

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					
S30J3	6-Ene-23	30-Jun-23	21	100	07-Jun-23	94.999	5.26%	91.50%	143.93%	9	-1035 pbs
S31L3	27-Mar-23	31-Jul-23	52	100	07-Jun-23	88.750	12.68%	88.98%	131.11%	23	-2317 pbs

Tasa mínima PF Sector Privado 30 d (*) Fecha: 7-Jun-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 Período	TNA	TIR (*)	DM (días)
						Fecha	\$ c/VN100				
X16J3	31-Ago-22	16-Jun-23	55.5275	7	177.37	07-Jun-23	177.765	-0.22%	-11.68%	-11.03%	8
X18L3	27-Mar-23	18-Jul-23	82.9314	39	118.76	07-Jun-23	119.680	-0.77%	-7.21%	-6.98%	42
X18S3	30-Sep-22	18-Sep-23	59.4965	101	165.53	07-Jun-23	167.700	-1.29%	-4.67%	-4.59%	106
X18O3	19-May-23	18-Oct-23	93.8582	131	104.93	07-Jun-23	106.200	-1.19%	-3.33%	-3.29%	135
X23N3	31-May-23	23-Nov-23	96.2079	167	102.37	07-Jun-23	103.050	-0.66%	-1.44%	-1.44%	169
CER Fecha de cálculo			98.4874								

(*): 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

