

RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 03-09-21

LETRAS DEL TESORO A DESCUENTO

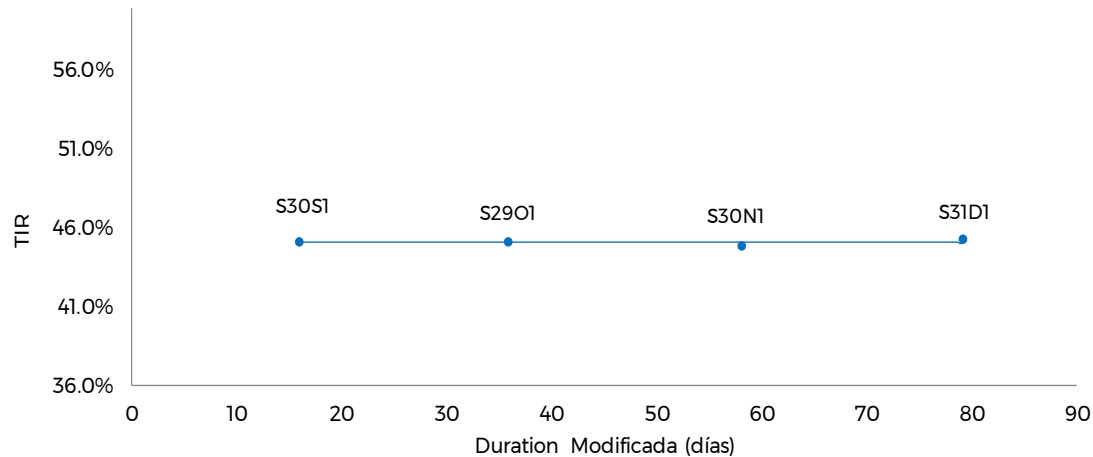
Especie	Fecha de Emisión	Fecha de Pago	Plazo al Vto (Días)	Monto al Vto	Cierre (PPT, T+2)		Rendimiento del Período	TIR	DM (días)	Rendimientos / Plazo Fijo (**)
					Fecha	\$ c/VN 100				
S30S1	31-Mar-21	30-Sep-21	23	100	03-Sep-21	97.681	2.37%	45.11%	16	114 pbs
S29O1	19-Abr-21	29-Oct-21	52	100	03-Sep-21	94.830	5.45%	45.15%	36	117 pbs
S30N1	21-May-21	30-Nov-21	84	100	03-Sep-21	91.830	8.90%	44.82%	58	85 pbs
S31D1	30-Jun-21	31-Dic-21	115	100	03-Sep-21	88.900	12.49%	45.27%	79	129 pbs
S31E2	22-Jul-21	31-Ene-22	146	100	02-Sep-21	85.960	No Operó	No Operó	-	No Operó

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (**)

