

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS

AL 30.09.16 Y AL 31.12.15

(Cifras expresadas en miles de pesos)

Hoja 1 de 6

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			
Títulos Públicos a valor razonable de mercado			1,362,232	1,016,960	1,447,034	-	1,447,034
Del País			239,903	305,052	239,903	-	239,903
. Bonar 2017	AA17	-	96,513	26,632	96,513	-	96,513
. Bonar 2024	AY24	-	68,826	-	68,826	-	68,826
. Bono Buenos Aires 9,95	PBJ21	-	19,670	-	19,670	-	19,670
. Bono Ciudad de Buenos Aires 8,95	CABA2021	-	18,199	-	18,199	-	18,199
. Bonar 2026	AA26D	-	18,032	-	18,032	-	18,032
. Bono de la Nacion Argentina Septiembre 2016	AS16	-	-	226,730	-	-	-
. Bono de la Nacion Argentina Julio 2016	AL16	-	-	18,821	-	-	-
. Otros			18,663	32,869	18,663	-	18,663
Del Exterior			1,122,329	711,908	1,207,131	-	1,207,131
. Treasury Bill			380,365	-	380,365		380,365
. Letras Financieras del Tesoro de Brasil	LFT	-	277,452	276,491	277,452	-	277,452
. Bono Global Uruguay 2022		-	122,773	98,246	122,773	-	122,773
. US TIP		-	103,410	158,295	188,212	-	188,212
. US Treasury		-	61,408	52,367	61,408	-	61,408
. US Strip		-	26,007	20,447	26,007	-	26,007
. Bono CAF 2019		-	25,263	21,517	25,263	-	25,263
. Bono BLX 2017		-	23,500	19,973	23,500	-	23,500
. Otros			102,151	64,572	102,151	-	102,151

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

(Socio)

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS

AL 30.09.16 Y AL 31.12.15

(Cifras expresadas en miles de pesos)

Hoja 2 de 6

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			
Títulos Públicos a costo más rendimiento			6.155,474	6.980,433	6.156,031	-	6.156,031
Del País			5,957,665	6,811,232	5,958,222	-	5,958,222
. Bonos Garantizados	NF18	5,266,769	5,672,115	6,648,268	5,672,672	-	5,672,672
. Letras del Tesoro en dólares Octubre 2016	LTDO6	151,574	151,757	-	151,757	-	151,757
. Bonar 2019	AMX9	100,093	95,631	97,246	95,631	-	95,631
. Bono de la Provincia de Bs. As. Caja de Jubilaciones	CJUBI	56,721	23,398	36,073	23,398	-	23,398
. Letras del Tesoro en dólares Julio 2017	LTDL7	7,162	7,398	-	7,398	-	7,398
. Letras del Tesoro en dólares Enero 2017	LTDE7	7,189	7,296	-	7,296	-	7,296
. Letras Provincia de Chubut	BU2M6	-	-	29,575	-	-	-
. Bono de la Provincia de Bs.As. Enero 2017	PBE17	67	70	70	70	-	70
Del Exterior			197,809	169,201	197,809	-	197,809
. Letras del Tesoro Nacional de Brasil	LTN		196,523	100,204	196,523	-	196,523
. Notas del Tesoro Nacional de Brasil	NTN		-	68,997	-	-	-
. Bonos CJYPB	CJYPB		1,286	-	1,286	-	1,286

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

(Socio)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.16 Y AL 31.12.15
(Cifras expresadas en miles de pesos)

Hoja 3 de 6

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			
Instrumentos Emitidos por el BCRA			24,824,428	8,893,986	24,638,662	-	24,638,662
Letras del B.C.R.A a Valor Razonable de Mercado			-	627,318	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - con cotización - cartera propia	L06E6		-	149,227	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - con cotización - cartera propia	L27E6		-	144,895	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - con cotización - cartera propia	L24F6		-	143,057	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - con cotización - cartera propia	L17F6		-	95,839	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - con cotización - cartera propia	L16M6		-	94,300	-	-	-
					-	-	-
Letras del B.C.R.A por Operaciones de Pase			185,766	562,419	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - por operaciones de pase	I18E7		185,766	-	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - por operaciones de pase	L11Y6		-	562,419	-	-	-
Letras del B.C.R.A a Costo más Rendimiento			24,638,662	7,704,249	24,638,662	-	24,638,662
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I26O6		6,612,481	-	6,612,481	-	6,612,481

