

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA
21 de Enero 2020



Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	136,3	-1,3%	-1,3%	0,53	101%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	130,1	0,4%	0,4%	1,13	101%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	124,8	2,8%	2,8%	2,10	97%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	116,0	4,9%	4,9%	3,01	90%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	122,1	1,7%	1,7%	1,13	100%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	689,0	1,8%	1,8%	1,58	99%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	427,0	-1,3%	-1,3%	0,49	104%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	312,0	2,0%	2,0%	2,00	104%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	265,0	6,2%	6,1%	3,78	92%
TX26	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2026	92,5	7,2%	7,1%	4,51	79%
TX28	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2028	88,9	8,2%	8,1%	4,98	74%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	1985,0	8,1%	7,9%	5,98	88%
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	760,5	10,2%	9,9%	9,83	42%
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	1050,0	10,3%	10,1%	10,69	42%

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad
TO21	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	91,7	48%	43%	0,52	87%
TO23	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	55,0	58%	51%	1,53	53%
TO26	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	38,8	59%	52%	1,92	37%

Ticker	Bonos BADLAR Sob	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	91,4	50%	9%	0,84	93%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	106,3	44%	4%	0,47	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	98,0	50%	12%	1,08	93%
PBA25	Bono de la Prov de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 12-04-2025	80,5	59%	16%	2,03	79%
BDC22	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 5 % VTO 23-01-2022	99,0	47%	6%	0,87	90%
BDC24	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.25 % VTO 29-03-2024	90,0	55%	11%	1,84	88%
BDC28	Bono de la Ciudad de BS AS - Badlar + 3.75 % VTO 22-02-2028	91,0	51%	11%	2,37	88%

TNA Spread = Premium Over Rate



Dólar Mep \$ 145,96

Dólar CCL \$ 148,88

Ticker	TIR	Duration	Precio
AL29	18,8%	4,65	USD 39,90
AL30	17,5%	5,02	USD 38,69
AL35	16,0%	7,74	USD 33,70
AE38	17,5%	6,47	USD 36,01
AL41	16,1%	7,24	USD 33,40
GD29	17,2%	4,75	USD 43,05
GD30	16,9%	5,06	USD 39,90
GD35	15,4%	7,85	USD 35,51
GD38	15,8%	6,77	USD 40,50
GD41	14,6%	7,60	USD 37,50
GD46	15,2%	7,26	USD 36,00

