PRINCIPALES VARIABLES Inflación⁽⁴⁾: TC Oficial: \$ 849,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.051,84 MEP⁽²⁾: \$ 1.010,06 Brecha: 23,78% Devaluación⁽³⁾: 2.07% 13.20% Tasa Pase: 100% Tasa Badlar: 74.38% Tasa Caución: 70,00% Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con AL30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de febrero. LECER DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL • LECER X20Y4: -64.2% E -50% Precio TNA Duration Días al WTD -100% X20Y4 173,75 CER -64,2% 108,6% 0,18 3,12% 68 -2,22% 20 60 80 100 120 Dias al vencimiento Precio WTD TNA TASA FIIA TASA FIJA TDA24 815.30 Duales (CER) -76.4% 44.9% 0.13 48 0.84% 2.68% 90% TD124 944 00 Duales (CFR) -46 7% 129 3% 0.29 109 0.59% 5 12% 끮 TDG24 934.50 Duales (CFR) -48.5% 97.2% 0.46 170 1.25% 4.30% 40% TO26: 63.8% TDE25 950,50 Duales (CER) -29,6% 121,0% 0,88 324 2,20% 6,20% TIR Duration Días al Diaria WTD 1,80 Γickeι Precio Tipo TNA Duration TV24 817,00 Dólar linked 121.8% 48 1,00% 3,23% 37,49% 0,00 DL - DUALES T2V4 892.90 Dólar linked -8.06% 88.9% 0.00 201 -0.01% 3.95% TV25 829,00 Dólar linked 3,05% 133,9% 0,00 383 -0,72% -2,47% TV24; 37,49% •TDA24; 37,6% 40% DUALES TDA24 815,30 37,6% 121,9% 48 0,84% 2,68% Duales (DL) 0,13 30% TDJ24 944.00 Duales (DL) -30.4% 54.5% 0.29 109 0.59% 5.12% 20% TDG24 934 50 Duales (DL) -18 9% 69.7% 0.46 170 1 25% 4 30% 10% TV25; 3,05% TDE25 950,50 Duales (DL) -12.0% 93,8% 0.88 324 2,20% 6,20% 0% T2V4; -8,06% -10% TDE25; -12,0% icker Duration Diaria WTD Precio Tipo -20% TDG24; -18,9% -30% TDJ24: -30.4% TX24 1.418,50 CER -81.5% 0,03 0,18% 1,50% -40% T3X4 367,00 CER -60,6% 0,00% 2,23% 0,08 0.00 0.10 0.20 0.40 0.50 0.80 T6X4 283.25 CFR -61.5% 0,18 0.80% 3.49% T2X4 1 282 00 CFR -46 5% 0.36 -0 43% 7 42% TNAs • LECER T4X4 432.50 CER -31.8% 0.58 0.82% 9.91% ■ DUALES (CER) T5X4 348.10 CFR -24.4% 0.74 2.38% 11.39% 140% DUALES (DL) ●TDJ24; 129,3% 419,50 CER -18,6% 0,12% T2X5 1,12 8,19% TZX25 104,40 CER 3,66% 6,68% -1,6% 2,75 TDA24; 121,9% TX25 714,90 CER -9,5% 1,40% 4,78% TDF25: 121.0% 1,63 X20Y4; 108,6% • TX26 1,95% 9,29% 1.435,00 1,67 100% TDG24: 97.2% TDE25: 93.8% TZX26 151,25 CER -4,8% 2.89% 5.47% 2,29 T7X27 166.00 CFR -6.0% 3,29 5.06% 7.79% TX28 1.470.00 CFR -5,6% 2,48 3.52% 8.41% DICP 28.300.00 CFR 2.4% 4.47 2.91% 2.17% 60% ■ TDJ24; 54,5% PARP 16.000 CER 3.9% 9.04 0.00% 4.03% TO26 54,00 63,8% 1,82 3,89% 