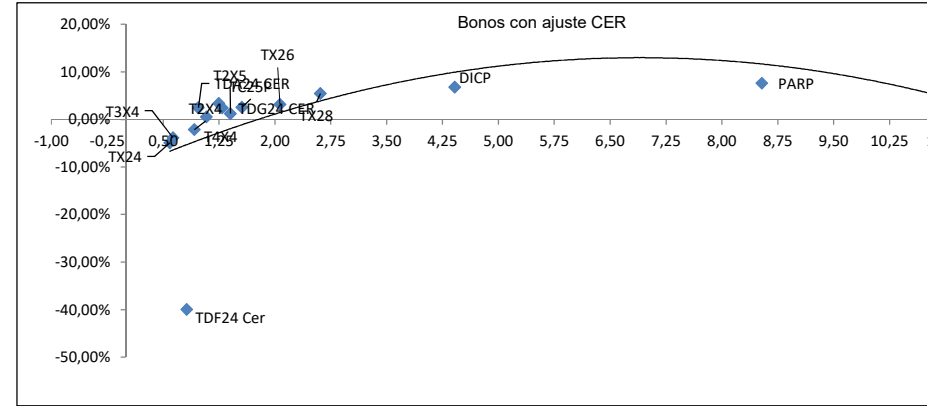
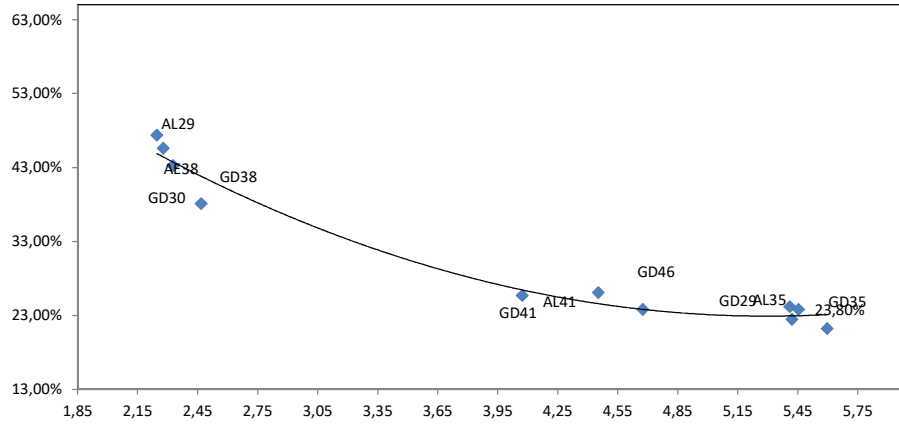


Fecha
Settlement30/08/2023
01/09/2023

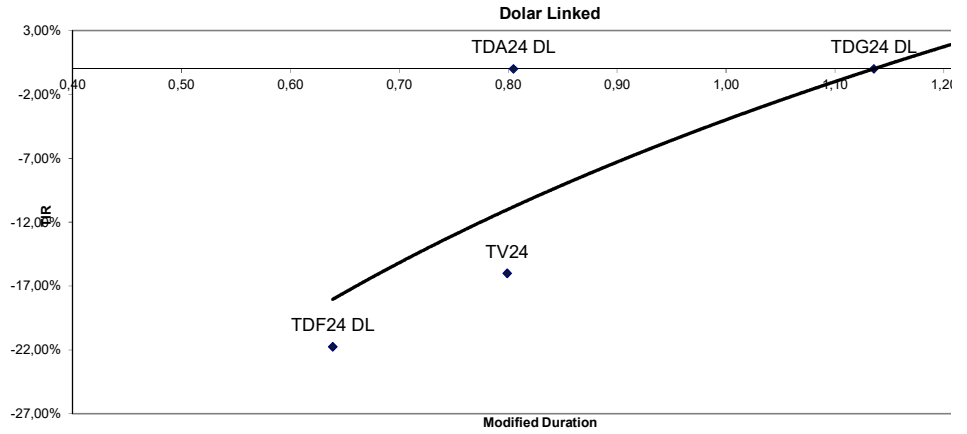
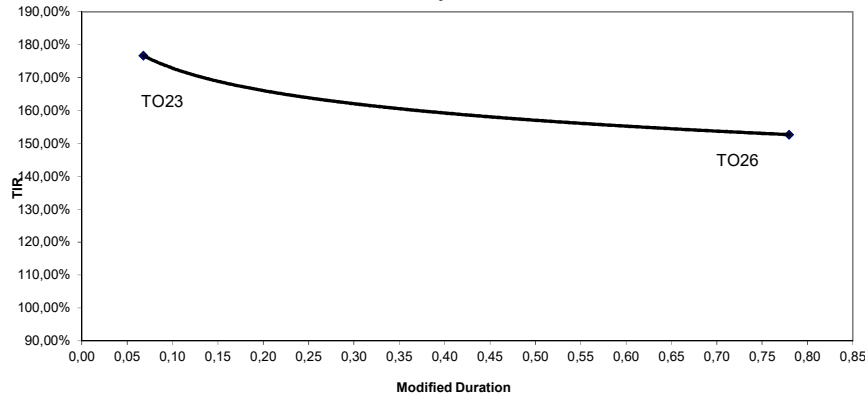
Próximo F

