

CIERRE DE INSTRUMENTOS DE RENTA FIJA
23 de Febrero 2020



Ticker	Bonos CER	Px	TIR	TNA	MD	Paridad	Valor Tecnico	Vencimiento	Tasa Cupon
TX21	Bonos del Tesoro Nacional Vto 05-08-2021	143,8	-6,5%	-6,6%	0,46	103%	138,9	05-ago-21	1,0%
TX22	Bonos del Tesoro Nacional Vto 18-03-2022	138,9	-2,3%	-2,4%	1,06	104%	133,8	18-mar-22	1,2%
TX23	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2023	134,0	1,1%	1,1%	2,03	101%	133,2	25-mar-23	1,4%
TX24	Bonos del Tesoro Nacional Vto 25-03-2024	125,6	3,6%	3,5%	2,94	94%	133,3	25-mar-24	1,5%
T2X1	Bonos del Tesoro Nacional Vto 17-04-2021	133,2	-6,3%	-6,4%	0,15	101%	131,9	17-abr-21	1,1%
T2X2	Bonos del Tesoro Nacional Vto 20-09-2022	131,8	-2,1%	-2,1%	1,06	104%	127,2	20-mar-22	1,3%
PR13	Bono de Consolidación Serie 6 vto. 15-03-24	720,0	-0,5%	-0,5%	1,56	102%	708,0	15-mar-24	2,0%
TC21	Boncer - vto. 22-07-2021	451,5	-6,4%	-6,5%	0,42	104%	435,2	22-jul-21	2,5%
TC23	Boncer - vto. 06-03-2023	328,0	1,3%	1,3%	1,92	105%	311,7	06-mar-23	4,0%
TC25p	Boncer - vto. 27-04-2025	293,0	4,6%	4,5%	3,74	98%	298,7	27-abr-25	4,0%
TX26	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2026	101,2	0,9%	0,9%	4,46	105%	119,6	09-nov-26	2,0%
TX28	Bonos del Tesoro Nacional Vto 09-11-2028	101,0	5,8%	5,7%	4,85	84%	119,8	09-nov-28	2,3%
DICP	Bono Discount - vto. 31-12-2033	2079,0	8,0%	7,9%	5,91	88%	2370,3	31-dic-33	Step Up
PARP	Bono PAR - vto. 31-12-2038	817,0	9,9%	9,6%	9,82	43%	1889,5	31-dic-38	Step Up
CUAP	Bono Cuasipar - vto. 31-12-2045	1175,0	9,7%	9,4%	10,96	45%	2618,3	31-dic-45	3,3%

Ticker	Letras de Descuento en Pesos	Px	TIR	TNA	MD	Paridad	Vencimiento
S30A1	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 30-04-21	94,3	36,8%	32,6%	0,16	94%	30-abr-21
S30J1	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 30-06-21	88,5	40,9%	35,8%	0,30	89%	30-jun-21
S26F1	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 26-02-21	99,9	5,6%	5,5%	0,02	100%	26-feb-21
SM311	Letra del Tesoro en Pesos a Descuento - 31-03-21	97,1	31,7%	28,5%	0,09	97%	31-mar-21

Ticker	Bonos Tasa Fija	Px	TIR	TNA	MD	Paridad	Valor Tecnico	Vencimiento	Tasa Cupon
TO21	Bono del Tesoro Nacional 18,2% vto. 03-10-21	97,2	41,5%	37,9%	0,46	91%	107,2	03-oct-21	18,2%
TO23	Bono del Tesoro Nacional 16% vto. 17-10-23	68,3	44,1%	40,1%	1,62	65%	105,7	17-oct-23	16,0%
TO26	Bono del Tesoro Nacional 15,5% vto. 17-10-26	48,2	47,9%	43,2%	2,17	46%	105,5	17-oct-26	15,5%

Ticker	Bonos LEPASE	Px	TIR	TNA	MD	Paridad	Vencimiento
S31M1	Letras del Tesoro a T.Variable + 3,2% VTO 31-03-21	112,2	34,4%	30,6%	0,09	100%	31-mar-21
SA301	Letras del Tesoro a T.Variable + 1,5% VTO 30-04-21	103,1	37,7%	33,3%	0,16	100%	30-abr-21

Ticker	Bonos BADLAR Soberanos	Px	TIR	TNA Spread	MD	Paridad	Valor Tecnico	Vencimiento	Valor Residual
PR15	Bono Consolidación Serie 8 - Vto. 04-10-22	97,3	44,9%	4,7%	0,76	97%	100,6	04-oct-22	55,0%
TB21	Bono del Tesoro Nacional vto 05-08-2021	101,0	42,8%	3,2%	0,42	99%	101,9	05-ago-21	100,0%



Dólar Mep \$ 139,86

Dólar CCL \$ 143,47

Ticker	TIR	Duration	Precio
AL29	20,4%	4,48	USD 37,69
AL30	19,4%	4,82	USD 35,75
AL35	16,8%	7,53	USD 32,11
AE38	18,6%	6,22	USD 34,10
AL41	16,6%	7,06	USD 32,74
GD29	18,1%	4,62	USD 41,80
GD30	18,3%	4,90	USD 37,79
GD35	16,5%	7,59	USD 33,00
GD38	16,6%	6,56	USD 38,90
GD41	15,4%	7,34	USD 35,75
GD46	16,4%	6,90	USD 33,50

