

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Ticker	<u>Bonos CER</u>	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	101,7	10%	9%	1,10	91%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	92,3	10%	10%	1,67	86%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	83,9	11%	10%	2,59	79%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	78,5	10%	10%	3,49	74%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	602,0	10%	10%	1,76	87%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	324,5	10%	10%	1,05	92%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	211,0	11%	10%	2,45	85%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	190,0	9%	9%	4,20	80%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1379,0	12%	11%	5,71	72%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	575,0	11%	10%	10,08	39%
X04D0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 04-12-20	103,1	-4%	-4%	0,51	86%
X13N0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-11-20	104,5	-8%	-8%	0,45	90%
X1300	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-10-20	100,4	1%	1%	0,35	89%

Ticker	<u>Bonos Tasa Fija</u>	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
S30A0	Lete en Pesos - Vto 30-04-20	151,8	33%	30%	0,12	101%
S29Y0	Lete en Pesos - Vto 29-05-20	129,5	36%	32%	0,19	103%
S31L0	Lete en Pesos - Vto 31-07-20	150,5	43%	38%	0,29	98%
S01L0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 84 Dias	97,5	39%	34%	0,06	98%
S16J0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 90 Dias	99,5	17%	16%	0,03	99%
S31J0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 94 Dias	95,5	34%	30%	0,14	96%
SG280	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 116 Dias	93,0	36%	32%	0,20	93%
T021	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	72,5	60%	53%	0,90	70%
T023	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	57,0	47%	42%	1,94	56%
T026	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	43,5	48%	43%	2,38	43%

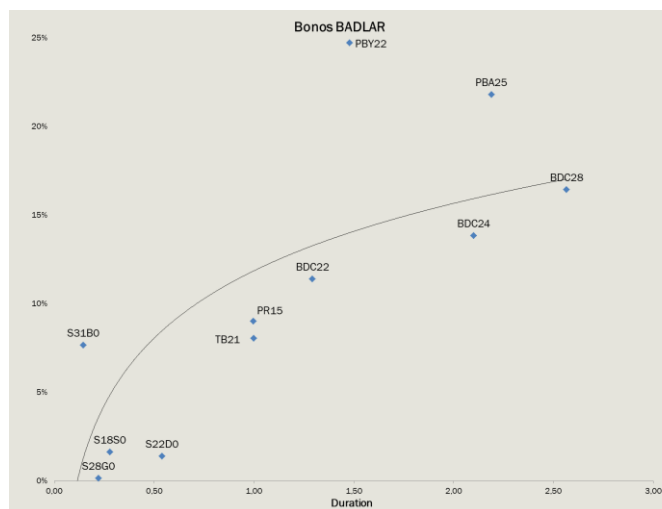
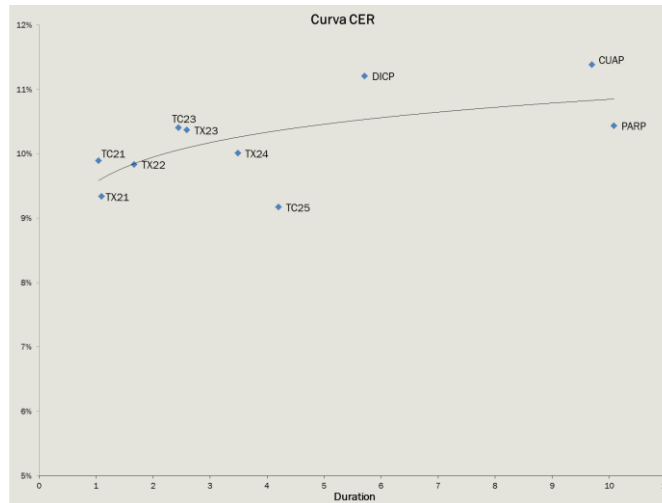
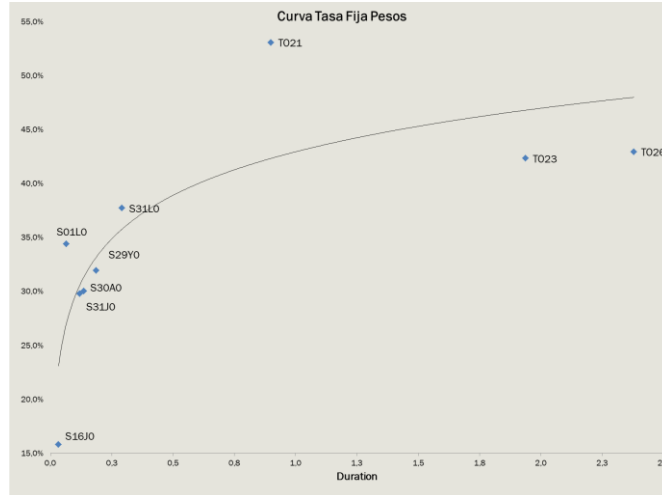
Ticker	<u>Bono Política Monetaria</u>	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TJ20	Bono Política Monetaria	104,6	74%	21%	0,03	97%

Ticker	<u>Bonos BADLAR Sob</u>	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	126,4	40%	9%	1,00	92%
AA22	Bono Consolidación + 200 Bp- Vto. 03-04-22	92,5	42%	10%	1,28	88%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	95,9	40%	8%	1,00	94%
S22J0	Lebad vto 22-06-2020	114,9	26%	-4%	0,04	100%
S31B0	Lebad vto 31-07-2020	105,6	40%	8%	0,15	99%
S28G0	Lebad vto 28-08-2020	110,2	31%	0%	0,22	100%
S18S0	Lebad vto 18-09-2020	111,5	32%	2%	0,28	100%
S22D0	Lebad vto 22-12-2020	112,0	32%	1%	0,54	100%

Ticker	<u>Bonos BADLAR SubSob</u>	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PBY22	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.83 % VTO 31-05-2022	75,8	61%	25%	1,48	75%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	71,0	56%	22%	2,19	68%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	96,0	42%	11%	1,29	92%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-202	85,0	48%	14%	2,10	80%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-202	73,5	49%	16%	2,57	80%

TNA Spread = Premium Over Rate

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA



CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Dólar TCCL			Dólar Mep		
\$ 114,41			\$ 108,27		
<u>Ticker</u>	TIR	Duration	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>	Interes Corrido
A020	2061,01%	0,03	USD 37,23	36,74	USD 1,33
AY24	163,82%	0,72	USD 33,30	39,64	USD 0,63
AA25	46,65%	2,46	USD 34,96	34,68	USD 0,80
DICA	35,51%	3,08	USD 50,68	34,88	USD 5,10
AA37	26,28%	4,37	USD 33,54	33,19	USD 1,06
PARA	17,44%	7,20	USD 33,21	32,98	USD 0,71
A2E2	88,21%	1,04	USD 42,39	41,53	USD 2,06
A2E7	29,35%	3,77	USD 41,08	40,07	USD 2,52
DICY	26,29%	3,80	USD 66,73	45,93	USD 5,10
PARY	14,72%	7,89	USD 40,07	39,79	USD 0,71
AC17	21,19%	4,59	USD 38,46	37,28	USD 3,17

<u>Dólar Mep</u>	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>
A020	38,70	38,19
DICA	53,15	36,58
AY24	35,19	41,91
A2E2	44,01	43,12

