

PRINCIPALES VARIABLES

TC Oficial: \$ 349,98 CCL⁽¹⁾: \$ 760,83 MEP⁽²⁾: \$ 708,97 Brecha: 117,39% Devaluación⁽³⁾: -0,03%
⁽¹⁾ Promedio a través de ADRs. ⁽²⁾ Calculado con Lede Octubre. ⁽³⁾ Tasa promedio últimos 5 días (mensual). ⁽⁴⁾ Inflación mensual de julio.

DEUDA EN PESOS DEL TESORO NACIONAL

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
X18S3	\$ 195,92	CER	28,8%	110,3%	0,05	25	0,83%	1,22%
X18O3	\$ 126,45	CER	-2,4%	105,0%	0,14	55	0,88%	1,00%
X23N3	\$ 125,15	CER	-7,2%	126,0%	0,24	91	0,56%	0,93%
X18E4	\$ 105,90	CER	-8,9%	129,1%	0,39	147	1,93%	3,32%
S31O3	\$ 83,80	Fija	174%	110,3%	0,18	68	0,12%	1,24%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
TDS23	\$ 325,00	Diales (CER)	-56,4%	-18,3%	0,21	37	0,81%	-0,76%
TFD24	\$ 385,00	Diales (CER)	-39,2%	64,5%	0,79	188	2,12%	3,52%
TDA24	\$ 380,00	Diales (CER)	-30,8%	85,3%	0,76	250	3,88%	6,44%
TDG24	\$ 383,00	Diales (CER)	-21,4%	91,0%	1,06	372	4,59%	7,83%
TDE25	\$ 320,50	Diales (CER)	-3,5%	166,0%	1,43	526	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	TNA*	Duration	Días al Vto.	Diaria	WTD
D31O3	\$ 350,00	Dólar linked	0,0%	36,6%	0,18	68	-1,41%	0,00%
TV24	\$ 378,00	Dólar linked	-10,3%	120,4%	0,74	250	3,42%	7,39%
T2V4	\$ 378,00	Dólar linked	-6,2%	158,3%	1,11	403	1,07%	6,78%
TDS23	\$ 325,00	Diales (DL)	126,8%	123,8%	0,09	37	0,81%	-0,76%
TFD24	\$ 385,00	Diales (DL)	-17,2%	97,0%	0,50	188	2,12%	3,52%
TDA24	\$ 380,00	Diales (DL)	-11,5%	116,3%	0,67	250	3,88%	6,44%
TDG24	\$ 383,00	Diales (DL)	-8,6%	146,2%	1,01	372	4,59%	7,83%
TDE25	\$ 320,50	Diales (DL)	6,3%	242,4%	1,43	526	0,00%	0,00%

Ticker	Precio	Tipo	TIR	Duration	Diaria	WTD	
TX24	\$ 599,00	CER	-1,1%		0,58	0,35%	1,35%
T3X4	\$ 151,75	CER	-0,7%		0,62	1,44%	2,12%
T2X4	\$ 438,80	CER	2,6%		0,90	0,01%	0,99%
T4X4	\$ 146,00	CER	5,2%		1,08	0,59%	1,49%
T5X4	\$ 117,00	CER	6,1%		1,25	0,21%	0,43%
T2X5	\$ 143,50	CER	5,5%		1,40	1,41%	3,39%
TX25	\$ 229,00	CER	8,3%		2,11	-0,24%	-2,55%
TX26	\$ 495,00	CER	5,1%		2,05	1,54%	2,06%
TX28	\$ 474,50	CER	6,3%		2,62	0,72%	0,79%
DICP	\$ 9,729,00	CER	8,0%		4,26	1,56%	3,06%
PARP	\$ 4,971,00	CER	7,7%		8,42	-1,33%	-2,10%
TO23	\$ 94,20	Fija	171,3%		0,06	0,75%	1,62%
TO26	\$ 25,00	Fija	139,1%		0,69	0,00%	4,60%
BDC24	\$ 114,05	Badlar	201,0%		0,43	0,13%	-0,31%
PBA25	\$ 98,40	Badlar	236,0%		0,74	0,62%	2,77%
BDC28	\$ 99,50	Badlar	183,3%		1,07	1,27%	-1,44%

BONOS SOBERANOS ARGENTINOS (Precios en USD)

Bono	Precio	Paridad	TIR	Duration	Cupón	Current Yield	Diaria	MTD
AL29	\$ 32,91	33%	43,2%	2,84	1,00%	3,04%	0,49%	1,89%
GD29	\$ 38,00	38%	36,3%	2,93	1,00%	2,63%	4,68%	4,60%
AL30	\$ 32,80	33%	40,2%	2,91	0,75%	2,29%	0,15%	6,84%
GD30	\$ 38,73	39%	32,6%	3,07	0,75%	1,94%	0,28%	3,14%
AL35	\$ 33,00	32%	22,2%	6,27	4,13%	12,50%	-0,30%	3,13%
GD35	\$ 34,50	35%	21,3%	6,35	4,13%	11,96%	0,58%	1,47%
AE38	\$ 36,45	35%	23,5%	5,27	4,25%	11,66%	2,97%	5,96%
GD38	\$ 40,50	41%	21,1%	5,49	4,25%	10,49%	2,53%	1,25%
AL41	\$ 32,75	32%	20,7%	6,27	3,50%	10,69%	-0,76%	5,65%
GD41	\$ 36,50	37%	18,7%	6,54	3,50%	9,59%	-1,35%	4,29%
GD46	\$ 35,49	35%	21,0%	5,34	3,00%	8,45%	2,87%	3,68%

FUTUROS DE DÓLAR - ROFEX

Días	Vto	Precio	Devaluación	TEA	TNA	Crawling Mensual
7	31/8/2023	\$ 351,00	0,3%	16,5%	15,3%	1,28%
36	29/9/2023	\$ 369,00	5,4%	71,0%	55,1%	4,57%
68	31/10/2023	\$ 430,00	22,9%	202,0%	122,7%	9,65%
98	30/11/2023	\$ 528,00	50,9%	362,6%	189,5%	13,61%
127	29/12/2023	\$ 670,00	91,4%	546,5%	262,8%	16,83%
160	31/1/2024	\$ 727,00	107,7%	430,0%	245,8%	14,91%
189	29/2/2024	\$ 780,00	122,9%	370,1%	237,3%	13,77%
216	27/3/2024	\$ 831,00	137,4%	331,2%	232,3%	12,95%
250	30/4/2024	\$ 880,00	151,4%	284,3%	221,1%	11,87%
281	31/5/2024	\$ 930,00	165,7%	255,9%	215,3%	11,16%
309	28/6/2024	\$ 912,00	160,6%	210,0%	189,7%	9,89%
342	31/7/2024	\$ 970,00	177,2%	196,8%	189,1%	9,49%

* Supuestos de inflación: 12% agosto, 13% septiembre, 10% octubre y 8% de noviembre en adelante (mensuales).

Supuestos de Devaluación: 3% hasta octubre 2023 (DL y Diales) y 8,5% para instrumentos con vencimiento en 2024.

