

REPORTE DE BONOS

31 de agosto de 2020

Disclaimer:

Este reporte ha sido elaborado por Burplaza S.A. Considera que la información aquí contenida proviene de fuentes confiables. Su objetivo es brindar información y no representa una oferta de compra o venta de activos o instrumentos de ningún tipo. Todas las opiniones y estimaciones expresadas en este documento están sujetas a cambios sin previo aviso.

Precios del 28-ago-20	Moneda de cotización	TIREA	Duration	Capital residual		Intereses corridos	Valor técnico	Paridad	Tasa de cupón	Próximo servicio		Vencimiento
				Monto	%					Renta	Amortización	

BONOS DENOMINADOS EN DÓLARES - COTIZACIÓN EN DÓLARES - EN PROCESO DE REESTRUCTURACIÓN

A020D (*)	48,50	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	3,18	103,18	47,01%	8,000%	31-dic-2020	8,00	31-dic-2020	100,00	31-dic-2020
AA21D (**)	45,75	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,46	102,46	44,65%	6,875%	22-oct-2020	3,44	22-abr-2021	100,00	22-abr-2021
AY24D (*)	39,80	u\$s	n/c	n/c	83,34	83,34%	2,31	85,65	46,47%	8,750%	31-dic-2020	7,29	31-dic-2020	16,66	7-may-2024
A2E2D (**)	49,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,55	100,55	48,73%	5,625%	26-ene-2021	2,81	26-ene-2022	100,00	26-ene-2022
AA25D (*)	43,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,12	102,12	42,11%	5,750%	31-dic-2020	5,75	18-abr-2023	33,00	18-abr-2025
AA26D (**)	43,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,69	102,69	41,87%	7,500%	22-oct-2020	3,75	22-abr-2026	100,00	22-abr-2026
A2E7D (**)	44,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,67	100,67	43,71%	6,875%	26-ene-2021	3,44	26-ene-2027	100,00	26-ene-2027
A2E8D (**)	42,50	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,82	100,82	42,16%	5,875%	11-ene-2021	2,94	11-ene-2028	100,00	11-ene-2028
DICAD (*)	69,10	u\$s	n/c	n/c	140,20	100,00%	7,77	147,98	46,70%	8,280%	31-dic-2020	0,00	30-jun-2024	7,01	31-dic-2033
DICYD (**)	61,10	u\$s	n/c	n/c	140,20	100,00%	1,97	142,17	42,98%	8,280%	31-dic-2020	5,80	30-jun-2024	7,01	31-dic-2033
AA37D (*)	43,50	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,82	102,82	42,31%	7,625%	31-dic-2020	7,63	18-abr-2035	33,00	18-abr-2037
PARAD (*)	39,51	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	1,57	101,57	38,90%	3,750%	31-dic-2020	1,88	30-sep-2029	5,00	31-dic-2038
PARYD (**)	40,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	1,57	101,57	39,38%	3,750%	30-sep-2020	1,88	30-sep-2029	5,00	31-dic-2038
AA46D (**)	30,25	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,73	102,73	29,45%	7,625%	22-oct-2020	3,81	22-abr-2046	100,00	22-abr-2046
AC17D (**)	39,00	u\$s	n/c	n/c	100,00	100,00%	1,25	101,25	38,52%	7,125%	28-dic-2020	3,56	28-jun-2117	100,00	28-jun-2117

NOTAS Y ACLARACIONES:

(*) El canje de estos títulos está en proceso y la Fecha Temprana para la presentación de ofertas vence el 01.09.2020. Las cotizaciones corresponden a las de BYMA de plazo 48hs. Si no cotizó se toma el último precio de cierre

(**) La oferta hecha por el gobierno para el canje de deuda legislación extranjera vence el 28.08.2020. Los cálculos de indicadores corresponden al 01.09.2020

Precios del 28-ago-20	Moneda de cotización	TIREA	Duration	Capital residual		Intereses corridos	Valor técnico	Paridad	Tasa de cupón	Próximo servicio		Vencimiento
				Monto	%					Renta	Amortización	

