

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 944,00 CCL(1): \$ 1.278,12 MEP(2): \$ 1.300,08 Brecha: 35,39% Devaluación(3): 2,02% Inflación(4): 4,00% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 38,50% Tasa Caución: 36,32%

(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
TDG24	\$ 1.106,40	Duales (CER)	-7,2%	-31,1%	0,03	14	0,34%	0,81%
TDE25	\$ 1.097,00	Duales (CER)	5,0%	40,6%	0,45	168	0,64%	1,26%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 941,10	Dólar linked	2,73%	23,23%	0,11	45	-0,73%	0,33%
TV25	\$ 1.021,10	Dólar linked	-11,67%	11,03%	0,69	227	-0,62%	1,87%
TZV25	\$ 1.020,90	Dólar linked	-8,23%	0,00%	1,01	318	1,38%	2,82%
TZV05	\$ 999,90	Dólar linked	-4,43%	0,00%	1,33	486	-1,97%	-0,51%
TZV26	\$ 900,00	Dólar linked	2,46%	0,00%	1,78	683	-0,55%	0,56%
TDG24	\$ 1.106,40	Duales (DL)	-99,52%	-475,56%	0,03	14	0,34%	0,81%
TDE25	\$ 1.097,00	Duales (DL)	-28,66%	-8,43%	0,45	168	0,64%	1,26%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 547,50	CER	-0,38%	0,15	0,42%	1,41%
TSX4	\$ 441,50	CER	3,23%	0,32	0,97%	2,85%
T2X5	\$ 531,00	CER	6,58%	0,45	0,66%	1,09%
TZXM5	\$ 115,50	CER	7,29%	0,61	0,87%	1,32%
TZX25	\$ 169,00	CER	6,48%	0,86	1,99%	5,16%
TX25	\$ 875,00	CER	8,73%	1,21	0,21%	4,17%
TX26	\$ 1.808,00	CER	8,46%	1,17	1,12%	4,69%
TZXD5	\$ 145,25	CER	7,97%	1,32	1,75%	5,64%
TZXM6	\$ 114,50	CER	7,82%	1,61	2,69%	6,76%
TZX26	\$ 187,80	CER	8,18%	1,86	2,29%	7,07%
TZXD6	\$ 132,55	CER	8,66%	2,32	1,38%	6,90%
TZXM7	\$ 97,50	CER	8,47%	2,61	5,98%	5,98%
TZX27	\$ 168,10	CER	9,41%	2,86	-0,53%	3,70%
TZXD7	\$ 121,90	CER	8,68%	3,32	1,58%	9,82%
TZX28	\$ 156,00	CER	8,97%	3,87	3,14%	9,21%
TX28	\$ 1.535,00	CER	8,90%	2,05	1,02%	6,86%
DICP	\$ 32.000,00	CER	10,63%	3,78	4,10%	9,22%
PARP	\$ 15.600,00	CER	10,43%	7,97	4,73%	9,24%
S30G4	\$ 111,84	Fija	51,00%	0,03	0,38%	0,85%
S1354	\$ 109,85	Fija	53,91%	0,07	0,32%	0,84%
S3054	\$ 107,71	Fija	53,36%	0,12	0,34%	0,95%
S1404	\$ 123,80	Fija	51,16%	0,15	0,45%	0,86%
S29N4	\$ 120,00	Fija	52,20%	0,28	0,35%	1,10%
S13D4	\$ 111,20	Fija	51,27%	0,32	0,55%	1,41%
S17E5	\$ 110,24	Fija	52,27%	0,41	0,63%	2,18%
S31E5	\$ 142,20	Fija	53,61%	0,45	0,35%	1,90%
S28F5	\$ 125,80	Fija	54,41%	0,53	0,00%	2,07%
S31M5	\$ 118,35	Fija	56,16%	0,61	0,04%	2,72%
S18I5	\$ 101,30	Fija	57,49%	0,83	1,30%	1,30%
TO26	\$ 71,00	Fija	44,81%	1,73	1,81%	4,41%
PBA25	\$ 100,45	Badlar	59,29%	0,58	-0,50%	-1,13%
BDC28	\$ 111,10	Badlar	48,69%	1,80	0,14%	5,21%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 56,90	28,4%	56,0%	2,12	1,00%	1,76%	0,00%	3,45%
GD29	\$ 58,85	26,4%	57,9%	2,15	1,00%	1,70%	1,29%	1,48%
AL30	\$ 49,95	28,3%	49,4%	2,42	0,75%	1,50%	-0,68%	2,61%
GD30	\$ 52,48	25,7%	52,4%	2,47	0,75%	1,43%	-0,04%	2,86%
AL35	\$ 43,52	18,6%	40,8%	6,19	3,63%	8,33%	0,51%	4,87%
GD35	\$ 44,24	18,2%	44,2%	6,21	3,63%	8,19%	1,12%	5,41%
AE38	\$ 45,20	20,6%	45,2%	5,05	4,25%	9,40%	-1,31%	3,43%
GD38	\$ 49,00	18,7%	49,0%	5,21	4,25%	8,67%	0,64%	6,52%
AL41	\$ 39,35	18,7%	37,2%	6,12	3,50%	8,89%	-1,51%	1,73%
GD41	\$ 42,40	17,3%	42,4%	6,30	3,50%	8,25%	1,56%	7,83%
GD46	\$ 46,00	17,4%	46,0%	5,31	3,00%	6,52%	0,00%	6,48%
BPI5D	\$ 88,49	8,3%	88,5%	0,44	0,00%	0,00%	-0,18%	1,83%
BPA7D	\$ 91,50	25,4%	91,5%	0,67	5,00%	5,46%	0,55%	1,67%
BPB7D	\$ 78,00	25,2%	78,0%	1,58	5,00%	6,41%	-0,57%	1,67%
BPC7D	\$ 73,40	20,7%	73,4%	2,42	5,00%	6,81%	-0,68%	-0,14%
BPD7D	\$ 71,49	21,0%	71,5%	2,62	5,00%	6,99%	0,69%	2,13%
BPY6D	\$ 77,50	23,6%	77,5%	0,93	3,00%	3,87%	0,00%	2,65%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
14	30/08/2024	\$ 956,50	1,3%	40,9%	34,5%	2,90%
45	30/09/2024	\$ 988,00	4,7%	44,7%	37,8%	3,13%
76	31/10/2024	\$ 1.023,00	8,4%	47,1%	40,2%	3,27%
105	29/11/2024	\$ 1.059,00	12,2%	49,1%	42,3%	3,39%
136	30/12/2024	\$ 1.095,00	16,0%	48,9%	42,9%	3,37%
168	31/01/2025	\$ 1.140,00	20,8%	50,7%	45,1%	3,47%
196	28/02/2025	\$ 1.180,00	25,0%	51,5%	46,6%	3,52%
227	31/03/2025	\$ 1.226,00	29,9%	52,2%	48,0%	3,56%
257	30/04/2025	\$ 1.264,00	33,9%	51,4%	48,1%	3,52%
287	30/05/2025	\$ 1.290,00	36,7%	48,8%	46,6%	3,36%
318	30/06/2025	\$ 1.326,00	40,5%	47,7%	46,4%	3,30%
349	31/07/2025	\$ 1.369,50	45,1%	47,6%	47,1%	3,30%

* Supuestos de inflación propios: 3% a partir de Agosto.
Supuestos de Devaluación: 2% mensual para instrumentos con vencimiento en 2024.