Título	Código	Outstanding (millones)	Mat.	VR	Cupón	Tipo Amort.	Precio Clean	Accrued	Precio Dirty	Mod. Dur.	TIR	TNA	Paridad	Current Yield	Valor Técnico	Renta
Bonos con Tasa Fija																
BONO TASA FIJA 2023	TO23	64.150,35	17/10/23	100,00%	16,0000%	Bullet	89,0444	5,9556	95,0000	0,07	176,67%	132,67%	89,66%	17,97%	105,96	17/10/23
BONO TASA FIJA 2026	TO26	96.569,71	17/10/26	100,00%	15,5000%	Bullet	17,5806	5,7694	23,3500	0,78	152,66%	117,91%	22,08%	88,17%	105,77	17/10/23
Bonos con Ajuste CER (tasas expresadas en terminos reales)																
BONCER 2024	TX24	345.783,35	25/03/24	100,00%	1,5000%	Bullet	619,9000	-	619,9000	0,59	-4,93%	-4,99%	104,42%	1,45%	411,53	25/09/23
BONCER 2024	T3X4	696.849,68	14/04/24	100,00%	3,7500%	Bullet	154,0106	2,9894	157,0000	0,63	-3,86%	-3,90%	106,59%	2,43%	147,30	14/10/23
BONCER 2024	T2X4	314.877,10	26/07/24	100,00%	1,5500%	Bullet	462,3261	0,6739	463,0000	0,92	-2,13%	-2,14%	103,53%	1,50%	447,23	26/01/24
BONCER 2024	T4X4	1.785.858,91	14/10/24	100,00%	4,0000%	Bullet	152,5113	3,1887	155,7000	1,08	0,55%	0,55%	105,70%	2,62%	147,30	14/10/23
BONCER 2024	T5X4	2.248.772,00	13/12/24	100,00%	4,2500%	Bullet	125,4487	1,1013	126,5500	1,25	0,42%	0,42%	105,81%	3,39%	119,60	13/12/23
BONCER 2025	T2X5	1.339.394,18	14/02/25	100,00%	4,2500%	Bullet	153,1131	0,8869	154,0000	1,41	1,22%	1,22%	104,55%	2,78%	147,30	14/08/23
BONCER 2025	TC25P	29.097,80	27/04/25	100,00%	4,0000%	Bullet	1.338,6080	31,3920	1.370,0000	1,56	2,53%	2,52%	54,84%	0,29%	2.497,97	27/10/23
BONCER 2026	TX26	190.746,92	09/11/26	100,00%	2,0000%	Sinkable	517,3790	2,5210	519,9000	2,07	3,18%	3,15%	97,97%	2,05%	530,70	09/11/23
BONCER 2028	TX28	75.904,84	09/11/28	100,00%	2,2500%	Sinkable	486,8351	3,7149	490,5500	2,61	5,45%	5,38%	92,44%	2,45%	530,70	09/11/23
DISCOUNT PESOS	DICP	10.472,48	31/12/33	100,00%	5,8300%	Sinkable	10.274,0201	0,9799	10.275,0000	4,41	6,75%	6,64%	111,99%	5,99%	9.174,85	31/12/23
PAR PESOS	PARP	2.860,55	31/12/38	100,00%	1,7700%	Sinkable	5.015,7271	64,2729	5.080,0000	8,54	7,62%	7,48%	59,54%	1,97%	8.532,62	30/09/23
CUASIPAR	CUAP	23.434,05	31/12/45	100,00%	3,3100%	Sinkable	6.744,9252	55,0748	6.800,0000	10,93	7,56%	7,42%	68,86%	0,05%	9.874,76	31/12/23
Bonos duales																
Bono Dual 2023 Sep	TDS23 Cer	8.739,25	29/09/23	100,00%	2,2500%	Bullet	32.790,5287	704,4713	33.495,0000	0,26	-70,55%	-91,46%	110,02%	2,04%	30.444,68	29/09/23
Bono Dual 2023 Sep	TDS23 DL	8.739,25	29/09/23	100,00%	0,0000%	Bullet	33.495,0000	-	33.495,0000	0,04	77,35%	66,34%	95,70%	0,00%	100,00	29/09/23
Bono Dual 2024 Feb	TDF24 Cer	6.921,62	28/02/24	100,00%	3,0000%	Bullet	38.687,0908	812,9092	39.500,0000	0,82	-39,94%	-45,00%	130,43%	2,29%	30.283,94	28/02/24
