



CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Jueves, 30 de julio de 2020

Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	114,9	1%	1%	0,99	100%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	110,0	1%	1%	1,59	100%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	104,5	3%	3%	2,54	95%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	97,5	5%	5%	3,44	89%
T2X1	Bonos del Tesoro Nacional Vto 17-04-2021	107,9	-9%	-9%	0,73	108%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	101,9	3%	3%	1,59	97%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	667,0	3%	3%	1,78	97%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	364,0	1%	1%	0,96	101%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	272,5	2%	2%	2,43	106%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	244,0	4%	4%	4,22	99%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1849,0	7%	7%	6,44	95%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	809,0	8%	8%	10,69	53%
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	1080,0	9%	8%	11,75	51%
X04D0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 04-12-20	105,0	-12%	-12%	0,37	89%
X13N0	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-11-20	108,0	-23%	-24%	0,31	95%
X1300	LETRAS DEL TESORO EN PESOS CER - 13-10-20	103,7	-15%	-16%	0,21	95%

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
S29Y0	Lete en Pesos - Vto 29-05-20	136,4	27%	25%	0,06	101%
S31L0	Lete en Pesos - Vto 31-07-20	139,2	26%	24%	0,21	102%
S2900	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 136 Dias	96,5	15%	14%	0,23	97%
S13G0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 92 Dias	98,7	37%	33%	0,03	99%
S11S0	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 90 Dias	97,4	25%	23%	0,11	97%
SG280	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 116 Dias	98,3	23%	21%	0,07	98%
T021	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	88,5	41%	38%	0,85	83%
T023	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	60,0	47%	43%	1,81	57%
T026	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	44,0	50%	45%	2,17	42%

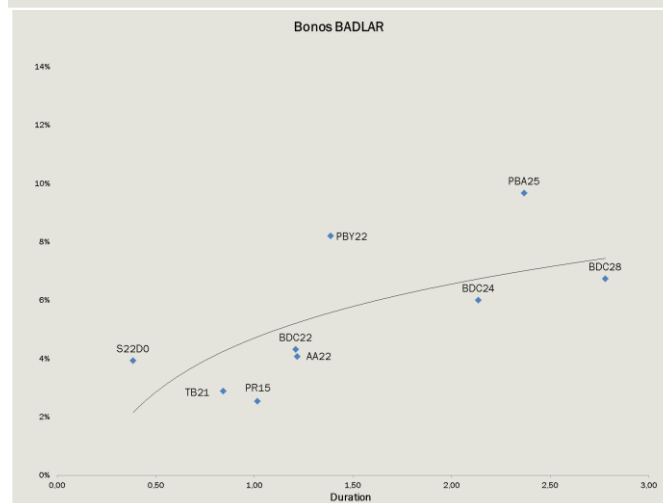
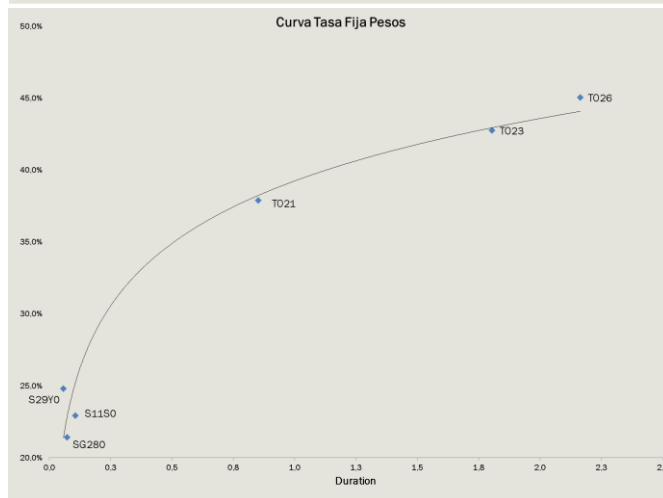
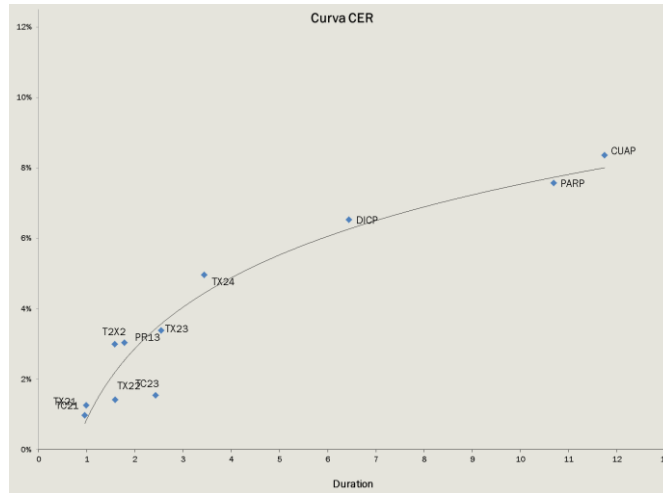
Ticker	Bonos BADLAR Sob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	120,1	36%	3%	1,02	98%
AA22	Bono Consolidación + 200 Bp- Vto. 03-04-22	98,8	33%	4%	1,22	96%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	105,5	36%	3%	0,84	99%
S28G0	Lebad vto 28-08-2020	115,7	23%	-8%	0,07	100%
S18S0	Lebad vto 18-09-2020	118,0	24%	-8%	0,13	101%
S22D0	Lebad vto 22-12-2020	116,0	38%	4%	0,39	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	100,2	41%	8%	1,39	95%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	89,2	45%	10%	2,37	87%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	101,8	38%	4%	1,21	101%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-2022	97,5	42%	6%	2,14	95%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-2022	98,8	40%	7%	2,78	95%

TNA Spread = Premium Over Rate



CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA





CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA

Dólar TCCCL			Dólar Mep		
\$ 121,60			\$ 119,47		
<u>Ticker</u>	TIR	Duration	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>	Interes Corrido
A020	9129,72%	0,00	USD 45,89	43,85	USD 2,56
AY24	173,17%	0,61	USD 38,14	43,64	USD 1,74
AA25	40,49%	2,45	USD 41,94	40,65	USD 1,68
DICA	24,36%	4,19	USD 67,83	47,29	USD 1,06
AA37	21,75%	5,08	USD 41,94	40,25	USD 2,22
PARA	14,94%	7,68	USD 40,29	39,78	USD 1,28
A2E2	91,60%	0,99	USD 42,76	42,71	USD 0,11
A2E7	28,91%	3,98	USD 39,88	39,83	USD 0,13
DICY	23,87%	4,23	USD 69,08	48,16	USD 1,06
PARY	14,66%	7,76	USD 41,12	40,60	USD 1,28
AC17	18,38%	5,65	USD 41,12	40,10	USD 0,69

<u>Dólar Mep</u>	<u>Precio</u>	<u>Paridad</u>
A020	46,57	44,51
DICA	68,81	47,98
AY24	38,82	44,44
A2E2	43,65	43,60

