

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 963,33 CCL⁽¹⁾: \$ 1.234,14 MEP⁽²⁾: \$ 1.204,71 Brecha: 28,11% Devaluación⁽³⁾: 2,02% Inflación⁽⁴⁾: 4,20% Tasa LeFi: 40% Tasa Badlar: 39,13% Tasa Caución: 38,50%

(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	\$ 1.170,00	Duales (CER)	-0,4%	28,0%	0,37	135	-1,27%	1,56%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TZV4	\$ 955,30	Dólar linked	37,39%	56,15%	0,02	12	0,03%	-0,59%
TV25	\$ 1.009,00	Dólar linked	-7,76%	15,86%	0,57	194	-0,69%	-1,05%
TZV25	\$ 977,00	Dólar linked	-1,12%	0,00%	0,79	285	-2,29%	-2,88%
TZVD5	\$ 962,40	Dólar linked	-0,03%	0,00%	1,24	453	-3,76%	-5,65%
TZV26	\$ 900,00	Dólar linked	3,82%	0,00%	1,66	650	0,00%	-1,10%
TDE25	\$ 1.170,00	Duales (DL)	-41,31%	-27,99%	0,37	135	-1,27%	-1,57%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD
T4X4	\$ 569,00	CER	2,93%	0,07	0,02%	0,21%
TSX4	\$ 464,10	CER	0,54%	0,23	0,00%	0,43%
T2X5	\$ 563,80	CER	3,10%	0,39	0,02%	0,04%
TZXM5	\$ 122,65	CER	4,68%	0,53	0,12%	-0,49%
TZX25	\$ 176,60	CER	6,81%	0,78	-0,39%	-0,93%
TX25	\$ 944,90	CER	6,00%	1,13	0,52%	0,21%
TX26	\$ 1.884,50	CER	9,12%	1,08	-0,45%	-0,82%
TZXD5	\$ 151,10	CER	8,68%	1,24	-0,26%	-0,76%
TZXM6	\$ 117,50	CER	9,35%	1,53	0,38%	-2,89%
TZX26	\$ 192,25	CER	9,68%	1,78	-0,90%	-2,16%
TZXD6	\$ 135,75	CER	9,84%	2,24	-0,55%	-2,16%
TZXM7	\$ 102,50	CER	8,39%	2,53	0,49%	4,06%
TZX27	\$ 171,50	CER	10,54%	2,78	-1,41%	-2,00%
TZXD7	\$ 122,35	CER	10,18%	3,24	-0,49%	-1,92%
TZX28	\$ 157,10	CER	10,17%	3,78	-0,57%	-1,66%
TX28	\$ 1.594,50	CER	9,47%	1,95	0,09%	-1,70%
DICP	\$ 32.500,00	CER	11,65%	3,64	-1,74%	-2,43%
PARP	\$ 15.825,00	CER	10,92%	7,83	-1,86%	-2,91%
S3054	\$ 111,64	Fija	55,88%	0,03	0,11%	0,33%
S1404	\$ 127,87	Fija	57,35%	0,07	0,02%	0,19%
S11N4	\$ 102,28	Fija	56,01%	0,15	0,47%	-0,06%
S29N4	\$ 123,79	Fija	55,88%	0,19	-0,01%	0,03%
S13D4	\$ 114,30	Fija	56,32%	0,23	0,01%	0,09%
S17E5	\$ 113,24	Fija	56,43%	0,33	-0,05%	-0,10%
S31E5	\$ 146,45	Fija	56,58%	0,37	0,26%	0,31%
S14F5	\$ 100,75	Fija	57,86%	0,41	0,06%	0,30%
S28F5	\$ 129,05	Fija	58,42%	0,44	0,27%	0,44%
S14M5	\$ 100,79	Fija	58,79%	0,48	-0,01%	0,39%
S31M5	\$ 121,50	Fija	59,62%	0,53	0,16%	0,18%
S16A5	\$ 100,45	Fija	59,45%	0,57	0,17%	0,17%
S16V5	\$ 100,65	Fija	59,85%	0,65	0,05%	0,29%
S18I5	\$ 104,03	Fija	60,05%	0,75	0,22%	0,17%
S30I5	\$ 101,75	Fija	59,90%	0,78	0,59%	0,34%
S29G5	\$ 101,63	Fija	55,49%	0,94	0,08%	0,13%
S12S5	\$ 100,42	Fija	59,74%	0,98	0,07%	0,02%
TO26	\$ 74,58	Fija	43,25%	1,65	-0,55%	1,75%
PBA25	\$ 105,70	Badlar	56,87%	0,49	0,59%	0,34%
BDC28	\$ 100,50	Badlar	52,33%	1,87	0,08%	0,13%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS Y BOPREALES (Precios en USD)