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

(Socio)

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1



DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.16 Y AL 31.12.15
(Cifras expresadas en miles de pesos)

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			

Instrumentos Emitidos por el BCRA

. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I05O6	6,600,105	-	6,600,105	-	6,600,105
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I23N6	2,889,451	-	2,889,451	-	2,889,451
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I12O6	2,825,070	-	2,825,070	-	2,825,070
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I16N6	1,934,608	-	1,934,608	-	1,934,608
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I19O6	1,781,392	-	1,781,392	-	1,781,392
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I02N6	991,479	-	991,479	-	991,479
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	I30N6	958,523	-	958,523	-	958,523
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	H05O6	19,929	-	19,929	-	19,929
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U12O6	7,624	6,298	7,624	-	7,624
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U27E6	-	1,564,260	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	H06A6	-	1,432,070	-	-	-
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	H24F6	-	954,018	-	-	-

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

(Socio)

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1



DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.16 Y AL 31.12.15
(Cifras expresadas en miles de pesos)

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			
Instrumentos Emitidos por el BCRA							
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	X03F6	-	933,677	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U26G5	-	645,080	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U30M6	-	635,384	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U06E6	-	344,845	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U20E6	-	218,743	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U16M6	-	206,894	-	-	-	
. Letras del B.C.R.A. - sin cotización - cartera propia	U13E6	-	135,930	-	-	-	
. Otros		18,000	627,050	18,000	-	18,000	
TOTAL DE TITULOS PUBLICOS			32,342,134	16,891,379	32,241,727	-	32,241,727

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

(Socio)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS

AL 30.09.16 Y AL 31.12.15

(Cifras expresadas en miles de pesos)

Hoja 6 de 6

DENOMINACION	IDENTIFICACION	TENENCIA			POSICION SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICION FINAL
		VALOR DE MERCADO	SALDOS LIBROS 30.09.16	SALDOS LIBROS 31.12.15			
Inversiones en Títulos Privados con Cotización			<u>320,518</u>	<u>230,565</u>	<u>320,518</u>	-	<u>320,518</u>
Representativo de Capital			320,518	230,565	320,518	-	320,518
Del País			-	8	-	-	-
. Acciones Alto Palermo	IRSA		-	8	-	-	-
Del Exterior			320,518	230,557	320,518	-	320,518
. UBS 2017			45,840	38,876	45,840	-	45,840
. Credit Suisse 2017			38,171	32,366	38,171	-	38,171
. Bono Barclays 2017			29,305	25,211	29,305	-	29,305
. Bono StanIn 2017			29,185	25,944	29,185	-	29,185
. Yankee Certificate of Deposit			24,467	-	24,467	-	24,467
. Bono Bac 6			23,391	20,729	23,391	-	23,391
. Deutsch 2017			20,077	17,157	20,077	-	20,077
. Bank Tokyo 2,35 2017			16,835	14,454	16,835	-	16,835
. Yanqui CDS Banco Do Brasil			15,404	-	15,404	-	15,404
. Santander 2017			15,304	12,840	15,304	-	15,304
. Santander 2018			14,924	12,617	14,924	-	14,924
. Otros			47,615	30,363	47,615	-	47,615
TOTAL DE TITULOS PRIVADOS			<u>320,518</u>	<u>230,565</u>	<u>320,518</u>	-	<u>320,518</u>
TOTAL DE TITULOS PUBLICOS Y PRIVADOS			<u>32,662,652</u>	<u>17,121,944</u>	<u>32,562,245</u>	-	<u>32,562,245</u>

Véase nuestro informe de fecha
10 de Noviembre de 2016
PRICE WATERHOUSE & CO. S.R.L.

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
a/c Gerencia General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

(Socio)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 33 Leg. 33
Dr. Alejandro P. Frechou
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.B.A. Tomo 154 – Folio 165
Legajo N° 40.051/3
CUIT 20 - 13565011 - 1