19,34% 40% Fija BDC24 1,64% 124,30 Badlar 113,5% 0,04 -0,16% 117,80 Badlar 172.4% 0,63 0,60% 0,68% 20% 109,15 Badlar 162,5% 1,08 -3,32% -2,98% 100 150 200 BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD) Días al vencimiento Duration Precio TIR Paridad Cupón Diaria WTD **SOBERANOS** AL29 49.85 30.1% 49.3% 2.50 1.00% 2.07% 2.01% 2.47% BONARES 60% GD29 51,00 28,9% 50,4% 2,52 1,00% 1,96% 2,00% -0,29% GLOBALES AL30 48,79 28,3% 48,4% 2,64 0,75% 1,54% 2,37% 4,37% GD29; 50,4% GD30; 51,0% AL29; 49,3% BPJ5D GD30 26,2% 0,75% 1,47% 1,51% 4,27% 50,99 51,0% 2,68 Strips Serie 1 AL35 40.59 19.3% 38.7% 6.30 3,63% 8.93% 2.19% 2.12% GD38; 44,0% AL30; 48,4% GD35 41.99 18.6% 42.0% 6.35 3.63% 8.63% 1.18% 5 11% GD46: 41,5% GD35; 42,0% AE38 \$ 42.52 21.2% 40.5% 5,19 4.25% 10.00% 1.24% 2.61% AE38; 40,5% 40% AL35; 38,7% % GD41; 38,6% GD38 Ś 44.01 20.4% 44.0% 5.26 4.25% 9.66% -0.43% 0.30% AL41; 36,8% AL41 Ś 38.29 18.7% 36.8% 6.28 3.50% 9.14% 1.43% 2.38% GD41 38,60 18,5% 38,6% 6,30 3,50% 9,07% 0,47% 1,42% ≝ 30% GD46 43,00 18,0% 41,5% 5,46 3,00% 6,98% 0,00% 0,00% 92.50 9.9% 92.5% 0,37 0.00% 0,00% BPB7D; 20,9%
BPD7D; 19,8% 5,00% BPA7D 88,00 5,68% -0,56% 0,00% 18,9% 88,0% 1,11 76,00 20,9% 76,0% 2,02 5,00% 6,58% 0,00% 1,33% BPC7D: 19.4% BPB7D BPC7D 69,75 19,4% 69,8% 2,86 5,00% 7,17% 0,79% 10,71% BPD7D 68,00 19,8% 68.0% 3,06 5.00% 7,35% -1,45% 23,64% 10% BPI5D: 9.9% FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX 1,00 3,00 4.00 5.00 6.00 TEA Crawling Mensual Vto Precio Duration Directa 18 31/3/2024 \$ 865,00 43,4% 36,4% 3,05% **FUTUROS USD** 4,51% 48 30/4/2024 \$ 911.00 7.2% 69.8% 54.8% 82.9% 75 27/5/2024 \$ 969.00 14.0% 89 5% 68 3% 5 47% 83,5% 90% 80.8% 78,3% 109 30/6/2024 \$ 1.030,00 21.2% 90.4% 71.0% 5.51% 68.3% 80% 54.8% 140 31/7/2024 \$ 1.105.00 30.0% 98.3% 78.3% 5.87% 70% 169 29/8/2024 \$ 1.163.00 36.9% 79.6% 5.81% 96.9% TNA 50% 201 30/9/2024 \$ 1.220,00 43,6% 92,9% 79,1% 5,63% 231 30/10/2024 \$ 1.284,50 51,2% 92,1% 80,8% 5,59% 30% 30/11/2024 \$ 5,60% 1.359.00 59.9% 83.5% 20% 293 31/12/2024 \$ 1.415,00 66,5% 88.7% 82.9% 5,44% 323 30/1/2025 1.500,00 76,5% 90,1% 86,5% 5,50% 05/2024 04/2024 06/2024 07/2024 11/2024 12/2024 01/2025 03/2024 08/2024 09/2024 10/2024 Supuestos de inflación: Según estimaciones del REM de febrero elavorado por el BCRA Supuestos de Devaluación: 10% mensual 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/