	29/02/2024	\$ 774,00	121,1%	341,7%	226,7%	13,18%
222	27/03/2024	\$ 820,50	134,4%	305,8%	221,0%	12,38%
256	30/04/2024	\$ 855,00	144,3%	257,3%	205,7%	11,20%
287	31/05/2024	\$ 878,00	150,8%	222,1%	191,8%	10,24%
315	28/06/2024	\$ 870,00	148,6%	187,2%	172,1%	9,19%
348	31/07/2024	\$ 930,00	165,7%	178,7%	173,8%	8,92%

* Supuestos de inflación: 12% agosto, 13% septiembre, 10% octubre y 8% de noviembre en adelante (mensuales).
 Supuestos de Devaluación: 3% hasta octubre 2023 (DL y Duales) y 8,5% para instrumentos con vencimiento en 2024.



GRUPO IEB

Av. del Libertador 498. Piso 10 - Torre IEB (1001) C.A.B.A.
 Tel: (+54 11) 5353-5500 <https://www.grupoieb.com.ar/>