BONOS DENOMINADOS EN DÓLARES - COTIZACIÓN EN PESOS ^(a) - EN PROCESO DE REESTRUCTURACIÓN

A020 (*)	5.880,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	3,18	103,18	46,81%	8,000%	31-dic-2020	8,00	31-dic-2020	100,00	31-dic-2020
AA21 (**)	4.660,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,46	102,46	37,36%	6,875%	22-oct-2020	3,44	22-abr-2021	100,00	22-abr-2021
AY24 (*)	4.845,00	pesos	n/c	n/c	83,34	83,34%	2,31	85,65	46,47%	8,750%	31-dic-2020	7,29	31-dic-2020	16,66	7-may-2024
A2E2 (**)	6.400,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,55	100,55	52,29%	5,625%	26-ene-2021	2,81	26-ene-2022	100,00	26-ene-2022
AA25 (*)	5.015,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,12	102,12	40,34%	5,750%	31-dic-2020	5,75	18-abr-2023	33,00	18-abr-2025
AA26 (**)	5.451,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,69	102,69	43,61%	7,500%	22-oct-2020	3,75	22-abr-2026	100,00	22-abr-2026
A2E7 (**)	5.250,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,67	100,67	42,84%	6,875%	26-ene-2021	3,44	26-ene-2027	100,00	26-ene-2027
A2E8 (**)	5.302,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	0,82	100,82	43,20%	5,875%	11-ene-2021	2,94	11-ene-2028	100,00	11-ene-2028
DICA (*)	8.411,00	pesos	n/c	n/c	140,20	100,00%	1,97	142,17	48,60%	8,280%	31-dic-2020	11,61	30-jun-2024	7,01	31-dic-2033
DICY (**)	7.701,00	pesos	n/c	n/c	140,20	100,00%	1,97	142,17	44,50%	8,280%	31-dic-2020	5,80	30-jun-2024	7,01	31-dic-2033
AA37 (*)	5.260,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,82	102,82	42,03%	7,625%	31-dic-2020	7,63	18-abr-2035	33,00	18-abr-2037
PARA (*)	4.950,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	1,57	101,57	40,03%	3,750%	31-dic-2020	1,88	30-sep-2029	5,00	31-dic-2038
AA46 (**)	3.150,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	2,73	102,73	25,19%	7,625%	22-oct-2020	3,81	22-abr-2046	100,00	22-abr-2046
AC17 (**)	4.650,00	pesos	n/c	n/c	100,00	100,00%	1,25	101,25	37,73%	7,125%	28-dic-2020	3,56	28-jun-2117	100,00	28-jun-2117

NOTAS Y ACLARACIONES:

(*) El canje de estos títulos está en proceso y la Fecha Temprana para la presentación de ofertas vence el 01.09.2020. Las cotizaciones corresponden a las de BYMA de plazo 48hs. Si no cotizó se toma el último precio de cierre

(**) La oferta hecha por el gobierno para el canje de deuda legislación extranjera vence el 28.08.2020. Los cálculos de indicadores corresponden al 01.09.2020

(a) Dólar bolsa (AY24/AY24D): **\$/u\$s 121,73** La TIR está expresada en u\$s.

Precios del 28-ago-20	Moneda de cotización	TIREA	Duration	Capital residual		Intereses corridos	Valor técnico	Paridad	Tasa de cupón	Próximo servicio		Vencimiento
				Monto	%					Renta	Amortización	

BONOS DENOMINADOS EN PESOS A TASA FIJA

TN20	106,50	pesos	30,6%	0,2x	100,00	100,00%	7,22	107,22	99,3%	26,00%	21-nov-2020	13,00	21-nov-2020	100,00	21-nov-2020
TO21	89,10	pesos	44,8%	0,9x	100,00	100,00%	7,48	107,48	82,9%	18,20%	3-oct-2020	9,10	3-oct-2021	100,00	3-oct-2021
TO23	60,39	pesos	49,0%	2,1x	100,00	100,00%	5,96	105,96	57,0%	16,00%	17-oct-2020	8,00	17-oct-2023	100,00	17-oct-2023
TO26	43,10	pesos	53,3%	2,5x	100,00	100,00%	5,77	105,77	40,7%	15,50%	17-oct-2020	7,75	17-oct-2026	100,00	17-oct-2026

