

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 / VN 100					
S31G2	28-Feb-22	31-Ago-22	8	100	19-Aug-22	98.850	1.16%	53.08%	69.51%	5	-2707 pbs
S30S2	31-Mar-22	30-Sep-22	38	100	19-Aug-22	95.200	5.04%	48.43%	60.40%	24	-3618 pbs
S31O2	23-May-22	31-Oct-22	69	100	19-Aug-22	90.300	10.74%	56.82%	71.56%	40	-2502 pbs
S30N2	16-Jun-22	30-Nov-22	99	100	19-Aug-22	84.900	17.79%	65.57%	82.86%	54	-1372 pbs
S28A3	15-Jul-22	28-Abr-23	248	100	11-Aug-22	77.510	No Operó	No Operó	No Operó	-	No Operó

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (*) Fecha: 19-Ago-22 Valor 69.50%

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 / VN 100				
X21O2	31-Dic-21	21-Oct-22	38.1829	59	143	19-Aug-22	147.600	-3.06%	-18.95%	-17.51%	72
X23N2	30-Jun-22	23-Nov-22	49.8495	92	110	19-Aug-22	113.000	-3.02%	-11.96%	-11.44%	104
X16D2	15-Mar-22	16-Dic-22	41.1508	115	133	19-Aug-22	136.450	-2.70%	-8.58%	-8.34%	125
X20E3	31-Ene-22	20-Ene-23	39.2005	150	139	19-Aug-22	140.750	-0.98%	-2.40%	-2.38%	154
X17F3	2-Mar-22	17-Feb-23	40.5435	178	135	19-Aug-22	135.500	-0.56%	-1.14%	-1.13%	180
X21A3	31-Mar-22	21-Abr-23	42.2380	241	129	19-Aug-22	128.900	0.34%	0.52%	0.52%	240
X19Y3	29-Abr-22	19-May-23	44.0271	269	124	19-Aug-22	123.400	0.56%	0.75%	0.76%	267

CER Fecha de cálculo 54.6315

(*): 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