Bono	Precio	TIR	Paridad	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	WTD
AL29	\$ 64,68	21,9%	63,6%	2,13	1,00%	1,55%	0,92%	2,02%
GD29	\$ 66,39	20,5%	65,3%	2,16	1,00%	1,51%	0,59%	0,59%
AL30	\$ 58,05	21,6%	57,3%	2,48	0,75%	1,29%	0,61%	2,65%
GD30	\$ 59,02	20,8%	59,0%	2,50	0,75%	1,27%	0,39%	1,55%
AL35	\$ 48,65	16,7%	45,5%	6,24	3,63%	7,45%	1,97%	3,07%
GD35	\$ 49,06	16,6%	49,1%	6,26	3,63%	7,39%	0,33%	2,53%
AE38	\$ 51,98	17,7%	52,0%	5,21	4,25%	8,18%	1,52%	3,46%
GD38	\$ 53,83	16,9%	53,8%	5,28	4,25%	7,90%	0,82%	3,32%
AL41	\$ 45,40	16,3%	42,9%	6,34	3,50%	7,71%	1,26%	4,37%
GD41	\$ 46,90	15,7%	46,9%	6,42	3,50%	7,46%	2,63%	3,30%
GD46	\$ 51,40	15,3%	51,4%	5,61	3,00%	5,84%	2,39%	0,19%
BPI5D	\$ 83,28	0,2%	83,3%	0,40	0,00%	0,00%	-0,26%	0,10%
BPA7D	\$ 97,20	16,9%	97,2%	0,59	5,00%	5,14%	-0,31%	0,36%
BPB7D	\$ 88,10	16,9%	88,1%	1,50	5,00%	5,68%	-1,01%	0,11%
BPC7D	\$ 82,30	15,7%	82,3%	2,36	5,00%	6,08%	0,39%	1,92%
BPD7D	\$ 81,80	15,5%	81,8%	2,56	5,00%	6,11%	0,49%	2,31%
BPY6D	\$ 87,48	13,4%	87,5%	0,88	3,00%	3,43%	-0,02%	0,71%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
12	30/09/2024	\$ 975,50	1,3%	46,5%	38,4%	3,23%
43	31/10/2024	\$ 1.007,50	4,6%	46,3%	38,9%	3,22%
72	29/11/2024	\$ 1.042,00	8,2%	48,9%	41,4%	3,37%
103	30/12/2024	\$ 1.083,00	12,4%	51,4%	44,0%	3,52%
135	31/01/2025	\$ 1.130,00	17,3%	53,9%	46,8%	3,66%
163	28/02/2025	\$ 1.170,50	21,5%	54,7%	48,2%	3,70%
194	31/03/2025	\$ 1.207,00	25,3%	52,8%	47,6%	3,60%
224	30/04/2025	\$ 1.249,00	29,7%	52,7%	48,3%	3,59%
254	30/05/2025	\$ 1.284,00	33,3%	51,1%	47,8%	3,50%
285	30/06/2025	\$ 1.318,00	36,8%	49,4%	47,2%	3,40%
316	31/07/2025	\$ 1.356,00	40,8%	48,4%	47,1%	3,35%
347	31/08/2025	\$ 1.397,00	45,0%	47,8%	47,4%	3,31%

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

