

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 952,75 CCL<sup>(1)</sup>: \$ 1.296,33 MEP<sup>(2)</sup>: \$ 1.287,38 Brecha: 36,06% Devaluación<sup>(3)</sup>: 1,69% Inflación<sup>(4)</sup>: 4,00% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 39,44% Tasa Caución: 36,80%

(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
TDE25	\$ 1.128,00	Duales (CER)	3,7%	35,0%	0,41	151	0,36%	0,36%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 951,00	Dólar linked	2,94%	27,00%	0,07	28	-0,47%	-0,47%
TV25	\$ 1.032,10	Dólar linked	-12,64%	10,13%	0,65	210	-0,14%	-0,14%
TZV25	\$ 1.013,00	Dólar linked	-6,68%	0,00%	0,93	301	0,76%	0,76%
TZVD5	\$ 1.030,00	Dólar linked	-6,06%	0,00%	1,30	469	-0,48%	-0,48%
TZV26	\$ 885,00	Dólar linked	4,01%	0,00%	1,69	666	0,00%	-1,67%
TDE25	\$ 1.128,00	Duales (DL)	-34,04%	-17,22%	0,41	151	0,36%	0,36%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 558,20	CER	0,80%	0,11	0,13%	0,13%
TSX4	\$ 451,50	CER	3,13%	0,28	0,27%	0,27%
TX25	\$ 549,30	CER	4,13%	0,42	-0,04%	-0,04%
TZXM5	\$ 120,50	CER	3,85%	0,57	0,00%	0,00%
TZX25	\$ 174,25	CER	5,56%	0,82	-0,37%	-0,37%
TX25	\$ 922,00	CER	6,16%	1,17	0,22%	0,22%
TX26	\$ 1.869,00	CER	7,60%	1,14	0,03%	0,03%
TZXD5	\$ 150,00	CER	7,28%	1,28	0,00%	0,00%
TZXM6	\$ 116,50	CER	8,27%	1,57	-0,43%	-0,43%
TZX26	\$ 192,50	CER	8,15%	1,82	-0,39%	-0,39%
TZXD6	\$ 137,00	CER	8,24%	2,28	0,07%	0,07%
TZXM7	\$ 100,50	CER	8,21%	2,57	1,52%	1,52%
TZX27	\$ 175,35	CER	8,72%	2,82	-1,49%	-1,49%
TZXD7	\$ 123,75	CER	8,99%	3,28	-0,20%	-0,20%
TZX28	\$ 158,10	CER	9,28%	3,82	-0,85%	-0,85%
TX28	\$ 1.579,00	CER	8,68%	2,01	-0,69%	-0,69%
DICP	\$ 33.250,00	CER	10,24%	3,77	-0,45%	-0,45%
PARP	\$ 15.900,00	CER	10,51%	7,92	-0,38%	-0,38%
S1354	\$ 111,80	Fija	54,55%	0,03	0,14%	0,14%
S3054	\$ 109,60	Fija	53,73%	0,07	0,14%	0,14%
S1404	\$ 125,80	Fija	52,46%	0,11	0,16%	0,16%
S11N4	\$ 100,70	Fija	52,80%	0,19	0,16%	0,16%
S29N4	\$ 122,15	Fija	51,88%	0,24	-0,12%	-0,12%
S13D4	\$ 112,80	Fija	52,76%	0,28	-0,09%	-0,09%
S17E5	\$ 111,95	Fija	53,04%	0,37	0,19%	0,19%
S31E5	\$ 144,91	Fija	53,15%	0,41	0,04%	0,04%
S28F5	\$ 127,95	Fija	54,70%	0,49	0,04%	0,04%
S31M5	\$ 120,65	Fija	55,90%	0,57	-0,04%	-0,04%
S18J5	\$ 103,46	Fija	57,01%	0,79	0,09%	0,09%
S30J5	\$ 100,75	Fija	57,84%	0,82	0,20%	0,20%
S29G5	\$ 100,65	Fija	53,32%	0,99	0,05%	0,05%
TO26	\$ 71,50	Fija	45,52%	0,46	0,70%	0,70%
PBA25	\$ 103,60	Badlar	57,54%	0,58	0,58%	0,58%
BDC28	\$ 103,95	Badlar	48,68%	0,49	0,53%	0,53%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 62,15	23,7%	61,1%	2,15	1,00%	1,61%	1,54%	1,54%
GD29	\$ 62,60	23,3%	61,6%	2,16	1,00%	1,60%	0,97%	0,97%
AL30	\$ 54,84	23,9%	54,2%	2,47	0,75%	1,37%	0,81%	0,81%
GD30	\$ 56,00	22,9%	56,0%	2,49	0,75%	1,34%	0,94%	0,94%
AL35	\$ 46,00	17,6%	43,1%	6,22	3,63%	7,88%	1,11%	1,11%
GD35	\$ 46,28	17,5%	46,3%	6,23	3,63%	7,83%	0,83%	0,83%
AE38	\$ 49,18	18,8%	49,2%	5,16	4,25%	8,64%	1,84%	1,84%
GD38	\$ 51,00	18,0%	51,0%	5,23	4,25%	8,33%	1,21%	1,21%
AL41	\$ 41,84	17,7%	39,6%	6,21	3,50%	8,37%	1,35%	1,35%
GD41	\$ 43,75	16,8%	43,8%	6,31	3,50%	8,00%	0,58%	0,58%
GD46	\$ 49,30	16,0%	49,3%	5,52	3,00%	6,09%	2,71%	2,71%
BPA7D	\$ 82,50	2,3%	82,5%	0,45	0,00%	0,00%	0,30%	0,30%
BPA7D	\$ 93,60	22,8%	93,6%	0,63	5,00%	5,34%	0,11%	0,11%
BPB7D	\$ 84,56	19,5%	84,6%	1,55	5,00%	5,91%	0,97%	0,97%
BPC7D	\$ 78,75	17,5%	78,8%	2,40	5,00%	6,35%	2,27%	2,27%
BPD7D	\$ 77,00	18,0%	77,0%	2,59	5,00%	6,49%	1,99%	1,99%
BPY6D	\$ 83,00	17,1%	83,0%	0,92	3,00%	3,61%	1,53%	1,53%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEK

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
28	30/09/2024	\$ 981,00	3,0%	46,4%	38,7%	3,23%
59	31/10/2024	\$ 1.012,00	6,2%	45,2%	38,5%	3,16%
88	29/11/2024	\$ 1.045,00	9,7%	46,7%	40,2%	3,25%
119	30/12/2024	\$ 1.083,00	13,7%	48,1%	41,9%	3,33%
151	31/01/2025	\$ 1.127,00	18,3%	50,1%	44,2%	3,44%
179	28/02/2025	\$ 1.166,00	22,4%	51,0%	45,6%	3,49%
210	31/03/2025	\$ 1.205,50	26,5%	50,5%	46,1%	3,47%
240	30/04/2025	\$ 1.249,00	31,1%	50,9%	47,3%	3,49%
270	30/05/2025	\$ 1.284,00	34,8%	49,7%	47,0%	3,42%
301	30/06/2025	\$ 1.318,00	38,3%	48,2%	46,5%	3,33%
332	31/07/2025	\$ 1.357,00	42,4%	47,5%	46,6%	3,29%

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

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

