

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				
S31JO	28-Abr-20	31-Jul-20	25	100	02-Jul-20	98,160	1,87%	31,15%	19	-338 pbs
S13LO	13-May-20	13-Jul-20	7	100	02-Jul-20	99,480	0,52%	31,24%	5	-328 pbs
S13GO	13-May-20	13-Ago-20	38	100	01-Jul-20	97,050	No Operó	No Operó	-	No Operó

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (***) Fecha: 1-Jul-20 Valor 30,02%

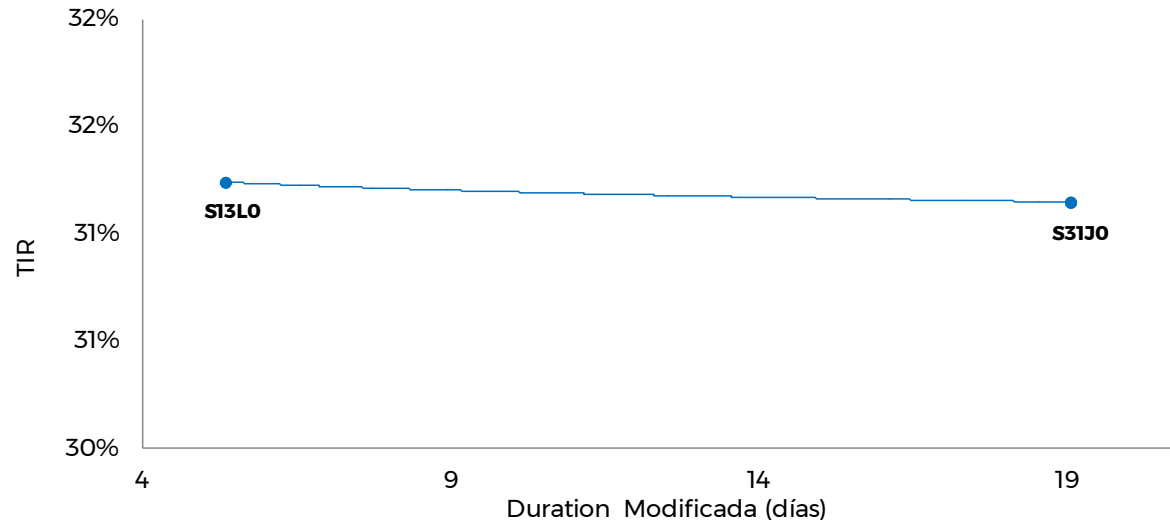
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

Notas:

(*) Efectiva Anual

(**) TIR - Tasa PF efectiva anual

(***) Según Com BCRA A 7027



RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 02-07-20

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	25	28,27%	175 pbs	111,354	109,42	01-Jul-20	109,300	No Operó	No Operó	-	No Operó
S28GO	29-Ene-20	28-Ago-20	53	30,40%	200 pbs	117,61	113,21	08-Jun-20	110,750	No Operó	No Operó	-	No Operó
S18SO	22-Ene-20	18-Sep-20	74	32,80%	400 pbs	121,51	114,88	24-Jun-20	114,000	No Operó	No Operó	-	No Operó
S22DO	22-Ene-20	22-Dic-20	169	34,69%	550 pbs	131,75	115,73	11-Jun-20	107,100	No Operó	No Operó	-	No Operó

TASA BADLAR: Fecha: 30-Jun-20 Valor 29,69%

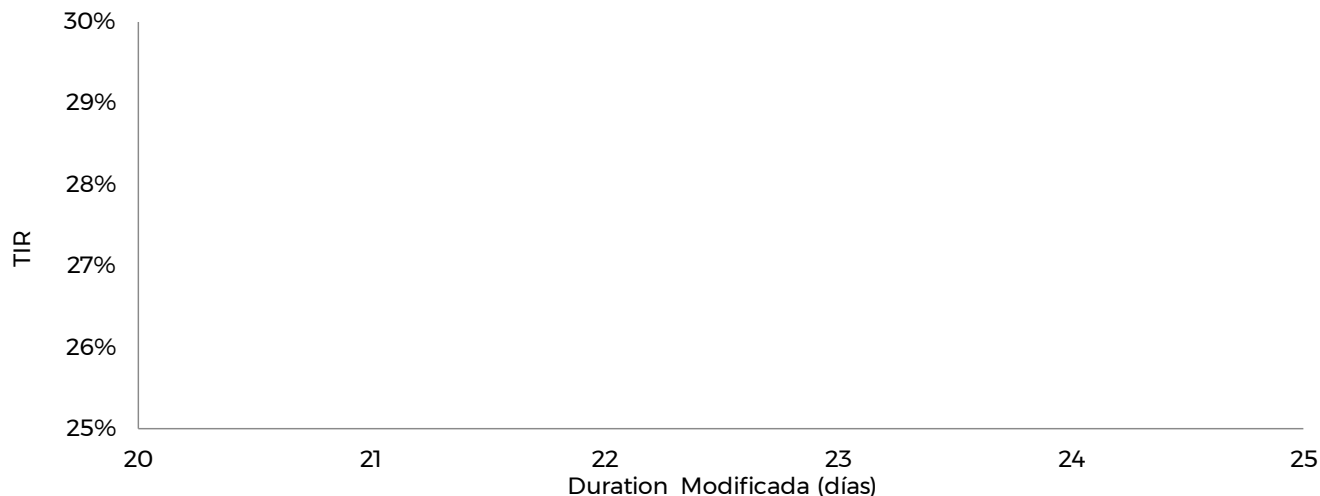
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

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	2-Jul-20	23,000	614,34%	25
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	30-Jun-20	33,000	No operó	
U2O9D	29-Mar-19	25-Oct-19	31-Dic-20	100	85	31-Dic-20	85	2-Jul-20	32,000	641,29%	24
UN9D	12-Abr-19	15-Nov-19	31-Dic-20	100	85	31-Dic-20	85	2-Jul-20	33,000	595,96%	26
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	153,822	2-Jul-20	155,300	31,05%	18
S29Y0	19-Jul-19	29-May-20	27-Ago-20	3,75%	138,525	27-Ago-20	138,525	129,484	2-Jul-20	133,000	33,07%	39
S31L0	31-Ene-19	31-Jul-20	29-Oct-20	2,65%	171,107	31-Jul-20	24,019	156,264	2-Jul-20	157,200	35,46%	75