Bono Dual 2024 Feb	TDF24 DL	6.921,62	28/02/24	100,00%	0,0000%	Bullet	39.500,0000	-	39.500,0000	0,64	-21,75%	-23,79%	112,86%	0,00%	100,00	28/02/24
Bono Dual 2024 Abr	TDA24 Cer	3.639,00	30/04/24	100,00%	3,2500%	Bullet	39.110,8407	329,1593	39.440,0000	0,97	-31,76%	-34,79%	131,59%	2,46%	29.972,03	30/04/24
Bono Dual 2024 Abr	TDA24 DL	3.639,00	30/04/24	100,00%	0,0000%	Bullet	39.440,0000	-	39.440,0000	0,80	-16,48%	-17,61%	112,69%	0,00%	100,00	30/04/24
Bono dual 2024 Ago	TDG24 Cer	4.179,00	30/08/24	100,00%	3,2500%	Bullet	39.094,6758	205,3242	39.300,0000	1,29	-22,93%	-24,42%	133,84%	2,42%	29.363,79	30/08/24
Bono dual 2024 Ago	TDG24 DL	4.179,00	30/08/24	100,00%	0,0000%	Bullet	39.300,0000	-	39.300,0000	1,14	-10,97%	-11,45%	112,29%	0,00%	100,00	30/08/24
Bonos Dolar Linked																
BONO DL 2024	TV24	1.980,00	30/04/24	100,00%	0,4000%	Bullet	39.439,8641	0,1359	39.440,0000	0,80	-16,00%	-16,70%	112,53%	0,36%	100,14	30/10/23
BONO DL 2024	T2V4	488,00	30/09/24	100,00%	0,5000%	Bullet	39.999,8562	0,1438	40.000,0000	1,23	-11,08%	-11,40%	114,12%	0,44%	100,14	30/09/23
Bonos en Dólares Ley Local																
BONAR 2029	AL29	2.194,73	09/07/29	100,00%	1,0000%	Sinkable	30,3543	0,1444	30,4988	2,25	47,36%	42,79%	30,45%	3,29%	100,14	09/01/24
BONAR 2030	AL30	13.531,42	09/07/30	100,00%	0,7500%	Sinkable	29,4653	0,0722	29,5375	2,28	45,60%	41,33%	29,52%	2,55%	100,07	09/01/24
BONAR 2038	AE38	7.218,72	09/01/38	100,00%	4,2500%	Sinkable	32,2528	0,5597	32,8125	4,45	26,11%	24,60%	32,63%	13,18%	100,56	09/01/24
BONAR 2041	AL41	1.512,74	09/07/41	100,00%	3,5000%	Sinkable	29,4944	0,5056	30,0000	5,42	22,48%	21,34%	29,85%	11,87%	100,51	09/01/24
BONAR 2035	AL35	19.071,98	09/07/35	100,00%	3,6250%	Sinkable	29,7208	0,2167	29,9375	5,41	24,19%	22,88%	29,87%	12,20%	100,22	09/01/24
Bonos en Dólares Ley NY																
ARGENT 2029	GD29	2.635,03	09/07/29	100,00%	1,0000%	Sink/Call	32,8645	0,1444	33,0089	2,33	43,27%	39,39%	32,96%	3,04%	100,14	09/01/24
ARGENT 2030	GD30	16.090,61	09/07/30	100,00%	0,7500%	Sink/Call	34,2805	0,0722	34,3527	2,47	38,13%	35,06%	34,33%	2,19%	100,07	09/01/24
ARGENT 2046	GD46	2.092,00	09/07/46	100,00%	3,6250%	Sink/Call	30,4850	0,2167	30,7017	4,07	25,68%	24,22%	30,64%	11,89%	100,22	09/01/24
ARGENT 2038	GD38	11.405,07	09/01/38	100,00%	4,2500%	Sink/Call	35,5170	0,5597	36,0767	4,68	23,80%	22,53%	35,88%	11,97%	100,56	09/01/24
ARGENT 2041	GD41	10.482,11	09/07/41	100,00%	3,5000%	Sink/Call	31,4585	0,5056	31,9641	5,60	21,22%	20,20%	31,80%	11,13%	100,51	09/01/24
ARGENT 2035	GD35	20.501,72	09/07/35	100,00%	3,6250%	Sink/Call	30,2970	0,2167	30,5137	5,45	23,80%	22,53%	30,45%	11,96%	100,22	09/01/24

