

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 966,33 CCL⁽¹⁾: \$ 1.233,62 MEP⁽²⁾: \$ 1.207,44 Brecha: 27,66% Devaluación⁽³⁾: 1,93% Inflación⁽⁴⁾: 4,20% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 41,69% Tasa Caución: 38,50%

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

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.170,80	Duales (CER)	1,2%	28,9%	0,35	130	-0,10%	-0,10%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TZV4	\$ 962,70	Dólar linked	24,38%	45,88%	0,01	7	0,48%	0,48%
TZV5	\$ 973,00	Dólar linked	-0,88%	23,74%	0,52	189	-1,39%	-1,39%
TZV25	\$ 979,80	Dólar linked	-1,28%	0,00%	0,78	280	0,29%	0,29%
TZVD5	\$ 963,00	Dólar linked	0,06%	0,00%	1,22	448	0,00%	0,00%
TZV26	\$ 910,00	Dólar linked	3,31%	0,00%	1,66	645	0,00%	0,00%
TDE25	\$ 1.170,80	Duales (DL)	-42,34%	-29,63%	0,35	130	-0,10%	-0,10%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 572,90	CER	2,73%	0,05	0,09%	0,09%
T5X4	\$ 466,40	CER	1,21%	0,22	0,23%	0,23%
T2X5	\$ 566,70	CER	3,53%	0,37	0,12%	0,12%
TZXM5	\$ 124,35	CER	3,30%	0,52	0,44%	0,44%
TZX25	\$ 177,40	CER	7,19%	0,76	0,23%	0,23%
TX25	\$ 941,00	CER	7,08%	1,11	0,68%	0,68%
TX26	\$ 1.891,50	CER	9,51%	1,07	0,19%	0,19%
TZXD5	\$ 151,90	CER	8,87%	1,22	0,60%	0,60%
TZXM6	\$ 118,20	CER	9,47%	1,52	-0,67%	-0,67%
TZX26	\$ 192,70	CER	10,00%	1,76	-0,41%	-0,41%
TZXD6	\$ 135,50	CER	10,31%	2,22	-0,73%	-0,73%
TZXM7	\$ 103,00	CER	8,50%	2,52	-0,48%	-0,48%
TZX27	\$ 170,25	CER	11,14%	2,76	0,44%	0,44%
TZXD7	\$ 121,50	CER	10,69%	3,22	-0,61%	-0,61%
TZX28	\$ 156,00	CER	10,60%	3,77	-1,23%	-1,23%
TX28	\$ 1.568,00	CER	10,86%	1,92	0,19%	0,19%
DICP	\$ 32.010,00	CER	12,36%	3,58	-1,36%	-1,36%
PARP	\$ 15.810,00	CER	11,05%	7,80	-1,56%	-1,56%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
S3054	\$ 112,33	Fija	54,69%	0,02	0,13%	0,13%
S1404	\$ 128,80	Fija	54,42%	0,05	0,12%	0,12%
S11N4	\$ 103,02	Fija	54,69%	0,13	0,18%	0,18%
S29N4	\$ 124,65	Fija	55,14%	0,18	0,14%	0,14%
S13D4	\$ 115,09	Fija	55,78%	0,22	0,12%	0,12%
S17E5	\$ 114,25	Fija	55,07%	0,32	0,35%	0,35%
S31E5	\$ 147,40	Fija	56,43%	0,35	0,27%	0,27%
S14F5	\$ 101,40	Fija	57,78%	0,39	0,05%	0,05%
S28F5	\$ 130,00	Fija	58,05%	0,43	0,12%	0,12%
S14M5	\$ 101,49	Fija	58,60%	0,47	0,18%	0,18%
