

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 349,98 CCL⁽¹⁾: \$ 727,45 MEP⁽²⁾: \$ 695,93 Brecha: 107,85% Devaluación⁽³⁾: -0,05% Inflación⁽⁴⁾: 6,30% Tasa Leliq: 118% Tasa Badlar: 114,25% Tasa Caución: 99,00%

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X18S3	\$ 205,40	CER	37,9%	104,8%	0,01	7	0,64%	0,64%
X18O3	\$ 128,05	CER	24,6%	138,1%	0,09	37	0,47%	0,47%
X23N3	\$ 127,20	CER	1,6%	143,7%	0,19	73	0,55%	0,55%
X18E4	\$ 105,90	CER	0,1%	145,4%	0,35	129	0,14%	0,14%
S31O3	\$ 85,90	Fija	218%	124,8%	0,13	50	1,42%	1,42%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDS23	\$ 336,15	Duales (CER)	-78,5%	-105,5%	0,25	19	0,24%	0,24%
TDF24	\$ 377,50	Duales (CER)	-34,4%	76,3%	0,69	170	-0,81%	-0,81%
TDA24	\$ 374,50	Duales (CER)	-26,8%	94,9%	0,71	232	-1,45%	-1,45%
TDG24	\$ 372,89	Duales (CER)	-16,9%	100,6%	1,01	354	-0,81%	-0,81%
TDE25	\$ 350,00	Duales (CER)	-7,1%	150,8%	1,39	508	0,00%	9,20%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
D31O3	\$ 350,00	Dólar linked	0,0%	36,3%	0,13	50	-0,43%	-0,43%
TV24	\$ 372,00	Dólar linked	-8,7%	119,6%	0,68	232	-1,06%	-1,06%
T2V4	\$ 374,40	Dólar linked	-5,6%	155,1%	1,07	385	-0,16%	-0,16%
TDS23	\$ 336,15	Duales (DL)	137,9%	125,7%	0,05	19	0,24%	0,24%
TDF24	\$ 377,50	Duales (DL)	-15,2%	98,8%	0,46	170	-0,81%	-0,81%
TDA24	\$ 374,50	Duales (DL)	-10,2%	116,5%	0,63	232	-1,45%	-1,45%
TDG24	\$ 372,89	Duales (DL)	-6,4%	147,6%	0,96	354	-0,81%	-0,81%
TDE25	\$ 350,00	Duales (DL)	0,0%	209,1%	1,39	508	0,00%	9,20%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
TX24	\$ 611,90	CER	1,8%	0,52	-0,58%	-0,58%
T3X4	\$ 155,00	CER	2,0%	0,57	-0,64%	-0,64%
T2X4	\$ 450,00	CER	4,1%	0,84	-0,88%	-0,88%
T4X4	\$ 154,20	CER	3,7%	1,04	-0,13%	-0,13%
TSX4	\$ 124,00	CER	4,5%	1,21	-0,80%	-0,80%
T2X5	\$ 151,40	CER	4,4%	1,36	-0,07%	-0,07%
TX25	\$ 285,80	CER	-0,6%	2,13	-8,98%	-8,98%
TX26	\$ 510,40	CER	5,6%	1,99	-0,51%	-0,51%
TX28	\$ 485,00	CER	7,0%	2,54	1,82%	1,82%
DICP	\$ 10.680,00	CER	6,8%	4,33	-0,42%	-0,42%
PARP	\$ 5.164,00	CER	7,7%	8,34	-1,53%	-1,53%
TO23	\$ 97,65	Fija	194,9%	0,03	-0,36%	-0,36%
TO26	\$ 23,50	Fija	157,3%	0,56	-0,42%	-0,42%
BDC24	\$ 121,25	Badlar	195,6%	0,38	-0,21%	-0,21%
PBA25	\$ 108,30	Badlar	220,5%	0,71	-0,46%	-0,46%
BDC28	\$ 103,00	Badlar	189,5%	1,01	-0,87%	-0,87%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	MTD
AL29	\$ 31,29	31%	46,7%	2,75	1,00%	3,20%	-0,70%	-7,97%
GD29	\$ 34,25	34%	42,0%	2,81	1,00%	2,92%	-1,27%	-7,43%
AL30	\$ 30,75	31%	44,1%	2,79	0,75%	2,44%	-0,71%	-8,67%
GD30	\$ 36,06	36%	36,4%	2,94	0,75%	2,08%	-0,85%	-8,06%
AL35	\$ 30,75	30%	23,8%	6,07	4,13%	13,41%	-3,00%	-8,21%
GD35	\$ 31,84	32%	23,1%	6,14	4,13%	12,96%	1,82%	-6,76%
AE38	\$ 33,99	33%	25,4%	5,06	4,25%	12,50%	0,71%	-7,13%
GD38	\$ 37,75	38%	22,9%	5,28	4,25%	11,26%	0,40%	-5,15%
AL41	\$ 30,89	30%	22,0%	6,05	3,50%	11,33%	0,95%	-8,04%
GD41	\$ 32,02	32%	21,3%	6,14	3,50%	10,93%	-3,55%	-12,27%
GD46	\$ 31,65	31%	23,9%	4,90	3,00%	9,48%	-4,38%	-8,26%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
18	29/9/2023	\$ 357,50	2,1%	53,9%	43,6%	3,66%
50	31/10/2023	\$ 406,00	16,0%	195,6%	116,8%	9,45%
80	30/11/2023	\$ 493,00	40,9%	377,4%	186,4%	13,91%
109	29/12/2023	\$ 628,00	79,4%	608,4%	266,0%	17,72%
142	31/1/2024	\$ 717,00	104,9%	531,9%	269,6%	16,61%
171	29/2/2024	\$ 773,00	120,9%	442,7%	258,0%	15,14%
198	27/3/2024	\$ 825,00	135,7%	385,9%	250,2%	14,08%
232	30/4/2024	\$ 890,00	154,3%	334,2%	242,8%	13,02%
263	31/5/2024	\$ 938,00	168,0%	292,8%	233,2%	12,08%
291	28/6/2024	\$ 958,00	173,7%	253,6%	217,9%	11,10%
324	31/7/2024	\$ 990,00	182,9%	222,7%	206,0%	10,25%

* 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.

