

### Rates

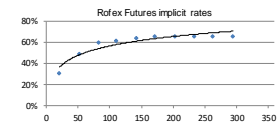
Instrumento	TNA	
Cautión 7d	23.10%	9/11/2021
Cautión 30d	34.15%	
BADLAR Priv. (>\$1mm)	34.25%	
TM20 Priv. (>\$20mm)	34.06%	8/11/2021
TFM - Leliqu 7D	38.00%	9/11/2021
Pases Pasivos 7D	36.50%	9/11/2021

### BCRA A3500 USD \$100,098

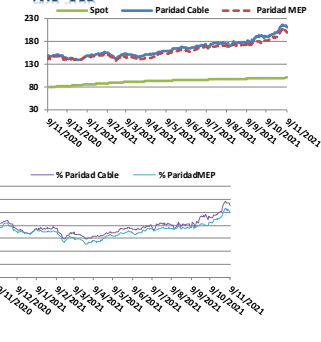
Days	00%Change	Annualized
7d	0.2%	13%
33d	1.2%	13%
61d	2.1%	12%
92d	3.2%	13%
186d	6.7%	13%
365d	26.2%	26%

### Rofef - ARS/USD Futures

Futures	Maturity	Days	USD	Rates	-d1	Ch	Op. I
SPOT	9/11/2021	-	100.10				
DLR112021	30/11/2021	21	101.86	30.6%	101.91	-0.05%	2.059
DLR122021	31/12/2021	52	107.03	48.6%	107.16	-0.12%	1.146
DLR012022	31/1/2022	83	113.70	59.8%	113.80	-0.09%	801
DLR022022	28/2/2022	111	118.75	61.3%	118.80	-0.04%	725
DLR032022	31/3/2022	142	125.06	64.1%	125.10	-0.03%	432
DLR042022	29/4/2022	171	130.80	65.5%	130.80	0.00%	75
DLR052022	31/5/2022	203	136.50	65.4%	136.50	0.00%	26
DLR062022	30/6/2022	233	142.00	65.6%	142.10	-0.11%	19
DLR072022	29/7/2022	262	147.25	65.6%	147.10	0.10%	15
DLR082022	31/8/2022	295	153.00	65.4%	152.70	0.20%	2



### ARS - USD



	\$	%
Spot	100.098	
Paridad Cable	211.04	110.83%
Paridad MEP	199.236	99.04%

El presente documento ha sido realizado por Argenfunds S.A. con fines estrictamente informativos. No debe ser tomado como una invitación a suscribir cuotas ni como una oferta de compra o venta de valores. El documento se ha realizado con fuentes de información consideradas confiables, pero la empresa no puede garantizar la exactitud de las mismas. Los fondos comunes de inversión están sometidos a variaciones en los precios de los activos que pueden afectar su rendimiento. Los rendimientos pasados de los fondos comunes de inversión no garantizan el desempeño futuro de los mismos. Las inversiones en cuotas partes del Fondo no constituyen depósitos en Banco Macro S.A. a los fines de la Ley de Entidades Financieras ni cuentan con ninguna de las garantías que tales depósitos a la vista o a plazo pueden gozar de acuerdo con la legislación y reglamentación aplicables en materia de depósitos en entidades financieras. Asimismo, Banco Macro S.A. se encuentra impedida por normas del Banco Central de la República Argentina de asumir, tácita o expresamente, compromiso alguno en cuanto al mantenimiento, en cualquier momento, del valor del capital invertido, al rendimiento, al valor del rescate de la cuota partes o al otorgamiento de liquidez a tal fin. Gráficos de Elaboración propia. Fuentes Rofef CAFCI y Bolsar

### Bonds

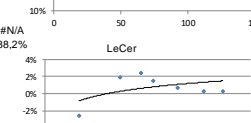
Bond	Code	Amt Out.	Coupon	Price	YTM	MD	Maturity
Sovereign Bond Inflation Indexed							

Bocon 24	PR13	473	2.00%	726.25	3.39%	1.17	15/3/2024
Boncor 03-22	TX22	277.922	1.20%	179.58	2.43%	0.34	18/3/2022
Boncor 09-22	TX22	342.185	1.30%	172.21	0.71%	0.85	20/9/2022
Boncor 23	TC23	28.300	4.00%	423.42	2.78%	1.27	6/3/2023
Boncor 03-23	TX23	286.479	1.40%	177.63	2.24%	1.35	25/3/2023
Boncor 08-23	TX23	289.867	1.45%	160.41	2.49%	1.71	13/8/2023
Boncor 03-24	TX24	333.254	1.40%	172.09	3.28%	2.30	25/3/2024
Boncor 04-25	TC25P	29.908	4.00%	373.12	6.23%	3.16	27/4/2025
Boncor 11-26	TX26	66.300	2.00%	135.63	6.54%	3.70	9/11/2026
Boncor 11-28	TX28	9.243	2.25%	132.00	6.82%	4.25	9/11/2028
Dis-ARL 05	DICP	10.563	5.83%	2.769.9	8.75%	5.32	31/12/2033
Par ARL 05	PARP	2.861	1.77%	1.115.44	10.10%	9.47	31/12/2038
C-Par ARL 05	CIAP	23.668	3.31%	1.589.57	9.95%	10.52	31/12/2045

