

## 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 | TNA      | TIR      | DM (días) | Rendimiento s/ Plazo Fijo (*) |
|---------|------------------|---------------|---------------------|--------------|-------------------|------------|-------------------------|----------|----------|-----------|-------------------------------|
|         |                  |               |                     |              | Fecha             | \$ c/VN100 |                         |          |          |           |                               |
| S29L2   | 31-Ene-22        | 29-Jul-22     | 17                  | 100          | 08-Jul-22         | 97.501     | 2.56%                   | 55.03%   | 72.18%   | 10        | 418 pbs                       |
| S31G2   | 28-Feb-22        | 31-Ago-22     | 50                  | 100          | 08-Jul-22         | 92.100     | 8.58%                   | 62.62%   | 82.35%   | 27        | 1435 pbs                      |
| S30S2   | 31-Mar-22        | 30-Sep-22     | 80                  | 100          | 08-Jul-22         | 88.250     | 13.31%                  | 60.75%   | 76.88%   | 45        | 888 pbs                       |
| S31O2   | 23-May-22        | 31-Oct-22     | 111                 | 100          | 08-Jul-22         | 85.000     | 17.65%                  | 58.03%   | 70.64%   | 65        | 265 pbs                       |
| S30N2   | 16-Jun-22        | 30-Nov-22     | 141                 | 100          | 06-Jul-22         | 80.500     | No Operó                | No Operó | No Operó | -         | No Operó                      |

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (\*) Fecha: 8-Jul-22 Valor 53.00%

## 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 | TNA    | TIR (*) | DM (días) |
|---------|------------------|---------------|-------------|---------------------|------------------------|-------------------|------------|-------------------------|--------|---------|-----------|
|         |                  |               |             |                     |                        | Fecha             | \$ c/VN100 |                         |        |         |           |
| X29L2   | 5-Ago-21         | 29-Jul-22     | 32.9224     | 17                  | 155                    | 08-Jul-22         | 155.500    | -0.32%                  | -6.83% | -6.61%  | 18        |
| X16G2   | 30-Nov-21        | 16-Ago-22     | 36.8623     | 35                  | 138                    | 08-Jul-22         | 138.250    | 0.14%                   | 1.42%  | 1.43%   | 35        |
| X21O2   | 31-Dic-21        | 21-Oct-22     | 38.1829     | 101                 | 134                    | 08-Jul-22         | 132.900    | 0.56%                   | 2.04%  | 2.05%   | 99        |
| X23N2   | 30-Jun-22        | 23-Nov-22     | 49.8495     | 134                 | 102                    | 08-Jul-22         | 101.750    | 0.61%                   | 1.66%  | 1.67%   | 132       |
| X16D2   | 15-Mar-22        | 16-Dic-22     | 41.1508     | 157                 | 124                    | 08-Jul-22         | 122.400    | 1.32%                   | 3.06%  | 3.09%   | 152       |
| X20E3   | 31-Ene-22        | 20-Ene-23     | 39.2005     | 192                 | 130                    | 08-Jul-22         | 126.150    | 3.20%                   | 6.07%  | 6.16%   | 181       |
| X17F3   | 2-Mar-22         | 17-Feb-23     | 40.5435     | 220                 | 126                    | 08-Jul-22         | 119.500    | 5.33%                   | 8.84%  | 9.00%   | 202       |
| X21A3   | 31-Mar-22        | 21-Abr-23     | 42.2380     | 283                 | 121                    | 08-Jul-22         | 112.700    | 7.20%                   | 9.29%  | 9.39%   | 259       |
| X19Y3   | 29-Abr-22        | 19-May-23     | 44.0271     | 311                 | 116                    | 08-Jul-22         | 106.900    | 8.43%                   | 9.89%  | 9.96%   | 283       |

CER Fecha de cálculo 51.0315

(\*) 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).

## 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 | TNA      | TIR      | DM (días) | Rendimiento s/ BADLAR (**) |
|---------|------------------|---------------|---------------------|-----------------------|-------------------|--------------|-------------------|------------|-------------------------|----------|----------|-----------|----------------------------|
|         |                  |               |                     |                       |                   |              | Fecha             | \$ c/VN100 |                         |          |          |           |                            |
| SG162   | 25-Mar-22        | 16-Aug-22     | 35                  | 14.00%                | 37.44%            | 120.3        | 07-Jul-22         | 113.100    | No Operó                | No Operó | No Operó | -         | No Operó                   |

(\*) : TNA, para los cálculos se toma la última tasa de pases pasivos a 1 (TNA) día 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