Fecha: 2-Sep-21

Valor 37.00%

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

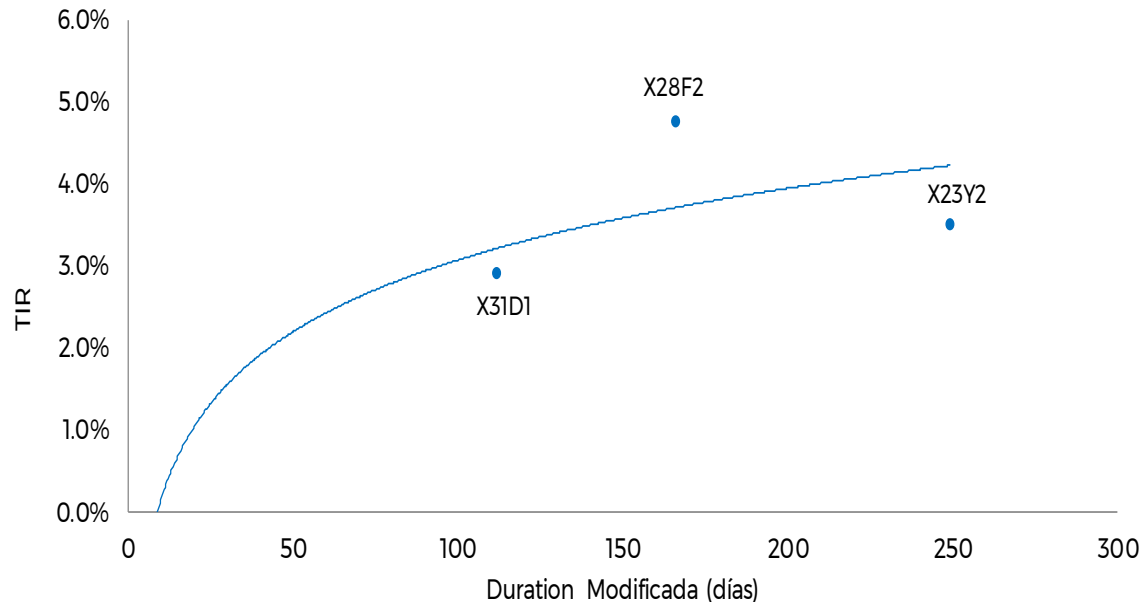


Especie	Fecha de Emisión	Fecha de Pago	CER Inicial	Plazo al Vto (Días)	Monto (*) Capitalizado	Cierre (PPT, T+2)		Rendimiento del Período	TIR (*)	DM (días)
						Fecha	\$ c/VN 100			
X13S1	4-Dic-20	13-Sep-21	24.2854	6	140	03-Sep-21	140.120	-0.008%	-0.51%	6
X31D1	30-Jun-21	31-Dic-21	31.6448	115	108	03-Sep-21	106.550	0.914%	2.93%	112
X28F2	18-Mar-21	28-Feb-22	27.5701	174	123	03-Sep-21	120.700	2.25%	4.78%	166
X31M2	31-Mar-21	31-Mar-22	28.0302	205	121	31-Aug-21	118.800	No Operó	No Operó	-
X18A2	19-Abr-21	18-Abr-22	28.6771	223	119	02-Sep-21	116.000	No Operó	No Operó	-
X23Y2	21-May-21	23-May-22	30.0207	258	113	03-Sep-21	110.600	2.48%	3.52%	249
X30J2	30-Jun-21	30-Jun-22	31.6448	296	108	02-Sep-21	104.800	No Operó	No Operó	-
X29L2	5-Ago-21	29-Jul-22	32.9224	325	103	31-Aug-21	101.250	No Operó	No Operó	-

CER Fecha de cálculo 34.0258

(*): No se realiza proyección del coeficiente CER. El capital ajustado surge de multiplicar el capital de 100 VN por el cociente entre el CER de 10 días hábiles antes de la fecha de liquidación y el CER de emisión (10 días antes de dicha fecha).

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación



RESUMEN DE NEGOCIACIÓN 03-09-21

LETRAS DEL TESORO A TASA DE PASES PASIVOS

Especie	Fecha de Emisión	Fecha de Pago	Plazo al Vto (Días)	Margen S/ Tasa Pasiva	Tasa Estimada (*)	Monto al Vto	Cierre (PPT, T+2)		Rendimiento del Período	TIR	DM (días)	Rendimiento s/ BADLAR (**)
							Fecha	\$ c/VN100				
SS301	31-Mar-21	30-Sep-21	23	2.00%	38.50%	119.3	02-Sep-21	116.450	No Operó	No Operó	-	No Operó
SO291	19-Abr-21	29-Oct-21	52	2.75%	39.25%	120.8	03-Sep-21	114.520	5.44%	45.07%	36	5.020%
SN301	30-Jul-21	30-Nov-21	84	3.00%	39.50%	113.3	31-Aug-21	103.500	No Operó	No Operó	-	No Operó

(*) : TNA, para los cálculos se toma la última tasa de pases pasivos a 7 (TNA) días publicada por el BCRA y se la proyecta hasta el vencimiento, luego se le suma el margen.

(**): Diferencia entre la TIR y la tasa badlar en pesos bancos privados (TEA)

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

