

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				
S29A2	30-Nov-21	29-Abr-22	23	100	04-Apr-22	97.450	2.62%	50.67%	15	-266 pbs
S31Y2	15-Dic-21	31-May-22	55	100	04-Apr-22	93.950	6.44%	51.31%	36	-202 pbs
S30J2	31-Ene-22	30-Jun-22	85	100	04-Apr-22	90.495	10.50%	53.55%	55	23 pbs
S29L2	31-Ene-22	29-Jul-22	114	100	04-Apr-22	87.300	14.55%	54.47%	74	115 pbs
S31G2	28-Feb-22	31-Ago-22	147	100	04-Apr-22	83.700	19.47%	55.55%	95	222 pbs
S30S2	31-Mar-22	30-Sep-22	177	100	04-Apr-22	80.900	23.61%	54.82%	114	149 pbs

LETRAS DEL TESORO A DESCUENTO AJUSTADAS POR CER

LEDE 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			
X18A2	19-Abr-21	18-Abr-22	28.6771	12	149	04-Apr-22	148.650	-0.03%	-0.95%	12
X23Y2	21-May-21	23-May-22	30.0207	47	142	04-Apr-22	144.850	-2.00%	-14.52%	55
X30J2	30-Jun-21	30-Jun-22	31.6448	85	135	04-Apr-22	139.200	-3.26%	-13.25%	98
X29L2	5-Ago-21	29-Jul-22	32.9224	114	129	04-Apr-22	134.300	-3.62%	-11.13%	128
X16G2	30-Nov-21	16-Ago-22	36.8623	132	116	04-Apr-22	119.200	-3.01%	-8.12%	144
X21O2	31-Dic-21	21-Oct-22	38.1829	198	112	04-Apr-22	115.350	-3.24%	-5.90%	210
X16D2	15-Mar-22	16-Dic-22	41.1508	254	104	04-Apr-22	106.200	-2.49%	-3.55%	263
X20E3	31-Ene-22	20-Ene-23	39.2005	289	109	04-Apr-22	110.710	-1.81%	-2.28%	296
X17F3	2-Mar-22	17-Feb-23	40.5435	317	105	04-Apr-22	107.000	-1.77%	-2.03%	324
X21A3	31-Mar-22	21-Abr-23	42.2380	380	101	04-Apr-22	102.550	-1.62%	-1.55%	386

CER Fecha de cálculo

42.6151

LETRAS DEL TESORO A TASA DE PASES PASIVOS

LEPASE

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 / VN 100				
SG162	25-Mar-22	16-Aug-22	132	14.00%	34.45%	119.1	04-Apr-22	101.750	17.07%	54.61%	85	376 pbs

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