Sovereign ARS Floating Badlar							
Bocon 22	PR15	1.930	0.00%	59.20	50.35%	0.46	4/10/2022
Bonar Abr 22	A422	53.625	2.00%	101.65	49.06%	0.33	4/4/2022
Bonar Abr 22	TB23P	31.321	5.25%	101.65	47.69%	0.92	6/2/2023
Sub-Sovereign ARS Floating Badlar							
BP +							
CABA TD C20	BDC22	3.708	5.00%	102.33	42.73%	0.18	24/1/2022
CABA TD C24	BDC24	22.614	3.25%	93.95	52.78%	1.38	29/3/2024
CABA TD C28	BDC28	13.262	3.75%	92.60	54.03%	1.87	22/2/2028
PBA TD 2022	PHY22	15.182	3.83%	102.59	58.06%	0.42	31/5/2022
PBA TD 2025	PBA25	30.000	3.75%	84.85	58.91%	1.61	14/4/2025
Salta 2021	SA21	400	5.00%	104.64	53.02%	0.10	22/12/2021
Salta Fe TD S1	SFA23						14/4/2023

Sovereign ARS Fixed								
Ded. 10.7%								
Bonte \$ May 22	TY22P	249.021	22.00%	108.57	27.99%	0.42	23/5/2022	
Bonte \$ Oct 23	TO23	64.150	16.00%	62.13	55.61%	1.29	17/10/2023	
Bonte \$ Oct 26	TO26	96.570	15.50%	69.63	56.13%	2.11	19/10/2026	
Ledes ARS 25.7%								
SN011		119.573		98.10	37.13%	19	30/11/2021	
S31D1		213.492		94.28	44.31%	50	31/12/2021	
S31E2		168.831		91.40	42.38%	81	31/1/2022	
S28F2		98.337		88.51	43.48%	109	28/2/2022	
S31M2		76.800		85.55	44.04%	140	31/3/2022	
Lepasas ARS								
SN301		19	22.712	3.00%	111.10	3.15%	0.05	30/11/2021

Lecer ARS Inflation Indexed							
X31D1		37.641		114.58	-2.51%	50	31/12/2021
X28F2		192.468		130.23	1.96%	109	28/2/2022
X31M2		107.562		127.72	2.45%	140	31/3/2022
X18A2		137.598		125.17	1.53%	158	18/4/2022
X23E2		178.119		119.92	0.69%	193	23/5/2022
X30J2		187.954		113.99	0.26%	231	30/6/2022
X29L2		152.000		109.50	0.33%	260	29/7/2022



### Corporate USD\*

Code	Amt Out.	Coupon	Price	YTM	MD	Maturity
Transener 2021**						
OTR98	101	9.750%	SD	N.A.	N.A.	15/8/2021
CGC 2021**						
CGC 2021**	300	9.500%	100.04	N.A.	N.A.	7/11/2021
Genesise 2022**						
GNCL0	500	8.750%	99.46	11.86%	0.18	20/1/2022
Edenor 2022**						
ODNX9	176	9.750%	91.37	21.16%	0.84	25/10/2022
AYSA 2023**						
AYSA23**	500	6.625%	56.56	71.88%	0.85	1/2/2023
Clisa 2023**						
CLIS0	300	9.500%	45.48	80.54%	1.05	20/7/2023
Tepcelor 2022**						
TTC10	500	4.875%	100.34	4.60%	1.03	12/12/2022
YPF 2024						
YPCU0	1.325	8.750%	88.70	18.83%	1.22	4/4/2024
IRSA Prop. 2023**						
RPC20	360	8.750%	96.11	12.30%	1.22	23/3/2023
Cresud 2023						
CSD00	113	6.500%	98.00	9.75%	1.16	16/2/2023
YPF 03-2025						
YMCEO	N.A.	8.750%	89.71	15.86%	1.53	23/3/2025
Albanesi 2023**						
GMFR0	336	9.625%	82.65	23.73%	1.39	27/7/2023
Pampa 2023**						
PTST0	491	7.375%	96.11	10.18%	1.51	21/7/2023
Acor 2023**						
RC090	500	6.000%	97.61	7.72%	1.50	6/7/2023
AERAO 2022**						
AERAO	375	6.875%	83.44	15.80%	2.18	1/2/2022
CGC 2025**						
CP170	197	9.500%	99.24	10.12%	1.97	8/9/2025
AES Arg. G. 2024**						
AECA0	300	7.750%	87.32	15.13%	1.89	2/2/2024
Raghsa 2024**						
RA310	120	7.250%	95.32	9.74%	2.08	21/3/2024
Capex 2024**						
CAC20	389	6.875%	95.44	9.15%	2.16	15/5/2024
Telecom 2025**						
TLC50	300	8.000%	97.69	9.18%	2.32	6/8/2025
YPF 2025						
YCA60	1.500	8.500%	78.31	17.22%	2.85	28/7/2025
TGS 2025**						
TSC20	500	6.750%	93.64	9.12%	3.07	2/5/2025
Telecom 2026**						
TL10	400	8.000%	93.74	9.93%	3.69	18/7/2026
Galicia 2026**						
BYC20	250	8.250%	96.38	8.26%	3.80	19/7/2026
Macro 2026**						
BACAO	400	6.750%	84.65	11.10%	4.07	4/11/2026
YPF 2027						
YCAM0	1.000	6.950%	69.88	15.56%	4.13	21/7/2027
Pampa 2027**						
MGC10	690	7.500%	87.75	10.90%	4.02	24/1/2027
YPF 2028**						
YMC10	500	8.500%	74.89	14.43%	5.86	27/6/2028
YPF 2047**						
YCAN0	750	7.000%	64.01	11.63%	8.51	15/12/2047

\*\* Dirty Price

\*\* Callable Bond - Yield to Maturity

\*\* Dirty Price

\*\* Callable Bond - Yield to Maturity