S31M5	\$ 122,70	Fija	58,56%	0,52	0,33%	0,33%
S16A5	\$ 101,30	Fija	58,87%	0,56	0,30%	0,30%
S16V5	\$ 101,70	Fija	58,91%	0,64	0,31%	0,31%
S18I5	\$ 105,50	Fija	58,40%	0,73	0,67%	0,67%
S30I5	\$ 103,10	Fija	58,50%	0,76	0,49%	0,49%
S29G5	\$ 102,60	Fija	54,16%	0,93	0,34%	0,34%
S12S5	\$ 101,82	Fija	58,52%	0,97	0,61%	0,61%
TO26	\$ 74,90	Fija	43,31%	1,63	1,35%	1,35%
PBA25	\$ 106,35	Badlar	62,18%	0,47	0,49%	0,49%
BDC28	\$ 103,45	Badlar	54,13%	1,82	0,34%	0,34%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 65,25	21,6%	64,2%	2,13	1,00%	1,53%	-0,70%	-0,70%
GD29	\$ 66,70	20,4%	65,6%	2,15	1,00%	1,50%	-1,55%	-1,55%
AL30	\$ 58,22	21,6%	57,5%	2,46	0,75%	1,29%	0,00%	0,00%
GD30	\$ 59,45	20,5%	59,5%	2,49	0,75%	1,26%	-0,08%	-0,08%
AL35	\$ 49,23	16,5%	46,0%	6,25	3,63%	7,36%	-0,44%	-0,44%
GD35	\$ 49,90	16,3%	49,9%	6,26	3,63%	7,26%	0,48%	0,48%
AE38	\$ 53,04	17,3%	53,0%	5,23	4,25%	8,01%	0,08%	0,08%
GD38	\$ 54,55	16,7%	54,6%	5,29	4,25%	7,79%	0,46%	0,46%
AL41	\$ 46,10	16,0%	43,5%	6,36	3,50%	7,59%	0,00%	0,00%
GD41	\$ 46,95	15,7%	47,0%	6,41	3,50%	7,45%	-0,11%	-0,11%
GD46	\$ 51,93	15,1%	51,9%	5,63	3,00%	5,78%	-0,23%	-0,23%
BPI5D	\$ 82,85	1,5%	82,9%	0,39	0,00%	0,00%	-0,18%	-0,18%
BPA7D	\$ 97,20	17,4%	97,2%	0,58	5,00%	5,14%	0,00%	0,00%
BPB7D	\$ 88,50	16,7%	88,5%	1,49	5,00%	5,65%	0,34%	0,34%
BPC7D	\$ 83,10	15,3%	83,1%	2,35	5,00%	6,02%	-0,12%	-0,12%
BPD7D	\$ 82,35	15,3%	82,4%	2,55	5,00%	6,07%	-3,12%	-3,12%
BPY6D	\$ 87,12	13,8%	87,1%	0,88	3,00%	3,44%	-0,71%	-0,71%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
7	30/09/2024	\$ 974,00	0,8%	51,0%	41,4%	3,49%
38	31/10/2024	\$ 1.007,00	4,2%	48,6%	40,4%	3,35%
67	29/11/2024	\$ 1.040,50	7,7%	49,6%	41,8%	3,41%
98	30/12/2024	\$ 1.083,50	12,1%	53,1%	45,2%	3,62%
130	31/01/2025	\$ 1.131,00	17,0%	55,5%	47,8%	3,75%
158	28/02/2025	\$ 1.168,50	20,9%	55,1%	48,3%	3,72%
189	31/03/2025	\$ 1.208,00	25,0%	53,9%	48,3%	3,66%
219	30/04/2025	\$ 1.251,50	29,5%	53,9%	49,2%	3,66%
249	30/05/2025	\$ 1.289,00	33,4%	52,6%	48,9%	3,58%
280	30/06/2025	\$ 1.321,50	36,8%	50,4%	47,9%	3,46%
311	31/07/2025	\$ 1.355,00	40,2%	48,7%	47,2%	3,36%
342	31/08/2025	\$ 1.405,00	45,4%	49,1%	48,4%	3,38%

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

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

