

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	6	100	22-Jun-20	99,650	No Operó	No Operó	-	No Operó
S31JO	28-Abr-20	31-Jul-20	36	100	23-Jun-20	97,400	2,67%	30,62%	28	-390 pbs
SG280	4-May-20	28-Ago-20	64	100	04-Jun-20	99,500	No Operó	No Operó	-	No Operó
S13LO	13-May-20	13-Jul-20	18	100	23-Jun-20	98,500	1,52%	35,86%	13	134 pbs
S13GO	13-May-20	13-Ago-20	49	100	23-Jun-20	96,370	3,77%	31,71%	37	-281 pbs

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

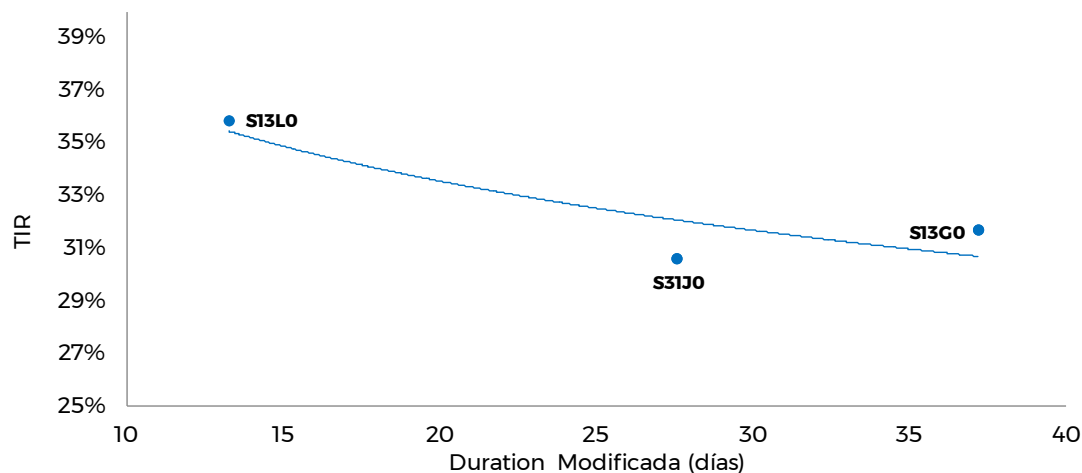
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

Notas:

(*) Efectiva Anual

(**) TIR - Tasa PF efectiva anual

(***) Según Com BCRA A 7027



RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 23-06-20

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	36	28,30%	175 pbs	111,366	108,58	23-Jun-20	108,680	2,47%	28,09%	28,11	-613 pbs
S28GO	29-Ene-20	28-Ago-20	64	30,44%	200 pbs	117,63	112,31	08-Jun-20	110,750	No Operó	No Operó	-	No Operó
S18SO	22-Ene-20	18-Sep-20	85	32,85%	400 pbs	121,54	113,91	23-Jun-20	114,000	6,61%	31,65%	64,57	-257 pbs
S22DO	22-Ene-20	22-Dic-20	180	34,69%	550 pbs	131,76	114,69	11-Jun-20	107,100	No Operó	No Operó	-	No Operó

TASA BADLAR: Fecha: 19-Jun-20 Valor 29,81%

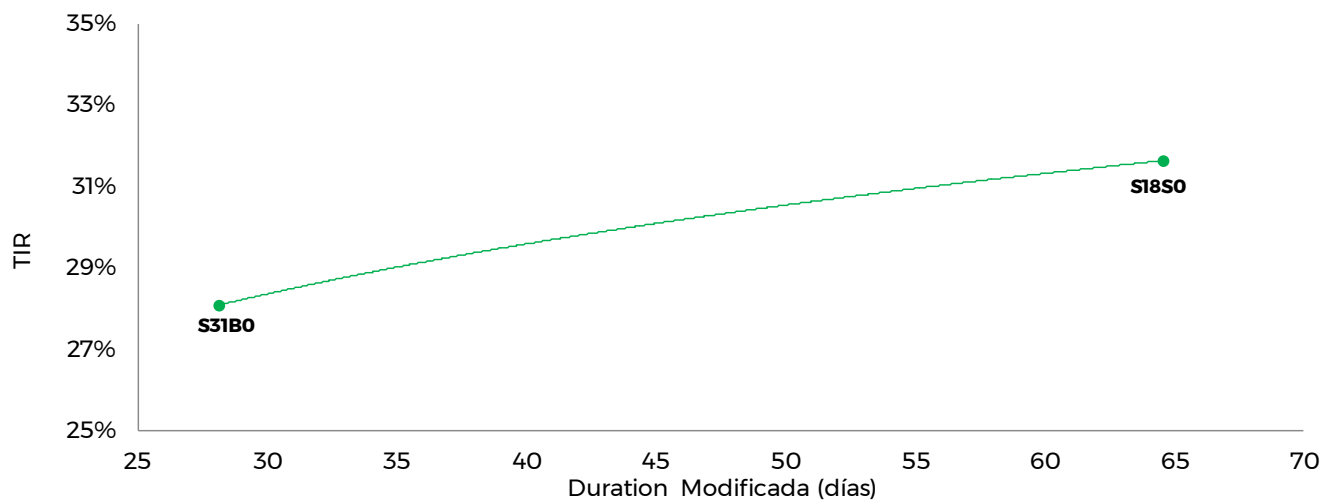
Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

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	22-Jun-20	23,000	No operó	
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	23-Jun-20	33,000	521,65%	30
U2O9D	29-Mar-19	25-Oct-19	31-Dic-20	100	85	31-Dic-20	85	23-Jun-20	33,000	521,65%	30
UN9D	12-Abr-19	15-Nov-19	31-Dic-20	100	85	31-Dic-20	85	22-Jun-20	33,000	No operó	
U2N9D	26-Abr-19	29-Nov-19	31-Dic-20	100	85	31-Dic-20	85	16-Jun-20	31,000	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	152,464	23-Jun-20	154,150	30,05%	26
S29Y0	19-Jul-19	29-May-20	27-Ago-20	3,75%	138,525	27-Ago-20	138,525	128,062	23-Jun-20	132,000	32,25%	48
S31L0	31-Ene-19	31-Jul-20	29-Oct-20	2,65%	171,107	31-Jul-20	24,019	155,043	23-Jun-20	152,500	45,11%	77