

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 936,50 ccl⁽¹⁾: \$ 1.330,29 MEP⁽²⁾: \$ 1.319,90 Brecha: 42,05% Devaluación⁽³⁾: 2,00% Inflación⁽⁴⁾: 4,60% Tasa Pase: 40% Tasa Badlar: 36,75% Tasa Caución: 34,38%

⁽¹⁾ Promedio a través de ADRs. ⁽²⁾ Calculado con AL30. ⁽³⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual). ⁽⁴⁾ Inflación mensual de Junio.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA [*]	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDG24	\$ 1.092,00	Duales (CER)	-9,9%	6,2%	0,06	24	0,18%	0,36%
TDE25	\$ 1.089,90	Duales (CER)	2,3%	39,7%	0,48	178	-2,69%	0,36%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA [*]	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 945,00	Dólar linked	-5,30%	18,62%	0,16	55	1,07%	1,34%
TV25	\$ 1.021,70	Dólar linked	-12,15%	10,81%	0,72	237	-1,89%	0,15%
TZV25	\$ 1.020,00	Dólar linked	-8,57%	0,00%	1,05	328	-1,26%	-2,86%
TZV05	\$ 1.050,00	Dólar linked	-8,19%	0,00%	1,37	496	0,00%	0,00%
TZV26	\$ 903,00	Dólar linked	1,86%	0,00%	1,84	693	-0,22%	0,33%
TDG24	\$ 1.092,00	Duales (DL)	-91,47%	-208,11%	0,06	24	0,18%	0,36%
TDE25	\$ 1.089,90	Duales (DL)	-27,09%	-13,02%	0,48	178	-2,69%	0,36%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 535,10	CER	2,68%	0,19	0,00%	0,02%
TSX4	\$ 425,00	CER	9,17%	0,35	0,00%	0,16%
T2X5	\$ 518,20	CER	12,16%	0,44	0,37%	0,52%
TZXM5	\$ 113,50	CER	6,91%	0,65	-1,30%	-0,22%
TZX25	\$ 159,25	CER	11,34%	0,90	0,66%	1,05%
TX25	\$ 843,90	CER	10,15%	1,24	1,08%	0,48%
TX26	\$ 1.699,50	CER	12,32%	1,19	0,06%	-0,61%
TZXD5	\$ 135,50	CER	11,98%	1,36	0,07%	0,37%
TZXM6	\$ 106,00	CER	11,63%	1,65	0,62%	0,95%
TZX26	\$ 172,50	CER	11,96%	1,90	0,00%	0,29%
TZXD6	\$ 120,45	CER	12,20%	2,36	0,37%	0,79%
TZXM7	\$ 92,00	CER	10,04%	2,65	1,10%	2,22%
TZX27	\$ 158,50	CER	10,87%	2,90	-0,84%	-3,94%
TZXD7	\$ 107,50	CER	12,15%	3,36	0,00%	-0,69%
TZX28	\$ 138,00	CER	11,87%	3,90	0,73%	1,10%
TX28	\$ 1.417,00	CER	12,11%	2,03	0,50%	1,50%
DICP	\$ 28.350,00	CER	13,62%	3,63	0,51%	0,18%
PARP	\$ 13.980,00	CER	11,67%	7,87	1,67%	-0,07%
S16G4	\$ 108,41	Fija	41,75%	0,02	0,24%	0,33%
S30G4	\$ 110,28	Fija	52,20%	0,06	0,12%	0,12%
S13S4	\$ 108,32	Fija	53,68%	0,10	0,16%	0,25%
S30S4	\$ 106,14	Fija	54,01%	0,15	0,18%	0,18%
