

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 Periodo	TNA	TIR	DM (días)	Rendimiento s/ Plazo Fijo (*)
					Fecha	\$ c/ VN 100					
S31O3	18-Jul-23	31-Oct-23	83	100	07-Aug-23	81.180	23.18%	101.95%	150.15%	33	-413 pbs
Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (*)			Fecha:	7-Ago-23	Valor		97.00%				

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 Periodo	TNA	TIR (*)	DM (días)
						Fecha	\$ c/ VN 100				
X18S3	30-Sep-22	18-Sep-23	59.4965	40	192.91	07-Aug-23	188.500	2.34%	21.33%	23.47%	32
X18O3	19-May-23	18-Oct-23	93.8582	70	122.28	07-Aug-23	119.650	2.20%	11.47%	12.02%	62
X23N3	31-May-23	23-Nov-23	96.2079	106	119.30	07-Aug-23	118.550	0.63%	2.17%	2.19%	104
CER Fecha de cálculo			114.7727								

(*): 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 VINCULADAS AL DOLAR

Especie	Fecha de Emisión	Fecha de Pago	Plazo al Vto (Días)	Monto al Vto	Cierre (PPT, T+2, C/100 vn)			Rendimiento del Periodo	TNA	TIR
					Fecha	ARS	USD (*)			
D31O3	20-Ene-23	31-Oct-23	83	100	07-Aug-23	33,550.0	60.904	64.71%	284.55%	797.41%

(*) El precio en dólares, que se utiliza para calcular la TIR, se obtiene dividiendo el precio en ARS, por el tipo de cambio implícito cable.

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

Aclaración: Todos los indicadores están calculados a fecha de liquidación

