

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 961,75 CCL⁽¹⁾: \$ 1.247,39 MEP⁽²⁾: \$ 1.219,59 Brecha: 29,70% Devaluación⁽³⁾: 2,10% Inflación⁽⁴⁾: 4,20% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 39,25% Tasa Caución: 39,00%

(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	\$ 1.152,00	Duales (CER)	2,8%	32,0%	0,38	140	0,35%	1,41%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
T2V4	\$ 961,00	Dólar linked	0,86%	24,80%	0,04	17	0,42%	1,05%
TV25	\$ 1.019,70	Dólar linked	-10,00%	13,23%	0,60	199	-0,03%	-0,70%
TZV25	\$ 1.006,00	Dólar linked	-5,12%	0,00%	0,87	290	-0,09%	-2,59%
TZVD5	\$ 1.020,00	Dólar linked	-4,83%	0,00%	1,26	458	2,20%	-0,49%
TZV26	\$ 910,00	Dólar linked	2,97%	0,00%	1,69	655	0,86%	0,00%
TDE25	\$ 1.152,00	Duales (DL)	-38,66%	-23,97%	0,38	140	0,35%	0,69%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 567,80	CER	0,39%	0,08	0,32%	0,67%
T5X4	\$ 462,10	CER	0,74%	0,24	0,46%	0,92%
TX25	\$ 563,60	CER	2,19%	0,40	0,36%	1,81%
TZXMS	\$ 123,25	CER	2,93%	0,54	1,36%	2,07%
TZX25	\$ 178,25	CER	4,98%	0,79	0,76%	1,71%
TX25	\$ 942,90	CER	5,80%	1,13	0,59%	0,36%
TX26	\$ 1.900,00	CER	7,86%	1,10	0,66%	1,69%
TZXD5	\$ 152,25	CER	7,63%	1,25	0,66%	1,98%
TZXM6	\$ 121,00	CER	6,97%	1,54	2,54%	2,98%
TZX26	\$ 196,50	CER	8,06%	1,79	0,59%	2,32%
TZXD6	\$ 138,75	CER	8,56%	2,25	0,87%	2,51%
TZXM7	\$ 98,50	CER	9,91%	2,54	-1,50%	-4,83%
TZX27	\$ 175,00	CER	9,56%	2,79	0,29%	1,74%
TZXD7	\$ 124,75	CER	9,37%	3,25	1,01%	1,51%
TZX28	\$ 159,75	CER	9,55%	3,79	0,47%	2,08%
TX28	\$ 1.622,00	CER	8,27%	1,98	-0,09%	2,98%
DICP	\$ 33.310,00	CER	10,77%	3,70	-0,55%	1,55%
PARP	\$ 16.300,00	CER	10,44%	7,89	0,06%	1,88%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 63,40	23,0%	62,3%	2,13	1,00%	1,58%	1,75%	2,44%
GD29	\$ 66,00	20,7%	64,9%	2,16	1,00%	1,52%	3,61%	3,21%
AL30	\$ 56,55	22,8%	55,8%	2,46	0,75%	1,33%	1,29%	2,69%
GD30	\$ 58,12	21,4%	58,1%	2,49	0,75%	1,29%	1,52%	4,14%
AL35	\$ 47,20	17,3%	44,1%	6,21	3,63%	7,68%	1,29%	5,12%
GD35	\$ 47,85	17,0%	47,9%	6,23	3,63%	7,58%	2,46%	6,33%
AE38	\$ 50,24	18,5%	50,2%	5,16	4,25%	8,46%	1,74%	5,04%
GD38	\$ 52,10	17,6%	52,1%	5,23	4,25%	8,16%	2,22%	2,96%
AL41	\$ 43,50	17,0%	41,1%	6,25	3,50%	8,05%	2,35%	6,36%
GD41	\$ 45,40	16,3%	45,4%	6,35	3,50%	7,71%	2,71%	7,46%
GD46	\$ 51,30	15,3%	51,3%	5,62	3,00%	5,85%	2,95%	4,91%
BPI5D	\$ 83,20	0,4%	83,2%	0,41	0,00%	0,00%	0,08%	-0,83%
BPA7D	\$ 96,85	17,4%	96,9%	0,60	5,00%	5,16%	0,26%	1,47%
BPB7D	\$ 88,00	16,9%	88,0%	1,51	5,00%	5,68%	1,73%	4,14%
BPC7D	\$ 80,75	16,6%	80,8%	2,36	5,00%	6,19%	2,47%	3,86%
BPD7D	\$ 79,95	16,5%	80,0%	2,57	5,00%	6,25%	1,37%	2,50%
BPY6D	\$ 86,86	13,9%	86,9%	0,89	3,00%	3,45%	1,24%	3,71%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación Directa	TEA	TNA	Crawling Mensual
17	30/09/2024	\$ 980,00	1,9%	49,7%	40,7%	3,42%
48	31/10/2024	\$ 1.016,50	5,7%	52,4%	43,3%	3,57%
77	29/11/2024	\$ 1.054,00	9,6%	54,4%	45,5%	3,68%
108	30/12/2024	\$ 1.096,50	14,0%	55,8%	47,4%	3,76%
140	31/01/2025	\$ 1.142,50	18,8%	56,7%	49,0%	3,81%
168	28/02/2025	\$ 1.181,50	22,8%	56,4%	49,6%	3,80%
199	31/03/2025	\$ 1.221,00	27,0%	54,9%	49,4%	3,72%
229	30/04/2025	\$ 1.262,00	31,2%	54,2%	49,8%	3,67%
259	30/05/2025	\$ 1.297,50	34,9%	52,5%	49,2%	3,58%
290	30/06/2025	\$ 1.328,00	38,1%	50,1%	47,9%	3,44%
321	31/07/2025	\$ 1.362,00	41,6%	48,5%	47,3%	3,35%
352	31/08/2025	\$ 1.400,00	45,6%	47,6%	47,3%	3,30%

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

