

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

martes, 7 de julio de 2020

Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	110,1	4%	3%	1,04	97%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	103,3	4%	4%	1,63	95%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	96,3	6%	6%	2,57	89%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	88,9	7%	7%	3,47	82%
T2X1	Bonos del Tesoro Nacional Vto 17-04-2021	105,8	-6%	-6%	0,79	105%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	94,8	6%	6%	1,62	92%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	675,1	3%	3%	1,81	99%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	350,8	4%	4%	0,99	99%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	236,0	7%	7%	2,42	94%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	198,0	9%	9%	4,14	82%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1573,0	9%	9%	6,20	83%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	675,0	9%	9%	10,36	45%
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	925,0	10%	9%	11,13	45%
X04D0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 04-12-20	105,0	-10%	-10%	0,43	87%
X13N0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-11-20	107,6	-18%	-18%	0,38	92%
X1300	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-10-20	102,0	-5%	-6%	0,27	90%

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
S30A0	Lete en Pesos - Vto 30-04-20	156,0	27%	25%	0,05	101%
S29Y0	Lete en Pesos - Vto 29-05-20	133,4	33%	30%	0,11	102%
S31L0	Lete en Pesos - Vto 31-07-20	157,5	36%	32%	0,23	100%
S2900	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 136 Dias	91,0	35%	31%	0,27	91%
S13L0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 61 Dias	99,7	13%	12%	0,02	100%
S13G0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 92 Dias	97,0	33%	30%	0,09	97%
S11S0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 90 Dias	94,6	35%	31%	0,16	95%
S31J0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 94 Dias	97,9	35%	31%	0,06	98%
SG280	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 116 Dias	95,7	35%	31%	0,13	96%
T021	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	82,0	49%	44%	0,88	78%
T023	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	57,5	48%	44%	1,84	55%
T026	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	41,7	52%	46%	2,17	40%

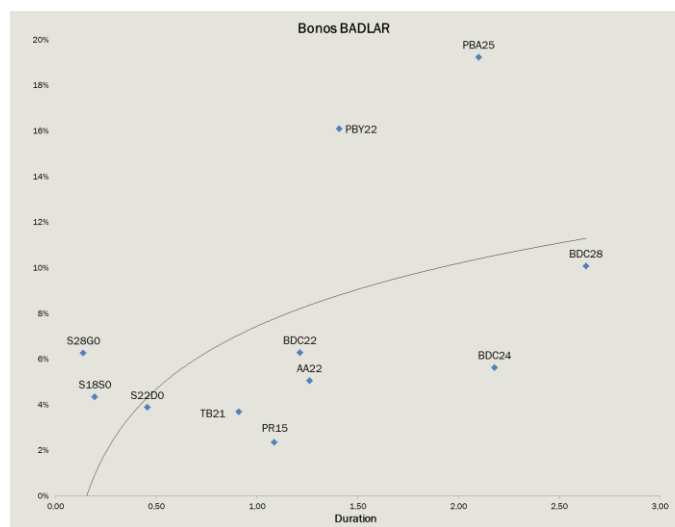
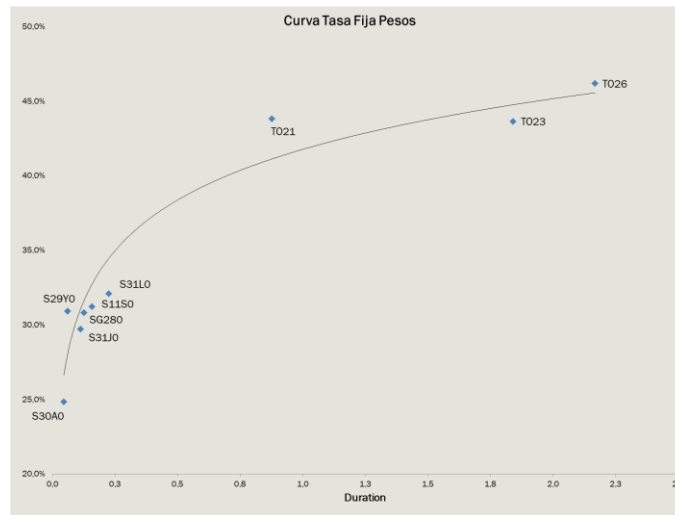
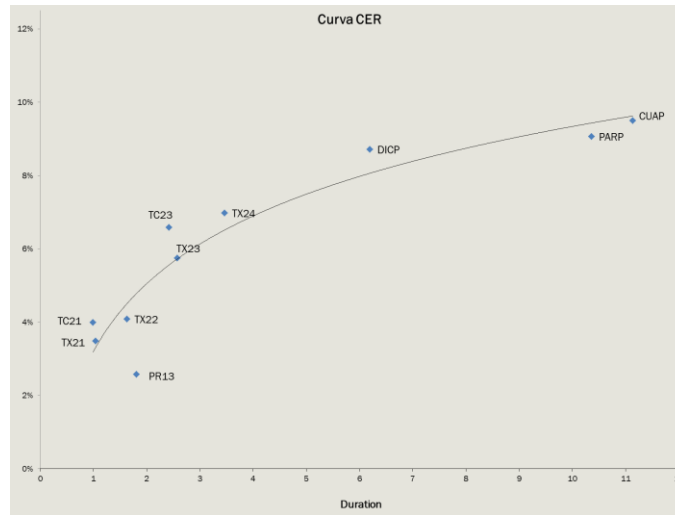
Ticker	Bonos BADLAR Sob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	117,8	36%	2%	1,08	98%
AA22	Bono Consolidación + 200 Bp- Vto. 03-04-22	96,4	34%	5%	1,26	96%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	102,6	38%	4%	0,91	98%
S31B0	Lebad vto 31-07-2020	110,0	22%	-9%	0,06	101%
S28G0	Lebad vto 28-08-2020	112,0	41%	6%	0,14	99%
S18S0	Lebad vto 18-09-2020	113,8	38%	4%	0,19	99%
S22D0	Lebad vto 22-12-2020	113,5	38%	4%	0,45	98%

Ticker	Bonos BADLAR SubSob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PBY22	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.83 % VTO 31-05-2022	88,4	52%	16%	1,41	85%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	78,5	56%	19%	2,10	73%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	105,0	38%	6%	1,21	98%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-2022	96,0	42%	6%	2,18	95%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-2022	89,0	45%	10%	2,63	95%

TNA Spread = Premium Over Rate



CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA



CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Dólar TCCL			Dólar Mep		
\$ 109,48			\$ 108,57		
<u>Ticker</u>	TIR	Duration	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>	Interes Corrido
A020	3089,51%	0,02	USD 44,28	42,53	USD 2,04
AY24	132,56%	0,79	USD 38,50	44,46	USD 1,28
AA25	40,76%	2,50	USD 40,78	39,66	USD 1,31
DICA	25,38%	4,16	USD 64,36	45,10	USD 0,32
AA37	21,85%	5,12	USD 41,20	39,72	USD 1,74
PARA	15,16%	7,69	USD 39,31	38,91	USD 1,04
A2E2	90,51%	0,97	USD 44,05	42,95	USD 2,56
A2E7	28,58%	3,74	USD 43,09	41,78	USD 3,13
DICY	22,86%	4,38	USD 70,85	49,65	USD 0,32
PARY	14,13%	7,96	USD 42,35	41,91	USD 1,04
AC17	18,07%	5,80	USD 41,34	40,49	USD 0,24

<u>Dólar Mep</u>	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>
A020	44,26	42,51
DICA	64,45	45,17
AY24	38,82	44,68
A2E2	45,30	44,17

