

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA
24 de Septiembre 2020



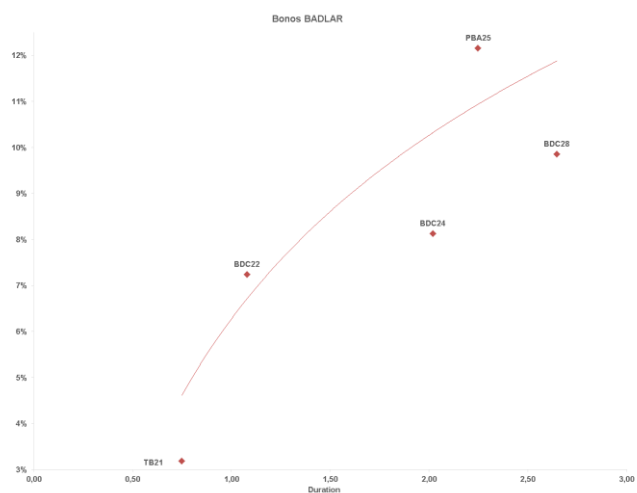
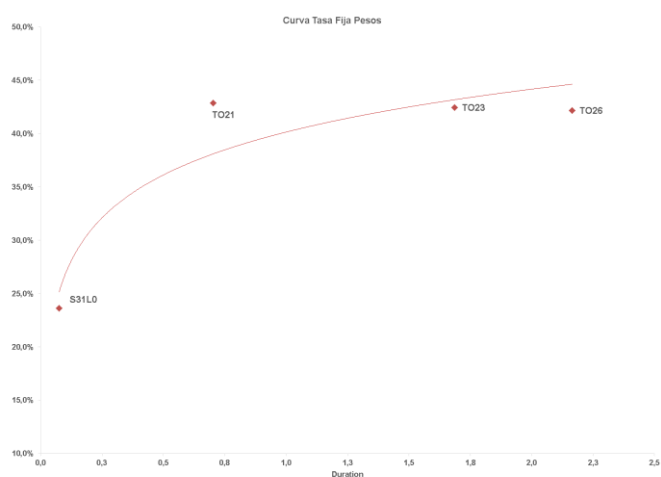
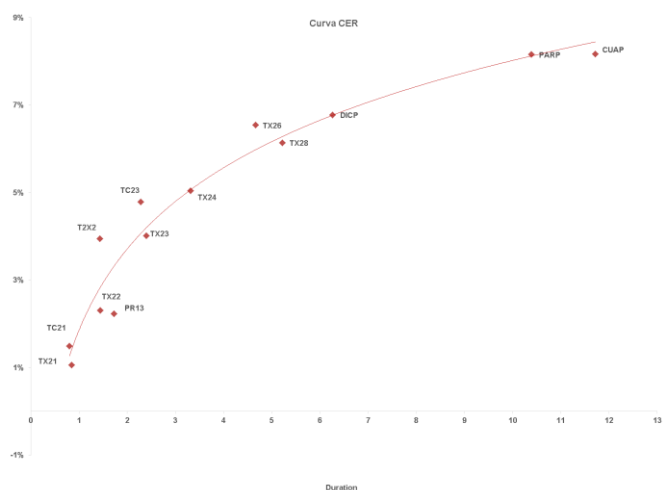
Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	119,0	1%	1%	0,85	100%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	112,2	2%	2%	1,44	98%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	106,5	4%	4%	2,40	94%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	100,8	5%	5%	3,32	89%
T2X1	Bonos del Tesoro Nacional Vto 17-04-2021	112,8	-5%	-5%	0,56	102%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	104,3	4%	4%	1,43	96%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	670,0	2%	2%	1,73	98%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	376,5	1%	1%	0,80	101%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	258,0	5%	5%	2,28	98%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	242,0	6%	5%	4,03	94%
TX26	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2026	82,3	7%	6%	4,67	81%
TX28	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2028	83,0	6%	6%	5,22	82%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1907,0	7%	7%	6,26	94%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	798,8	8%	8%	10,39	50%
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	1161,0	8%	8%	11,72	52%

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
S31L0	Lete en Pesos - Vto 14-09-20	144,3	26%	24%	0,08	101%
S2900	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 29-10-20	98,1	21%	20%	0,09	98%
TO21	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	90,0	47%	43%	0,70	83%
TO23	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	64,0	47%	42%	1,69	60%
TO26	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	49,8	47%	42%	2,17	47%

Ticker	Bonos BADLAR Sob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	126,1	36%	2%	0,86	98%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	103,3	37%	3%	0,75	99%
S22D0	Lebad vto 22-12-2020	121,5	40%	5%	0,23	99%

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	91,1	50%	14%	1,30	89%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	91,0	46%	12%	2,25	85%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	104,5	38%	7%	1,08	98%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-2024	99,8	43%	8%	2,02	92%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-2028	89,8	45%	9%	2,65	92%

TNA Spread = Premium Over Rate





Dólar Mep \$ 131,80

Dólar CCL \$ 142,00

Ticker	TIR	Duration	Precio
AL29	14,4%	5,22	USD 47,13
AL30	13,5%	5,60	USD 45,79
AL35	13,0%	8,56	USD 41,31
AE38	14,1%	7,34	USD 43,40
AL41	13,3%	8,21	USD 39,83
GD29	14,0%	5,24	USD 48,18
GD30	13,5%	5,60	USD 45,82
GD35	12,7%	8,61	USD 42,30
GD38	13,4%	7,48	USD 45,75
GD41	12,6%	8,37	USD 41,92
GD46	13,0%	8,11	USD 40,59

Bonos Soberanos en Dólares

