

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)	Rendimiento s / Plazo Fijo (*)
					Fecha	\$ c / VN 100				
S31E2	22-Jul-21	31-Ene-22	13	100	14-Jan-22	98.675	1.34%	45.43%	9	-137 pbs
S28F2	30-Sep-21	28-Feb-22	41	100	14-Jan-22	95.750	4.44%	47.20%	28	40 pbs
S31M2	29-Oct-21	31-Mar-22	72	100	14-Jan-22	92.850	7.70%	45.66%	49	-114 pbs
S29A2	30-Nov-21	29-Abr-22	101	100	14-Jan-22	89.390	11.87%	49.98%	67	318 pbs
S31Y2	15-Dic-21	31-May-22	133	100	14-Jan-22	86.290	15.89%	49.88%	89	308 pbs

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (*)

Fecha: 13-Ene-22

Valor 39.00%

LETRAS DEL TESORO A DESCUENTO AJUSTADAS POR CER

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			
X28F2	18-Mar-21	28-Feb-22	27.5701	41	141	14-Jan-22	140.750	-0.10%	-0.91%	41
X31M2	31-Mar-21	31-Mar-22	28.0302	72	138	14-Jan-22	139.050	-0.54%	-2.71%	74
X18A2	19-Abr-21	18-Abr-22	28.6771	90	135	14-Jan-22	136.100	-0.68%	-2.72%	93
X23Y2	21-May-21	23-May-22	30.0207	125	129	14-Jan-22	130.850	-1.32%	-3.79%	130
X30J2	30-Jun-21	30-Jun-22	31.6448	163	123	14-Jan-22	124.200	-1.37%	-3.04%	168
X29L2	5-Ago-21	29-Jul-22	32.9224	192	118	14-Jan-22	119.950	-1.84%	-3.46%	199
X16G2	30-Nov-21	16-Ago-22	36.8623	210	105	14-Jan-22	107.000	-1.72%	-2.97%	216
X21O2	31-Dic-21	21-Oct-22	38.1829	276	102	14-Jan-22	102.600	-1.05%	-1.38%	280

CER Fecha de cálculo 38.7652

(*): 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

