

| Especie | Fecha de Emisión | Fecha de Pago | Plazo al Vto (Días) | Monto al Vto | Cierre (PPT, T+2) | | Rendimiento del Período | TIR (*) | DM (días) | Rendimientos / Plazo Fijo (**) |
|---------|------------------|---------------|---------------------|--------------|-------------------|--------------|-------------------------|----------|-----------|--------------------------------|
| | | | | | Fecha | \$ c/ VN 100 | | | | |
| S01LO | 1-Abr-20 | 1-Jul-20 | 1 | 100 | 26-Jun-20 | 99,930 | 0,07% | 29,12% | 1 | -540 pbs |
| S31JO | 28-Abr-20 | 31-Jul-20 | 31 | 100 | 26-Jun-20 | 97,750 | 2,30% | 30,73% | 24 | -379 pbs |
| SG280 | 4-May-20 | 28-Ago-20 | 59 | 100 | 04-Jun-20 | 99,500 | No Operó | No Operó | - | No Operó |
| S13LO | 13-May-20 | 13-Jul-20 | 13 | 100 | 26-Jun-20 | 99,150 | 0,86% | 27,08% | 10 | -744 pbs |
| S13GO | 13-May-20 | 13-Ago-20 | 44 | 100 | 26-Jun-20 | 96,800 | 3,31% | 30,97% | 34 | -355 pbs |

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (***) Fecha: 25-Jun-20 Valor 30,02%

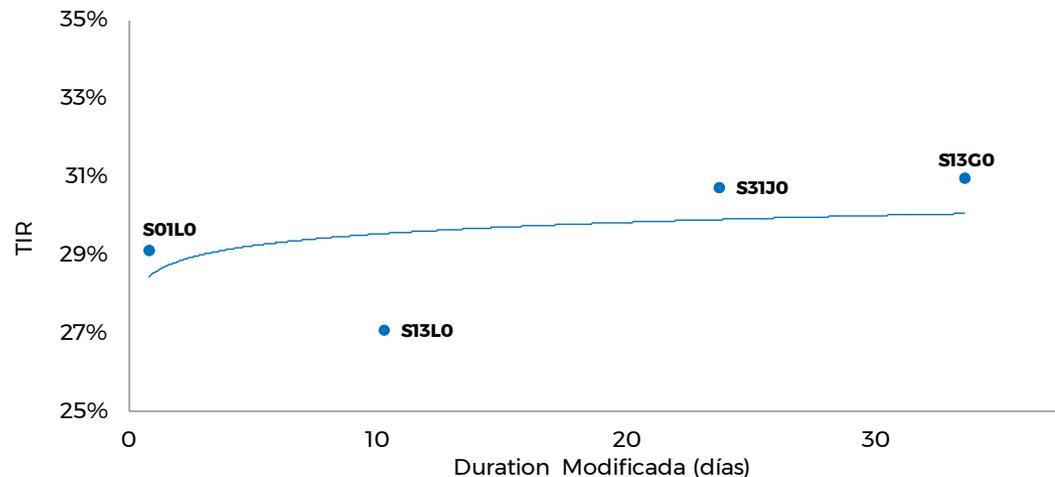
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

Notas:

(*) Efectiva Anual

(**) TIR - Tasa PF efectiva anual

(***) Según Com BCRA A 7027



RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 26-06-20

LETRAS DEL TESORO A TASA BADLAR

| Especie | Fecha de Emisión | Fecha de Pago | Plazo al Vto (días) | Tasa Estimada (*) | Margen s/ BADLAR | Pago Estimado | Valor Técnico c/ VN 100 | Cierre (PPT, T+2) | | Rendimiento del Período | TIR (**) | DM (días) | Rendimiento s/ BADLAR (***) |
|---------|------------------|---------------|---------------------|-------------------|------------------|---------------|-------------------------|-------------------|--------------|-------------------------|----------|-----------|-----------------------------|
| | | | | | | | | Fecha | \$ c/ VN 100 | | | | |
| S31BO | 6-Mar-20 | 31-Jul-20 | 31 | 28,29% | 175 pbs | 111,361 | 108,96 | 26-Jun-20 | 109,000 | 2,17% | 28,70% | 24,09 | -544 pbs |
| S28GO | 29-Ene-20 | 28-Ago-20 | 59 | 30,42% | 200 pbs | 117,62 | 112,72 | 08-Jun-20 | 110,750 | No Operó | No Operó | - | No Operó |
| S18SO | 22-Ene-20 | 18-Sep-20 | 80 | 32,82% | 400 pbs | 121,52 | 114,35 | 24-Jun-20 | 114,000 | No Operó | No Operó | - | No Operó |
| S22DO | 22-Ene-20 | 22-Dic-20 | 175 | 34,69% | 550 pbs | 131,76 | 115,17 | 26-Jun-20 | 113,000 | 16,60% | 37,75% | 127,04 | 362 pbs |