BONOS DENOMINADOS EN PESOS AJUSTABLES POR CER^(a)

TX21	117,60	pesos	0,5% + CER	0,9x	116,94	100,00%	0,08	117,03	100,5%	1,00%	5-feb-2021	0,58 + CER	5-ago-2021	116,94 + CER	5-ago-2021
TC21	372,00	pesos	0,9% + CER	0,9x	365,70	100,00%	0,99	366,69	101,4%	2,50%	22-ene-2021	4,57 + CER	22-jul-2021	365,70 + CER	22-jul-2021
TX22	111,85	pesos	1,7% + CER	1,5x	112,10	100,00%	0,61	112,71	99,2%	1,20%	18-sep-2020	0,67 + CER	18-mar-2022	112,10 + CER	18-mar-2022
PR13	668,00	pesos	2,8% + CER	1,8x	676,65	36,09%	0,60	677,26	98,6%	2,00%	15-sep-2020	1,13 + CER	15-sep-2020	15,56 + CER	15-mar-2024
T2X2	104,00	pesos	2,7% + CER	2,0x	106,51	100,00%	0,39	106,90	97,3%	1,30%	20-sep-2020	0,46 + CER	20-sep-2022	106,51 + CER	20-sep-2022
TX23	104,85	pesos	4,2% + CER	2,5x	111,67	100,00%	0,68	112,35	93,3%	1,40%	25-sep-2020	0,78 + CER	25-mar-2023	111,67 + CER	25-mar-2023
TC23	269,00	pesos	3,0% + CER	2,4x	257,70	100,00%	5,01	262,71	102,4%	4,00%	6-sep-2020	5,15 + CER	6-mar-2023	257,70 + CER	6-mar-2023
TX24	99,50	pesos	5,1% + CER	3,5x	111,67	100,00%	0,73	112,40	88,5%	1,50%	25-sep-2020	0,84 + CER	25-mar-2024	111,67 + CER	25-mar-2024
DICP	1.945,00	pesos	6,2% + CER	6,6x	1.963,93	100,00%	19,40	1.983,33	98,1%	5,83%	31-dic-2020	57,25 + CER	30-jun-2024	98,20 + CER	31-dic-2033
PARP	838,00	pesos	7,6% + CER	11,0x	1.546,48	100,00%	11,48	1.557,96	53,8%	1,77%	30-sep-2020	13,69 + CER	30-sep-2029	77,32 + CER	31-dic-2038
CUAP	1.210,00	pesos	7,8% + CER	12,6x	2.147,44	100,00%	12,04	2.159,48	56,0%	3,31%	31-dic-2020	35,54 + CER	30-jun-2036	107,37 + CER	31-dic-2045

BONOS DENOMINADOS EN PESOS A TASA BADLAR^(b)

PR15	123,50	pesos	37,1%	0,9x	121,07	69,00%	5,59	126,66	97,5%	29,56%	5-oct-2020	8,92	5-oct-2020	12,28	4-oct-2022
TB21	101,05	pesos	36,7%	0,8x	100,00	100,00%	2,26	102,26	98,8%	29,54%	5-nov-2020	7,81	5-ago-2021	107,81	5-ago-2021

LETRAS DEL TESORO REPERFILADAS (LECAP)

S31LO	141,05	pesos	26,9%	58 días	147,09						29-oct-2020	147,09	29-oct-2020
-------	--------	-------	-------	---------	--------	--	--	--	--	--	-------------	--------	-------------

NOTAS Y ACLARACIONES:

Los precios corresponden al cierre en BYMA de plazo 48hs. En caso de no haber operado se toma el último precio de cierre.

(a) Los cálculos contemplan el ajuste por CER correspondiente sólo hasta el día de la fecha del análisis, o sea, no contempla estimaciones futuras del CER.

(b) Tasa Badlar Privada estimada: **30,00%**