

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 949,75 ccl(1): \$ 1.294,07 MEP(2): \$ 1.287,77 Brecha: 36,25% Devaluación(3): 2,28% Inflación(4): 4,00% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 38,38% Tasa Caución: 33,80%

(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	\$ 1.118,80	Duales (CER)	-6,2%	-368,5%	0,01	3	0,10%	0,31%
TDE25	\$ 1.125,00	Duales (CER)	2,3%	34,4%	0,43	157	1,72%	1,63%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 950,00	Dólar linked	0,63%	24,73%	0,09	34	0,21%	0,26%
TV25	\$ 1.020,00	Dólar linked	-10,93%	12,21%	0,66	216	-1,02%	-0,49%
TV25	\$ 1.014,90	Dólar linked	-7,06%	0,00%	0,96	307	-0,04%	-1,55%
TZV05	\$ 1.040,00	Dólar linked	-6,87%	0,00%	1,31	475	3,23%	-0,95%
TZV26	\$ 890,00	Dólar linked	3,50%	0,00%	1,73	672	0,00%	1,14%
TDG24	\$ 1.118,80	Duales (DL)	-100,00%	-1100,64%	0,01	3	0,10%	0,31%
TDE25	\$ 1.125,00	Duales (DL)	-32,98%	-15,70%	0,43	157	1,72%	1,63%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 555,40	CER	-1,42%	0,13	0,34%	0,25%
TSX4	\$ 450,00	CER	1,40%	0,29	0,78%	0,78%
T2X5	\$ 549,10	CER	2,34%	0,45	0,60%	2,25%
TZXM5	\$ 121,00	CER	1,66%	0,59	1,77%	2,54%
TZX25	\$ 175,00	CER	3,94%	0,84	1,21%	1,80%
TX25	\$ 917,40	CER	5,82%	1,19	0,26%	0,37%
TX26	\$ 1.867,00	CER	6,87%	1,16	0,89%	1,19%
TZXD5	\$ 149,95	CER	6,57%	1,30	1,11%	1,63%
TZXM6	\$ 117,00	CER	7,36%	1,59	0,43%	0,86%
TZX26	\$ 192,95	CER	7,48%	1,84	1,10%	1,55%
TZXD6	\$ 135,15	CER	8,45%	2,30	0,48%	1,16%
TZXM7	\$ 98,25	CER	8,78%	2,59	0,26%	-1,65%
TZX27	\$ 179,90	CER	7,40%	2,84	2,16%	3,63%
TZXD7	\$ 123,25	CER	8,82%	3,30	2,41%	2,37%
TZX28	\$ 158,50	CER	8,95%	3,84	1,28%	1,93%
TX28	\$ 1.583,00	CER	8,06%	2,03	0,29%	-0,38%
DICP	\$ 32.570,00	CER	10,56%	3,76	1,80%	3,09%
PARP	\$ 15.535,00	CER	10,70%	7,92	0,88%	-0,35%
S30G4	\$ 112,98	Fija	51,57%	0,01	0,11%	0,22%
S13S4	\$ 111,04	Fija	53,40%	0,04	0,13%	0,31%
S30S4	\$ 108,91	Fija	52,45%	0,09	0,14%	0,37%
S14O4	\$ 125,10	Fija	50,86%	0,13	0,16%	0,47%
S29N4	\$ 121,65	Fija	50,22%	0,25	0,29%	0,47%
S13D4	\$ 112,75	Fija	49,40%	0,29	0,36%	0,58%
S17E5	\$ 112,35	Fija	48,94%	0,39	0,81%	1,22%
S31E5	\$ 145,10	Fija	50,20%	0,43	0,66%	0,76%
S28F5	\$ 129,10	Fija	49,83%	0,50	1,07%	1,24%
S31M5	\$ 121,05	Fija	53,12%	0,59	0,79%	1,06%
S18I5	\$ 103,34	Fija	55,80%	0,81	1,16%	1,21%
TO26	\$ 72,49	Fija	43,82%	1,71	-0,22%	-0,69%
PBA25	\$ 102,70	Badlar	56,02%	0,55	0,79%	0,79%
BDC28	\$ 101,30	Badlar	48,72%	1,97	-0,59%	-0,88%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 57,57	28,0%	56,6%	2,10	1,00%	1,74%	-0,38%	1,30%
GD29	\$ 58,70	26,9%	57,8%	2,12	1,00%	1,70%	-0,17%	1,02%
AL30	\$ 51,12	27,4%	50,5%	2,41	0,75%	1,47%	0,93%	1,77%
GD30	\$ 52,80	25,7%	52,8%	2,45	0,75%	1,42%	0,19%	0,90%
AL35	\$ 43,89	18,5%	41,1%	6,17	3,63%	8,26%	1,43%	2,43%
GD35	\$ 44,28	18,3%	44,3%	6,18	3,63%	8,19%	-0,05%	0,75%
AE38	\$ 45,55	20,5%	45,6%	5,03	4,25%	9,33%	0,55%	0,66%
GD38	\$ 48,30	19,2%	48,3%	5,15	4,25%	8,80%	-0,70%	-0,88%
AL41	\$ 39,70	18,6%	37,5%	6,11	3,50%	8,82%	-0,25%	0,25%
GD41	\$ 41,75	17,7%	41,7%	6,23	3,50%	8,38%	-2,23%	0,21%
GD46	\$ 46,15	17,4%	46,2%	5,29	3,00%	6,50%	2,33%	1,43%
BPJ5D	\$ 91,30	1,0%	91,3%	0,42	0,00%	0,00%	0,20%	1,46%
BPA7D	\$ 93,00	23,3%	93,0%	0,65	5,00%	5,38%	0,54%	1,86%
BPB7D	\$ 81,50	22,1%	81,5%	1,56	5,00%	6,13%	1,24%	3,16%
BPC7D	\$ 75,00	19,8%	75,0%	2,40	5,00%	6,67%	0,67%	1,76%
BPD7D	\$ 73,00	20,3%	73,0%	2,60	5,00%	6,85%	0,27%	1,53%
BPY6D	\$ 80,00	21,4%	80,0%	0,92	3,00%	3,75%	0,19%	0,88%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
3	30/08/2024	\$ 953,50	0,4%	61,5%	48,0%	4,08%
34	30/09/2024	\$ 987,50	4,0%	52,0%	42,7%	3,55%
65	31/10/2024	\$ 1.021,50	7,6%	50,5%	42,4%	3,47%
94	29/11/2024	\$ 1.055,50	11,1%	50,7%	43,2%	3,48%
125	30/12/2024	\$ 1.089,50	14,7%	49,3%	43,0%	3,40%
157	31/01/2025	\$ 1.134,50	19,5%	51,2%	45,2%	3,50%
185	28/02/2025	\$ 1.177,50	24,0%	52,8%	47,3%	3,60%
216	31/03/2025	\$ 1.217,00	28,1%	52,0%	47,5%	3,55%
246	30/04/2025	\$ 1.260,00	32,7%	52,1%	48,5%	3,56%
276	30/05/2025	\$ 1.291,50	36,0%	50,2%	47,6%	3,45%
307	30/06/2025	\$ 1.330,00	40,0%	49,2%	47,6%	3,39%
338	31/07/2025	\$ 1.370,00	44,2%	48,5%	47,8%	3,35%

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

