

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 1 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos de deuda a valor razonable con cambios en resultados				246,849,747	268,073,515	246,849,747	-	246,849,747
Del País				246,849,747	268,073,515	246,849,747	-	246,849,747
Títulos Públicos				76,966,974	37,571,749	76,966,974	-	76,966,974
. Bono Tesoro Nacional Mayo 2022	TY22P		2	36,982,332	35,919,671	36,982,332	-	36,982,332
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Junio 2022	X30J2		1	9,424,214	-	9,424,214	-	9,424,214
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Marzo 2022	X31M2		1	6,779,227	-	6,779,227	-	6,779,227
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Mayo 2022	X23Y2		1	6,658,933	-	6,658,933	-	6,658,933
. Letras del Tesoro Nacional a descuento Noviembre 2021	S30N1		1	4,672,275	-	4,672,275	-	4,672,275
. Letras del Tesoro Nacional a descuento Enero 2022	S31E2		1	3,731,760	-	3,731,760	-	3,731,760
. Bono Tesoro Nacional vinculado al Dólar Abril 2022	TV22		1	3,419,996	1,556,775	3,419,996	-	3,419,996
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Diciembre 2021	X31D1		1	2,636,527	-	2,636,527	-	2,636,527
. Letras del Tesoro Nacional a descuento Diciembre 2021	S31D1		1	1,473,298	-	1,473,298	-	1,473,298
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Julio 2022	X29L2		1	1,025,022	-	1,025,022	-	1,025,022
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Abril 2022	X18A2		1	89,588	-	89,588	-	89,588
. Bonar USD Step Up 2030	AL30		1	67,917	88,257	67,917	-	67,917
. Bonar USD 2029	AL29		1	5,771	6,865	5,771	-	5,771
. Título vinculado al PBI en pesos	TVPP		1	114	181	114	-	114

 Véase nuestro informe de fecha
 25 de noviembre de 2021
 KPMG

 Cr. Alejandro A. García
 Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
 Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
 Presidente

 (Socia)
 C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F°193 Leg. 193
 María Gabriela Saavedra
 Contadora Pública (U.N.S.)
 C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
 Legajo N°44622/0
 CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 2 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
<u>Letras B.C.R.A.</u>				<u>169,882,773</u>	<u>230,501,766</u>	<u>169,882,773</u>	-	<u>169,882,773</u>
. Letras del B.C.R.A.	Y05O1		1	26,623,884	-	26,623,884	-	26,623,884
. Letras del B.C.R.A.	Y12O1		1	25,410,645	-	25,410,645	-	25,410,645
. Letras del B.C.R.A.	Y14O1		1	22,550,673	-	22,550,673	-	22,550,673
. Letras del B.C.R.A.	Y26O1		2	21,607,988	-	21,607,988	-	21,607,988
. Letras del B.C.R.A.	Y07O1		2	20,855,056	-	20,855,056	-	20,855,056
. Letras del B.C.R.A.	Y19O1		2	20,183,752	-	20,183,752	-	20,183,752
. Letras del B.C.R.A.	Y21O1		1	20,151,148	-	20,151,148	-	20,151,148
. Letras del B.C.R.A.	Y28O1		2	12,499,627	-	12,499,627	-	12,499,627
. Letras del B.C.R.A.	Y19E1		1	-	35,916,054	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y14E1		2	-	29,142,938	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y21E1		2	-	28,273,914	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y05E1		1	-	27,992,096	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y12E1		1	-	27,812,398	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y26E1		2	-	27,418,093	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y28E1		2	-	27,389,262	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y07E1		2	-	26,557,011	-	-	-

 Véase nuestro informe de fecha
 25 de noviembre de 2021
 KPMG

 Cr. Alejandro A. García
 Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
 Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
 Presidente

