

RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 18-11-20

LETRAS DEL TESORO A DESCUENTO

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/VN100				
S30NO	13-Jul-20	30-Nov-20	10	100	18-Nov-20	99.000	1.01%	44.32%	7	448 pbs
S30DO	1-Jul-20	30-Dic-20	40	100	18-Nov-20	96.150	4.00%	43.08%	28	324 pbs
S29EI	1-Jul-20	29-Ene-21	70	100	18-Nov-20	92.950	7.58%	46.41%	48	656 pbs
S26FI	11-Sep-20	26-Feb-21	98	100	17-Nov-20	91.020	No Operó	No Operó	-	No Operó

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (***)

Fecha: 17-Nov-20

Valor 34.00%

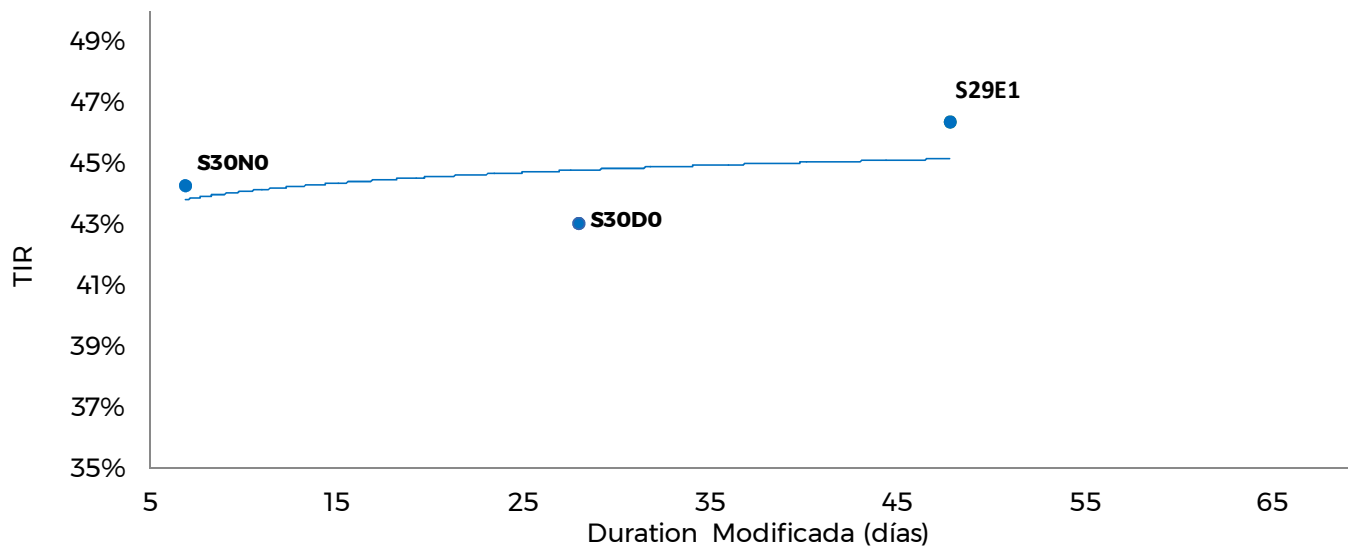
Notas:

(*) Efectiva Anual

(**) TIR- Tasa P Efectiva anual

(***) Según Com BCRAA7027

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación



RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 18-11-20

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/VN100	Cierre (PPT, T+2)		Rendimiento del Período	TIR (**)	DM (días)	Rendimiento s/ BADLAR (***)
								Fecha	\$ c/VN100				
S22D0	22-Ene-20	22-Dic-20	32	34,69%	550 pbs	131,75	128,72	30-Oct-20	124,000	No Operó	No Operó	-	No Operó
TASA BADLAR		Fecha	16-Nov-20	Valor	33,88%								

Notas:

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

