

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 950,67 CCL⁽¹⁾ \$ 1.289,38 MEP⁽²⁾ \$ 1.269,62 Brecha: 35,63% Devaluación⁽³⁾: 2,04% Inflación⁽⁴⁾: 4,00% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 38,81% Tasa Caución: 36,50%

(1) Promedio a través de ADRs. (2) Calculado con GD30. (3) Tasa promedio últimos 5 días (mensual). (4) Inflación mensual de Julio.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.119,00	Duales (CER)	4,3%	36,3%	0,42	155	-0,53%	1,08%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 950,50	Dólar linked	2,03%	26,13%	0,08	32	-0,05%	0,32%
TV25	\$ 1.000,40	Dólar linked	-7,75%	15,99%	0,63	214	-1,38%	-2,40%
TZV25	\$ 1.007,50	Dólar linked	-6,10%	0,00%	0,93	305	-0,26%	-2,27%
TZV05	\$ 1.040,00	Dólar linked	-6,78%	0,00%	1,31	473	0,00%	-0,95%
TZV26	\$ 882,70	Dólar linked	-4,08%	0,00%	1,70	670	0,00%	0,31%
TDE25	\$ 1.119,00	Duales (DL)	-32,21%	-14,63%	0,42	155	-0,53%	1,08%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 555,10	CER	1,15%	0,12	0,09%	0,20%
TSX4	\$ 450,50	CER	2,00%	0,29	-0,33%	0,90%
TZX5	\$ 549,00	CER	3,02%	0,44	-0,38%	2,23%
TZXM5	\$ 121,00	CER	2,15%	0,58	0,00%	2,54%
TZX25	\$ 175,00	CER	4,30%	0,83	-0,11%	1,80%
TX25	\$ 916,00	CER	6,23%	1,18	-0,22%	0,22%
TX26	\$ 1.869,50	CER	7,03%	1,15	-0,48%	1,33%
TZXD5	\$ 150,00	CER	6,80%	1,29	-0,40%	1,66%
TZXM6	\$ 117,25	CER	7,43%	1,58	-0,42%	1,08%
TZX26	\$ 193,30	CER	7,55%	1,83	-0,10%	1,74%
TZXD6	\$ 137,00	CER	7,96%	2,29	-0,54%	2,54%
TZXM7	\$ 99,10	CER	8,55%	2,58	-0,90%	-0,80%
TZX27	\$ 181,00	CER	7,29%	2,83	-0,66%	4,26%
TZXD7	\$ 124,40	CER	8,62%	3,29	-0,08%	3,32%
TZX28	\$ 158,90	CER	8,97%	3,84	-0,22%	2,19%
TX28	\$ 1.597,00	CER	7,76%	2,03	-0,37%	5,50%
DICP	\$ 33.485,00	CER	9,86%	3,80	1,00%	5,98%
PARP	\$ 15.925,00	CER	10,40%	7,94	0,16%	2,15%
S1354	\$ 111,20	Fija	57,07%	0,04	0,14%	0,45%
S3054	\$ 108,97	Fija	55,65%	0,08	0,02%	0,42%
S1404	\$ 125,15	Fija	53,15%	0,12	-0,08%	0,51%
S29N4	\$ 121,25	Fija	53,62%	0,25	-0,16%	0,14%
S13D4	\$ 112,60	Fija	51,25%	0,29	-0,18%	0,45%
S17E5	\$ 112,15	Fija	50,49%	0,38	0,04%	1,04%
S31E5	\$ 145,36	Fija	50,36%	0,42	0,07%	0,94%
S28F5	\$ 127,95	Fija	53,22%	FALSO	-1,04%	0,34%
S31M5	\$ 120,90	Fija	54,06%	0,58	-0,45%	0,94%
S18I5	\$ 103,40	Fija	56,16%	0,80	-0,29%	1,27%
TO26	\$ 71,39	Fija	45,29%	1,70	0,41%	-2,19%
PBA25	\$ 103,40	Badlar	55,55%	0,55	0,78%	1,47%
BDC28	\$ 99,80	Badlar	50,63%	1,94	-0,10%	-2,35%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 59,90	25,7%	58,9%	2,13	1,00%	1,67%	2,24%	5,40%
GD29	\$ 60,50	25,1%	59,5%	2,14	1,00%	1,65%	1,00%	4,11%
AL30	\$ 53,81	24,8%	53,2%	2,46	0,75%	1,39%	2,83%	7,13%
GD30	\$ 55,40	23,3%	55,4%	2,49	0,75%	1,35%	2,86%	5,87%
AL35	\$ 45,29	17,9%	42,4%	6,21	3,63%	8,00%	2,00%	5,69%
GD35	\$ 45,60	17,8%	45,6%	6,22	3,63%	7,95%	1,11%	3,75%
AE38	\$ 47,06	19,8%	47,1%	5,09	4,25%	9,03%	1,14%	4,00%
GD38	\$ 50,10	18,3%	50,1%	5,21	4,25%	8,48%	1,62%	2,81%
AL41	\$ 41,10	18,0%	38,9%	6,18	3,50%	8,52%	1,51%	3,79%
GD41	\$ 43,30	17,0%	43,3%	6,30	3,50%	8,08%	2,36%	3,94%
GD46	\$ 47,46	16,8%	47,5%	5,39	3,00%	6,32%	0,55%	4,31%
BPJ5D	\$ 92,99	-3,4%	93,0%	0,42	0,00%	0,00%	1,35%	3,33%
BPA7D	\$ 93,40	22,7%	93,4%	0,64	5,00%	5,35%	-0,05%	2,30%
BPB7D	\$ 84,00	19,9%	84,0%	1,56	5,00%	5,95%	1,51%	6,33%
BPC7D	\$ 76,40	18,9%	76,4%	2,40	5,00%	6,54%	0,86%	3,66%
BPD7D	\$ 75,00	19,1%	75,0%	2,60	5,00%	6,67%	1,01%	4,31%
BPY6D	\$ 82,09	19,3%	82,1%	0,91	3,00%	3,65%	1,60%	3,52%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
1	30/08/2024	\$ 952,50	0,2%	102,0%	70,4%	6,04%
32	30/09/2024	\$ 984,00	3,5%	48,2%	40,0%	3,33%
63	31/10/2024	\$ 1.016,50	6,9%	47,4%	40,1%	3,29%
92	29/11/2024	\$ 1.050,00	10,4%	48,3%	41,5%	3,34%
123	30/12/2024	\$ 1.086,00	14,2%	48,4%	42,2%	3,35%
155	31/01/2025	\$ 1.129,50	18,8%	50,1%	44,3%	3,44%
183	28/02/2025	\$ 1.171,00	23,2%	51,6%	46,2%	3,53%
214	31/03/2025	\$ 1.211,50	27,4%	51,2%	46,8%	3,51%
244	30/04/2025	\$ 1.252,00	31,7%	51,0%	47,4%	3,49%
274	30/05/2025	\$ 1.286,00	35,3%	49,6%	47,0%	3,41%
305	30/06/2025	\$ 1.325,00	39,4%	48,8%	47,1%	3,37%
336	31/07/2025	\$ 1.365,00	43,6%	48,1%	47,3%	3,33%

* Supuestos de Inflación propios: 3% a partir de Agosto.

Supuestos de Devaluación: 2% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