 (Socia)
 C.P.C.E.P.B.A. Tº 1 Fº193 Leg. 193
 María Gabriela Saavedra
 Contadora Pública (U.N.S.)
 C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
 Legajo N°44622/0
 CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 3 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Otros Títulos de deuda (*)				48.768.772	71.516.136	48.768.772	-	48.768.772
<u>Medidos a valor razonable con cambios en ORI</u>				5.062.994	5.335.283	5.062.994	-	5.062.994
Del País				2.652.856	883.973	2.652.856	-	2.652.856
Títulos Públicos				1.245.288	337.828	1.245.288	-	1.245.288
. Bono del Tesoro Nacional vinculado al USD Noviembre 2022	T2V2		1	912,638	-	912,638	-	912,638
. Bonos del Tesoro Nacional Ajustado por CER + 1,45% Agosto 2023	T2X3		1	195,044	-	195,044	-	195,044
. Bonos del Tesoro Nacional Ajustado por CER + 1,3% Septiembre 2022	T2X2		1	131,266	-	131,266	-	131,266
. Bono Par 2038	PARP		1	3,317	3,228	3,317	-	3,317
. Bocon 2024	PR13		1	3,023	3,931	3,023	-	3,023
. Boncer 2021	TC21		1	-	330,669	-	-	-
Títulos Privados (Nota 7)				1.407.568	546.145	1.407.568	-	1.407.568
. Obligaciones negociables Pan American Energy	PN7CO		1	351,798	361,553	351,798	-	351,798
. Obligaciones negociables CT BARRAGAN UVA - Clase II	TBC2O		1	317,876	-	317,876	-	317,876
. Obligaciones negociables YPF UVA - Clase XIX	55218		2	233,676	-	233,676	-	233,676
. Obligaciones negociables YPF Dólar linked - Clase XIV	55072		1	199,260	-	199,260	-	199,260
. Obligaciones negociables ALUAR	LMS30		1	170,481	184,592	170,481	-	170,481
. Obligaciones negociables PROFERTIL USD - Clase I	PFC1O		1	101,289	-	101,289	-	101,289
. Obligaciones Negociables San Miguel	SNS6O		1	33,188	-	33,188	-	33,188
(*) No incluye Provisiones Títulos privados por \$ 424.918 al 30.09.2021 y \$ 237.676 al 31.12.2020 - Según Anexo "R"								

 Véase nuestro informe de fecha
 25 de noviembre de 2021
 KPMG

 Cr. Alejandro A. García
 Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
 Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
 Presidente

 (Socia)
 C.P.C.E.P.B.A. Tº 1 Fº193 Leg. 193
 María Gabriela Saavedra
 Contadora Pública (U.N.S.)
 C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
 Legajo N°44622/0
 CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 4 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Del Exterior				<u>2,410,138</u>	<u>4,451,310</u>	<u>2,410,138</u>	-	<u>2,410,138</u>
Títulos Públicos				<u>1,974,161</u>	<u>3,599,366</u>	<u>1,974,161</u>	-	<u>1,974,161</u>
. Treasury Bill Octubre 2021			1	1,974,161	-	1,974,161	-	1,974,161
. Treasury Bill Enero 2021			1	-	3,599,366	-	-	-
Títulos Privados				<u>435,977</u>	<u>851,944</u>	<u>435,977</u>	-	<u>435,977</u>
. Banco Santander España 2022			1	199,961	235,978	199,961	-	199,961
. Barclays 2023			1	169,140	199,227	169,140	-	169,140
. Royal Bank of Scotland 2023			1	66,876	78,639	66,876	-	66,876
. Citi Group 2023			1	-	135,468	-	-	-
. Wells Fargo Enero 2023			1	-	116,968	-	-	-
. Goldman Sachs 2023			1	-	85,664	-	-	-

 Véase nuestro informe de fecha
 25 de noviembre de 2021
 KPMG

 Cr. Alejandro A. García
 Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
 Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
 Presidente

 (Socia)
 C.P.C.E.P.B.A. Tº 1 Fº193 Leg. 193
 María Gabriela Saavedra
 Contadora Pública (U.N.S.)
 C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
 Legajo N°44622/0
 CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 5 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
<u>Medición a costo amortizado</u>		<u>33,547,628</u>		<u>43,705,778</u>	<u>66,180,853</u>	<u>43,705,778</u>	-	<u>43,705,778</u>
Del País		<u>30,743,346</u>		<u>40,893,060</u>	<u>63,249,608</u>	<u>40,893,060</u>	-	<u>40,893,060</u>
Títulos públicos		<u>30,357,171</u>		<u>40,177,725</u>	<u>61,938,398</u>	<u>40,177,725</u>	-	<u>40,177,725</u>
. Bonar USD Step up 2035	AL35	14,469,705	1	23,615,468	27,484,492	23,615,468	-	23,615,468
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Julio 2022	X29L2	5,071,672	1	5,088,214	-	5,088,214	-	5,088,214
. Bono de la Provincia de Bs. As. Caja de Jubilaciones 2023	32880	4,253,258	3	4,447,180	9,045,473	4,447,180	-	4,447,180
. Bono de la Provincia de Bs. As. Enero 2024	42047	3,345,426	3	3,410,708	5,451,187	3,410,708	-	3,410,708
. Bono de la Provincia de Bs. As. Julio 2024	42269	1,723,263	2	1,920,951	2,435,529	1,920,951	-	1,920,951
. Letras del Tesoro Provincia de Bs. As.en pesos Diciembre 2021	42368	1,329,465	2	1,351,118	-	1,351,118	-	1,351,118
. Bono Provincia de Buenos Aires Regs New USD 2037	BA37D	56,907	1	111,113	-	111,113	-	111,113
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2035	GD35	30,896	1	99,560	113,829	99,560	-	99,560
. Bonos de consolidación 8° Serie	PR15	54,363	2	71,962	144,380	71,962	-	71,962
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2030	GD30	18,882	1	52,663	61,546	52,663	-	52,663
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2029	GD29	3,334	1	8,788	10,325	8,788	-	8,788
. Bonos del Tesoro Nacional en pesos Agosto 2021	TB21	-	1	-	6,403,788	-	-	-
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Febrero 2021	X26F1	-	1	-	5,539,756	-	-	-
. Letras del Tesoro Nacional en pesos a descuento Febrero 2021	S26F1	-	1	-	5,076,551	-	-	-
. Bono Buenos Aires 9,95	PBJ21	-	1	-	129,343	-	-	-
. Bono Ciudad de Buenos Aires 8,95	CABA2021	-	1	-	42,199	-	-	-

