

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 958,92 ccl⁽¹⁾: \$ 1.253,49 MEP⁽²⁾: \$ 1.237,48 Brecha: 30,72% Devaluación⁽³⁾: 2,03% Inflación⁽⁴⁾: 4,20% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 38,63% 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 Agosto.

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDE25	\$ 1.146,50	Duales (CER)	2,6%	32,5%	0,39	142	0,31%	0,92%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 954,50	Dólar linked	12,70%	36,13%	0,04	19	-0,73%	0,37%
TV25	\$ 1.014,80	Dólar linked	-9,22%	14,18%	0,60	201	0,57%	-1,18%
TZV25	\$ 1.001,00	Dólar linked	-4,60%	0,00%	0,87	292	-0,50%	-3,08%
TZV25	\$ 1.010,00	Dólar linked	-4,14%	0,00%	1,27	460	-1,94%	-1,46%
TZV26	\$ 900,00	Dólar linked	3,52%	0,00%	1,68	657	-0,55%	-1,10%
TDE25	\$ 1.146,50	Duales (DL)	-37,23%	-21,83%	0,39	142	0,31%	0,92%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 565,80	CER	-1,40%	0,09	0,25%	0,32%
TSX4	\$ 461,25	CER	-0,57%	0,25	-0,16%	0,73%
TZK5	\$ 560,00	CER	2,45%	0,41	0,74%	1,16%
TZXM5	\$ 122,00	CER	3,84%	0,55	0,45%	1,04%
TZX25	\$ 176,65	CER	5,43%	0,80	0,80%	0,80%
TX25	\$ 932,90	CER	6,26%	1,15	0,31%	-0,70%
TX26	\$ 1.888,50	CER	7,88%	1,11	0,45%	1,07%
TZXD5	\$ 151,50	CER	7,55%	1,26	1,07%	1,47%
TZXM6	\$ 119,50	CER	7,43%	1,55	1,62%	1,70%
TZX26	\$ 194,95	CER	8,19%	1,80	0,91%	1,51%
TZXD6	\$ 137,25	CER	8,80%	2,26	0,73%	1,40%
TZXM7	\$ 102,00	CER	8,15%	2,55	-0,73%	-1,45%
TZX27	\$ 176,00	CER	9,10%	2,80	-0,40%	2,33%
TZXD7	\$ 124,25	CER	9,30%	3,26	1,22%	1,10%
TZX28	\$ 158,50	CER	9,60%	3,80	1,08%	1,28%
TX28	\$ 1.603,00	CER	8,59%	1,99	1,46%	1,78%
DICP	\$ 33.250,00	CER	10,64%	3,72	1,00%	1,37%
PARP	\$ 16.120,00	CER	10,51%	7,90	1,07%	0,75%
S1354	\$ 113,00	Fija	58,39%	0,00	0,12%	0,33%
S3054	\$ 110,75	Fija	54,25%	0,05	0,06%	0,25%
S1404	\$ 127,24	Fija	50,75%	0,09	0,19%	0,39%
S11N4	\$ 101,85	Fija	51,97%	0,16	0,05%	0,30%
S29N4	\$ 123,20	Fija	53,14%	0,21	-0,16%	0,21%
S13D4	\$ 114,15	Fija	51,89%	0,25	0,00%	0,01%
S17E5	\$ 112,75	Fija	54,53%	0,35	-0,22%	-0,31%
S31E5	\$ 146,15	Fija	53,94%	0,39	0,03%	-0,07%
S28F5	\$ 128,50	Fija	56,87%	0,46	-0,58%	-0,35%
S31M5	\$ 121,11	Fija	57,95%	0,55	-0,44%	-0,16%
S18J5	\$ 103,75	Fija	58,73%	0,76	-0,43%	-0,14%
S30J5	\$ 101,55	Fija	58,50%	0,80	-0,23%	-0,12%
S29G5	\$ 101,70	Fija	54,56%	0,96	-0,20%	-0,05%
TO26	\$ 73,20	Fija	44,27%	0,44	-1,74%	-1,48%
PBA25	\$ 105,95	Badlar	52,60%	0,53	0,24%	0,90%
BDC28	\$ 102,40	Badlar	49,49%	0,49	1,89%	0,99%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 62,19	24,0%	61,2%	2,12	1,00%	1,61%	-0,42%	0,48%
GD29	\$ 63,75	22,6%	62,7%	2,14	1,00%	1,57%	0,22%	-0,31%
AL30	\$ 55,96	23,2%	55,3%	2,46	0,75%	1,34%	-0,50%	1,62%
GD30	\$ 56,90	22,4%	56,9%	2,48	0,75%	1,32%	-0,30%	1,95%
AL35	\$ 46,25	17,6%	43,3%	6,19	3,63%	7,84%	0,57%	3,01%
GD35	\$ 46,20	17,6%	46,2%	6,19	3,63%	7,85%	0,43%	2,67%
AE38	\$ 48,80	19,1%	48,8%	5,11	4,25%	8,71%	-0,25%	2,03%
GD38	\$ 50,50	18,3%	50,5%	5,18	4,25%	8,42%	0,00%	-0,20%
AL41	\$ 42,37	17,5%	40,0%	6,20	3,50%	8,26%	0,40%	3,60%
GD41	\$ 43,95	16,8%	44,0%	6,29	3,50%	7,96%	0,11%	4,02%
GD46	\$ 49,00	16,2%	49,0%	5,45	3,00%	6,12%	-0,99%	0,20%
BPJ5D	\$ 83,00	1,0%	83,0%	0,42	0,00%	0,00%	-0,40%	-1,07%
BPA7D	\$ 96,31	18,1%	96,3%	0,61	5,00%	5,19%	-1,22%	0,90%
BPB7D	\$ 86,65	18,0%	86,7%	1,52	5,00%	5,77%	-0,69%	2,54%
BPC7D	\$ 78,65	17,8%	78,7%	2,37	5,00%	6,36%	-2,29%	1,16%
BPD7D	\$ 78,74	17,1%	78,7%	2,57	5,00%	6,35%	-0,20%	0,95%
BPY6D	\$ 85,40	15,1%	85,4%	0,90	3,00%	3,51%	-0,99%	1,97%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
19	30/09/2024	\$ 979,00	2,1%	48,9%	40,2%	3,37%
50	31/10/2024	\$ 1.012,00	5,5%	48,2%	40,4%	3,33%
79	29/11/2024	\$ 1.047,00	9,2%	50,1%	42,4%	3,44%
110	30/12/2024	\$ 1.089,00	13,6%	52,5%	45,0%	3,58%
142	31/01/2025	\$ 1.131,00	17,9%	52,8%	46,1%	3,60%
170	28/02/2025	\$ 1.169,00	21,9%	53,0%	47,0%	3,61%
201	31/03/2025	\$ 1.209,00	26,1%	52,3%	47,4%	3,57%
231	30/04/2025	\$ 1.248,50	30,2%	51,7%	47,7%	3,54%
261	30/05/2025	\$ 1.285,50	34,1%	50,7%	47,6%	3,47%
292	30/06/2025	\$ 1.322,00	37,9%	49,4%	47,3%	3,40%
323	31/07/2025	\$ 1.356,00	41,4%	47,9%	46,8%	3,32%
354	31/08/2025	\$ 1.383,00	44,2%	45,9%	45,6%	3,20%

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