Bonos en dólares



Pesos Tasa Fija



Esta publicación fue preparada por Grupo SBS solamente para información de clientes de Grupo SBS. La misma no pretende ser una oferta o solicitud de compra o venta de ningún instrumento financiero ni recomendación de inversión. La información presentada así como cualquier opinión expresada se basa en fuentes que son consideradas confiables. Sin embargo, Grupo SBS no garantiza la integridad ni la exactitud de la información contenida en este informe. Todas las opiniones y estimaciones mencionadas en este informe pueden ser modificadas por Grupo SBS sin aviso previo. Grupo SBS, sus funcionarios y sus empleados pueden, hasta los límites exigidos por ley, tener una posición o estar interesados en tener una posición (incluyendo la compra o venta a sus clientes) en cualquier transacción o inversión relacionada con este informe. Grupo SBS puede realizar inversiones o prestar servicios (incluyendo asesoramiento y/o administración) a, o solicitar inversiones u otros negocios de cualquier compañía mencionada en este informe. Grupo SBS puede haber tenido relación de negocios de cualquier tipo y/o haber recibido algún tipo de remuneración en el pasado con cualquiera de las compañías mencionadas en el presente informe. De igual forma, Grupo SBS puede esperar percibir remuneración o realizar cualquier tipo de negocio en el futuro, con cualquiera de las compañías mencionadas en este informe. Grupo SBS, ni ninguno de sus funcionarios o empleados acepta una demanda o pasivo alguno proveniente de cualquier pérdida directa o indirecta que pueda derivarse de la utilización del presente informe o su contenido. Todos los derechos reservados. Esta publicación no puede ser reproducida ni en todo ni en parte, en ninguna forma ni por ningún medio, sea mecánico, fotoquímico, electrónico, por fotocopia o cualquier otro, sin el permiso previo por escrito del Grupo SBS. Cualquier inversión referida en el presente informe puede implicar riesgos significativos y no están necesariamente disponibles o permitidas en todas las jurisdicciones. Asimismo, este informe puede fluctuar o ser afectado por eventos no mencionados en el mismo. Los rendimientos observados en el pasado no constituyen indicativo de los rendimientos futuros. Grupo SBS espera que los inversores tomen sus propias decisiones de inversión basadas en su propio juicio sin depender del contenido del presente informe. Solamente inversores con el conocimiento y experiencia suficientes en asuntos de negocios y finanzas como para evaluar los méritos y riesgos deberían considerar la posibilidad de realizar inversiones en cualquier instrumento o inversión mencionados en este informe.



Pago Cupón

Amort.
17/10/23
17/10/26
25/03/24
14/04/24
26/07/24
14/10/24
13/12/24
14/02/25
27/04/25
09/11/26
09/11/28
31/12/33
31/12/38
31/12/45
29/09/23
29/09/23
28/02/24
28/02/24
30/04/24
30/04/24
30/08/24
30/08/24
30/04/24
30/09/24
09/01/25
09/07/24
09/07/27
09/01/28
09/01/31
09/01/25
09/07/24
09/01/25
09/07/27
09/01/28
09/01/31



CUAP

11,00 11,75

12V4

0 1,30