TASA BADLAR: Fecha: 24-Jun-20 Valor 29,75%

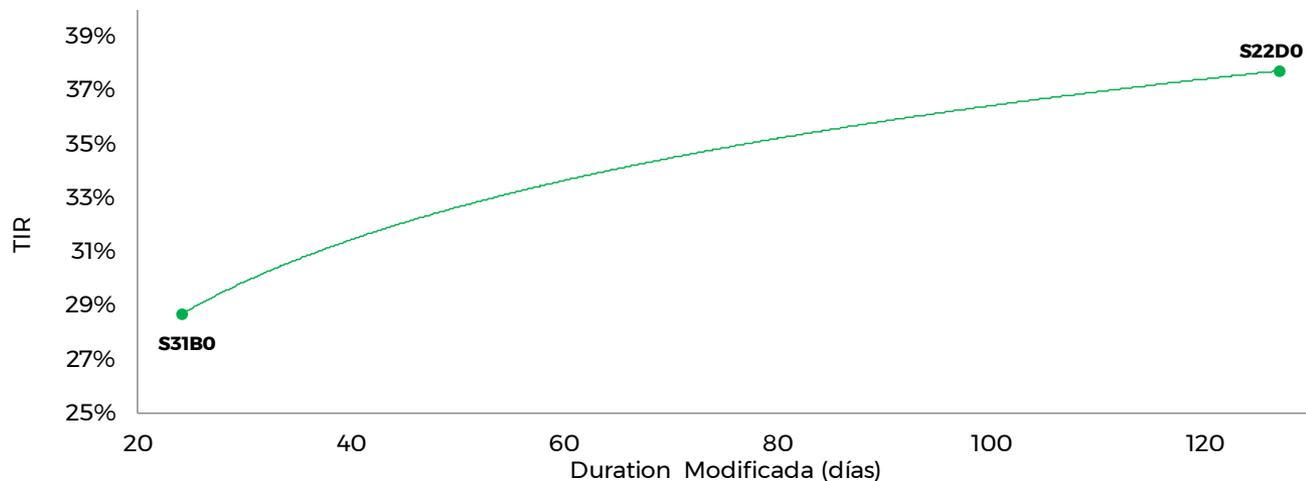
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

Notas:

(*) Tasa Badlar estimada según condiciones de emisión más margen diferencial

(**) Efectiva Anual

(***) TIR - Tasa Badlar efectiva Anual



Letras del tesoro en dólares

| Especie | Fecha de Emisión | Vto. Original | Nuevo Vto. s/ Dec. 346/2020 | Monto al Vto. Original c/ VN0 100 | Monto Residual c/ VN0 100 | Fecha Próximo Pago | Monto Próximo Pago c/ VN0 100 | Cierre (PPT, T+2) | | TIR | DM (días) |
|---------|------------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------------|---------------------------|--------------------|-------------------------------|-------------------|--------------|----------|-----------|
| | | | | | | | | Fecha | \$ c/ VN 100 | | |
| U2G9D | 25-Ene-19 | 30-Ago-19 | 31-Dic-20 | 100 | 60 | 31-Dic-20 | 60 | 2-Jun-20 | 22,500 | No operó | |
| US9D | 8-Feb-19 | 13-Sep-19 | 31-Dic-20 | 100 | 60 | 31-Dic-20 | 60 | 26-Jun-20 | 23,000 | 569,97% | 27 |
| U2S9D | 22-Feb-19 | 27-Sep-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 4-Jun-20 | 31,500 | No operó | |
| UO9D | 15-Mar-19 | 11-Oct-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 24-Jun-20 | 32,400 | No operó | |
| U2O9D | 29-Mar-19 | 25-Oct-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 25-Jun-20 | 34,000 | No operó | |
| UN9D | 12-Abr-19 | 15-Nov-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 26-Jun-20 | 33,000 | 553,30% | 28 |
| U2N9D | 26-Abr-19 | 29-Nov-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 25-Jun-20 | 32,000 | No operó | |
| UD9D | 24-May-19 | 20-Dic-19 | 31-Dic-20 | 100 | 85 | 31-Dic-20 | 85 | 16-Jun-20 | 38,000 | No operó | |
| UE0D | 14-Jun-19 | 17-Ene-20 | 31-Dic-20 | 100 | 100 | 31-Dic-20 | 100 | 6-Feb-20 | 50,000 | No operó | |
| U2E0D | 28-Jun-19 | 31-Ene-20 | 31-Dic-20 | 100 | 100 | 31-Dic-20 | 100 | 2-Jun-20 | 36,500 | No operó | |
| UF0D | 19-Jul-19 | 14-Feb-20 | 31-Dic-20 | 100 | 100 | 31-Dic-20 | 100 | 31-Ene-20 | 63,000 | No operó | |
| U2F0D | 26-Jul-19 | 28-Feb-20 | 31-Dic-20 | 100 | 100 | 31-Dic-20 | 100 | 6-Mar-20 | 58,200 | No operó | |

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

Letras del tesoro capitalizables en pesos

| Especie | Fecha de Emisión | Vto. Original | Nuevo Vto. s/ Dec. 596/19 | Tasa Capitalizable | Monto Residual c/ VN 100 s/ Dec. 596/19 | Fecha Próximo Pago | Monto Próximo Pago | Valor Técnico c/ VN 100 | Cierre (PPT, T+2) | | TIR | DM (días) |
|---------|------------------|---------------|---------------------------|--------------------|---|--------------------|--------------------|-------------------------|-------------------|--------------|--------|-----------|
| | | | | | | | | | Fecha | \$ c/ VN 100 | | |
| S30A0 | 30-Oct-18 | 30-Abr-20 | 29-Jul-20 | 3,00% | 157,969 | 29-Jul-20 | 157,969 | 152,916 | 26-Jun-20 | 154,750 | 29,58% | 22 |
| S29Y0 | 19-Jul-19 | 29-May-20 | 27-Ago-20 | 3,75% | 138,525 | 27-Ago-20 | 138,525 | 128,534 | 26-Jun-20 | 132,250 | 33,87% | 43 |
| S31L0 | 31-Ene-19 | 31-Jul-20 | 29-Oct-20 | 2,65% | 171,107 | 31-Jul-20 | 24,019 | 155,449 | 26-Jun-20 | 156,000 | 36,69% | 79 |