

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 954,17 CCL⁽¹⁾: \$ 1.311,74 MEP⁽²⁾: \$ 1.288,74 Brecha: 37,47% Devaluación⁽³⁾: 2,04% Inflación⁽⁴⁾: 4,00% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 37,38% Tasa Caución: 36,20%

(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	\$ 1.130,00	Duales (CER)	3,6%	34,7%	0,41	150	0,18%	0,53%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 946,00	Dólar linked	14,58%	37,98%	0,06	27	-0,53%	-0,99%
TV25	\$ 1.029,90	Dólar linked	-12,01%	10,88%	0,64	209	-0,21%	-0,35%
TZV25	\$ 1.013,60	Dólar linked	-6,51%	0,00%	0,93	300	0,06%	0,82%
TZV25	\$ 1.030,00	Dólar linked	-5,90%	0,00%	1,29	468	0,00%	-0,48%
TZV26	\$ 910,00	Dólar linked	2,56%	0,00%	1,74	665	1,11%	1,11%
TDE25	\$ 1.130,00	Duales (DL)	-34,15%	-17,37%	0,41	150	0,18%	0,53%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 559,30	CER	0,18%	0,11	0,20%	0,32%
TSX4	\$ 451,05	CER	4,02%	0,27	-0,10%	0,17%
TZK5	\$ 549,50	CER	4,37%	0,42	0,04%	0,00%
TZXM5	\$ 121,50	CER	2,60%	0,57	0,83%	0,83%
TZXM25	\$ 174,20	CER	5,78%	0,82	-0,03%	-0,40%
TX25	\$ 924,60	CER	6,03%	1,17	0,28%	0,50%
TX26	\$ 1.864,50	CER	7,97%	1,13	-0,24%	-0,21%
TZXD5	\$ 149,00	CER	7,96%	1,28	-0,67%	-0,67%
TZXM6	\$ 116,10	CER	8,61%	1,57	-0,34%	-0,77%
TZXM26	\$ 192,00	CER	8,39%	1,82	-0,26%	-0,65%
TZXD6	\$ 135,65	CER	8,78%	2,28	-0,99%	-0,91%
TZXM7	\$ 101,50	CER	7,86%	2,57	1,00%	2,53%
TZXM27	\$ 172,90	CER	9,32%	2,82	-1,40%	-2,87%
TZXD7	\$ 123,70	CER	9,05%	3,28	-0,04%	-0,24%
TZXM28	\$ 157,80	CER	9,38%	3,82	-0,19%	-1,03%
TX28	\$ 1.570,00	CER	9,07%	2,00	-0,57%	-1,26%
DICP	\$ 33.050,00	CER	10,46%	3,75	-0,60%	-1,05%
PARP	\$ 15.915,00	CER	10,52%	7,92	0,09%	-0,28%
S1354	\$ 111,97	Fija	52,85%	0,02	0,15%	0,29%
S3054	\$ 109,78	Fija	52,73%	0,07	0,16%	0,30%
S1404	\$ 126,10	Fija	50,76%	0,11	0,24%	0,40%
S11N4	\$ 100,84	Fija	52,62%	0,19	0,14%	0,30%
S29N4	\$ 122,29	Fija	51,88%	0,23	0,11%	-0,01%
S13D4	\$ 113,15	Fija	51,69%	0,27	0,31%	0,22%
S17E5	\$ 112,45	Fija	51,69%	0,37	0,45%	0,64%
S31E5	\$ 145,15	Fija	52,97%	0,41	0,17%	0,21%
S28F5	\$ 128,00	Fija	54,95%	0,48	0,04%	0,08%
S31M5	\$ 120,65	Fija	56,24%	0,57	0,00%	-0,04%
S18I5	\$ 103,46	Fija	57,26%	0,79	0,00%	0,09%
S30I5	\$ 100,95	Fija	57,70%	0,82	0,20%	0,40%
S29G5	\$ 100,70	Fija	53,50%	0,98	0,05%	0,10%
TO26	\$ 71,90	Fija	45,12%	0,45	0,56%	1,27%
PBA25	\$ 104,45	Badlar	55,31%	0,55	0,82%	1,41%
BDC28	\$ 100,45	Badlar	51,29%	0,51	-3,37%	-2,85%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 61,32	24,5%	60,3%	2,13	1,00%	1,63%	-1,34%	0,18%
GD29	\$ 61,75	24,1%	60,7%	2,14	1,00%	1,62%	-1,36%	-0,40%
AL30	\$ 54,20	24,6%	53,5%	2,45	0,75%	1,38%	-1,17%	-0,37%
GD30	\$ 55,40	23,5%	55,4%	2,48	0,75%	1,35%	-1,07%	-0,14%
AL35	\$ 45,35	17,9%	42,5%	6,19	3,63%	7,99%	-1,41%	-0,32%
GD35	\$ 45,25	18,0%	45,3%	6,19	3,63%	8,01%	-2,23%	-1,42%
AE38	\$ 47,35	19,7%	47,4%	5,08	4,25%	8,98%	-3,72%	-1,95%
GD38	\$ 49,70	18,6%	49,7%	5,18	4,25%	8,55%	-2,55%	-1,37%
AL41	\$ 40,80	18,2%	38,6%	6,14	3,50%	8,58%	-2,48%	-1,16%
GD41	\$ 42,70	17,3%	42,7%	6,25	3,50%	8,20%	-2,40%	-1,84%
GD46	\$ 47,33	16,9%	47,3%	5,35	3,00%	6,34%	-3,99%	-1,39%
BPJ5D	\$ 82,50	2,3%	82,5%	0,44	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%
BPA7D	\$ 95,00	20,0%	95,0%	0,63	5,00%	5,26%	1,50%	1,60%
BPB7D	\$ 84,70	19,4%	84,7%	1,54	5,00%	5,90%	0,17%	1,13%
BPC7D	\$ 77,90	18,1%	77,9%	2,39	5,00%	6,42%	-1,08%	1,17%
BPD7D	\$ 76,99	18,0%	77,0%	2,59	5,00%	6,49%	-0,01%	1,97%
BPY6D	\$ 82,27	17,8%	82,3%	0,92	3,00%	3,65%	-0,88%	0,64%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEK

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
27	30/09/2024	\$ 981,00	2,8%	45,5%	38,0%	3,17%
58	31/10/2024	\$ 1.013,00	6,2%	45,7%	38,8%	3,19%
87	29/11/2024	\$ 1.046,00	9,6%	47,0%	40,4%	3,26%
118	30/12/2024	\$ 1.083,50	13,6%	48,2%	41,9%	3,33%
150	31/01/2025	\$ 1.128,50	18,3%	50,4%	44,5%	3,46%
178	28/02/2025	\$ 1.166,50	22,3%	51,0%	45,6%	3,49%
209	31/03/2025	\$ 1.205,00	26,3%	50,3%	45,9%	3,46%
239	30/04/2025	\$ 1.245,00	30,5%	50,1%	46,5%	3,44%
269	30/05/2025	\$ 1.285,00	34,7%	49,8%	47,0%	3,42%
300	30/06/2025	\$ 1.319,00	38,2%	48,3%	46,5%	3,34%
331	31/07/2025	\$ 1.356,00	42,1%	47,3%	46,4%	3,28%

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

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