S14O4	\$ 121,90	Fija	52,70%	0,31	0,53%	0,29%
S29N4	\$ 117,77	Fija	54,65%	0,48	0,25%	-0,01%
S13D4	\$ 108,55	Fija	55,87%	0,56	0,14%	-0,09%
S17E5	\$ 107,25	Fija	57,00%	0,45	0,19%	-0,23%
S31E5	\$ 138,50	Fija	57,54%	0,56	0,00%	-0,50%
S28F5	\$ 122,40	Fija	57,54%	0,65	0,41%	-0,24%
S31M5	\$ 114,55	Fija	58,06%	1,75	0,60%	0,09%
TO26	\$ 67,05	Fija	48,58%	0,61	-0,22%	-0,07%
PBA25	\$ 97,79	Badlar	59,44%	0,61	0,66%	2,13%
BDC28	\$ 108,00	Badlar	47,31%	1,87	-1,73%	-0,92%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 53,61	31,5%	52,8%	2,11	1,00%	1,87%	1,73%	-0,72%
GD29	\$ 56,70	28,1%	55,8%	2,16	1,00%	1,76%	4,04%	0,00%
AL30	\$ 47,80	30,2%	47,2%	2,41	0,75%	1,57%	2,18%	1,70%
GD30	\$ 50,30	27,5%	50,3%	2,47	0,75%	1,49%	1,51%	0,80%
AL35	\$ 40,53	19,8%	38,1%	6,12	3,63%	8,94%	1,79%	-0,66%
GD35	\$ 40,95	19,6%	41,0%	6,14	3,63%	8,85%	1,61%	-0,27%
AE38	\$ 42,00	22,2%	42,0%	4,95	4,25%	10,12%	0,62%	-0,37%
GD38	\$ 46,00	20,1%	46,0%	5,13	4,25%	9,24%	2,68%	0,65%
AL41	\$ 37,50	19,5%	35,5%	6,05	3,50%	9,33%	0,67%	0,00%
GD41	\$ 38,70	18,9%	38,7%	6,13	3,50%	9,04%	0,34%	-1,88%
GD46	\$ 42,11	19,3%	42,1%	5,04	3,00%	7,12%	0,00%	-4,73%
BPJ5D	\$ 89,50	5,1%	89,5%	0,48	0,00%	0,00%	1,13%	0,56%
BPA7D	\$ 94,79	18,0%	94,8%	0,71	5,00%	5,27%	1,92%	2,48%
BPB7D	\$ 77,50	25,1%	77,5%	1,61	5,00%	6,45%	1,97%	0,03%
BPC7D	\$ 72,90	20,7%	72,9%	2,46	5,00%	6,86%	2,82%	-1,30%
BPD7D	\$ 70,67	21,3%	70,7%	2,65	5,00%	7,08%	1,25%	2,27%
BPY6D	\$ 74,49	26,3%	74,5%	0,96	3,00%	4,03%	0,87%	-0,01%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
24	30/08/2024	\$ 960,50	2,6%	46,9%	39,0%	3,26%
55	30/09/2024	\$ 993,00	6,0%	47,5%	40,0%	3,29%
86	31/10/2024	\$ 1.029,00	9,9%	49,1%	41,9%	3,39%
115	29/11/2024	\$ 1.071,00	14,4%	53,1%	45,6%	3,61%
146	30/12/2024	\$ 1.116,50	19,2%	55,2%	48,1%	3,73%
178	31/01/2025	\$ 1.167,00	24,6%	57,0%	50,5%	3,83%
206	28/02/2025	\$ 1.212,00	29,4%	57,9%	52,1%	3,88%
237	31/03/2025	\$ 1.257,00	34,2%	57,3%	52,7%	3,85%
267	30/04/2025	\$ 1.295,00	38,3%	55,7%	52,3%	3,76%
297	30/05/2025	\$ 1.320,00	41,0%	52,5%	50,3%	3,58%
328	30/06/2025	\$ 1.355,00	44,7%	50,8%	49,7%	3,49%
359	31/07/2025	\$ 1.385,00	47,9%	48,9%	48,7%	3,37%

* Supuestos de Inflación propios: 4% a partir de julio.

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