 Véase nuestro informe de fecha
25 de noviembre de 2021
KPMG

 Cr. Alejandro A. García
Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
Presidente

 (Socia)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F°193 Leg. 193
María Gabriela Saavedra
Contadora Pública (U.N.S.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
Legajo N°44622/0
CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 6 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos Privados		<u>386,175</u>		<u>715,335</u>	<u>1,311,210</u>	<u>715,335</u>	-	<u>715,335</u>
. Fideicomiso Financiero Vicentin Exportaciones VIII - Clase A	VC08A	21,834	2	436,689	509,680	436,689	-	436,689
. Obligaciones Negociables ON NEWSAN CL. 9	WNC9O	155,182	2	155,362	-	155,362	-	155,362
. Obligaciones Negociables CRESUD CL. 33 Julio 2024	CSKZO	187,941	2	100,346	-	100,346	-	100,346
. Obligaciones Negociables AA2000 2027	81192	15,534	2	17,254	21,599	17,254	-	17,254
. Certificado de Participación Fondo Fiduciario Fuerza Solidario Clase A	TRVA1	5,684	2	5,684	7,329	5,684	-	5,684
. Obligaciones Negociables Pampa Energía	MGC6O	-	2	-	425,003	-	-	-
. Obligaciones Negociables Newsan Clase VI	WNC6O	-	2	-	210,579	-	-	-
. Obligaciones Negociables CRESUD CL.25 Julio 2021	CSFQO	-	2	-	120,148	-	-	-
. Fideicomiso Financiero NASA	TNA1	-	2	-	16,872	-	-	-
Del Exterior		<u>2,804,282</u>		<u>2,812,718</u>	<u>2,931,245</u>	<u>2,812,718</u>	-	<u>2,812,718</u>
Títulos públicos		<u>696,802</u>		<u>809,350</u>	<u>983,905</u>	<u>809,350</u>	-	<u>809,350</u>
. Global 2022		193,015	1	312,165	373,504	312,165	-	312,165
. Letras Financieras del Tesoro		299,137	1	299,137	374,314	299,137	-	299,137
. Global 2024		192,342	1	185,740	223,080	185,740	-	185,740
. Bonos Caja de JYPB		12,308	2	12,308	13,007	12,308	-	12,308
Títulos privados		<u>2,107,480</u>		<u>2,003,368</u>	<u>1,947,340</u>	<u>2,003,368</u>	-	<u>2,003,368</u>
. Macquarie Bank 2025		255,207	1	238,651	278,057	238,651	-	238,651
. Santander UK Group Holdings 2025		215,055	1	209,499	52,281	209,499	-	209,499
. Banco Nacional de Desenvolvimento Económico e Social 2024		216,584	1	204,935	238,467	204,935	-	204,935

 Véase nuestro informe de fecha
25 de noviembre de 2021
KPMG

 Cr. Alejandro A. García
Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
Presidente

 (Socia)
C.P.C.E.P.B.A. Tº 1 Fº193 Leg. 193
María Gabriela Saavedra
Contadora Pública (U.N.S.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
Legajo N°44622/0
CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS
AL 30.09.21 Y AL 31.12.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.c)

Hoja 7 de 7

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 30.09.21	SALDO DE LIBROS 31.12.20	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos privados								
. BBVA Bancomer 2022		207,951	1	202,481	245,300	202,481	-	202,481
. Credit Suisse 2023		207,566	1	199,449	241,736	199,449	-	199,449
. Banco Do Brasil 2025		211,091	1	194,729	229,655	194,729	-	194,729
. Banco de Credito del Perú 2025		189,211	1	190,965	-	190,965	-	190,965
. ABN AMRO 2026		181,448	1	169,728	198,016	169,728	-	169,728
. Danske Bank 2024		136,855	1	127,395	152,076	127,395	-	127,395
. HSBC Holdings plc 2026		128,548	1	116,860	135,646	116,860	-	116,860
. ABN AMRO 2025		110,473	1	100,789	119,778	100,789	-	100,789
. BBVA Colombia 2025		47,491	1	47,887	56,328	47,887	-	47,887
Instrumentos de Patrimonio		3,247,088		3,247,088	3,462,644	3,247,088	-	3,247,088
<i>Medidos a valor razonable con cambios en resultados</i>		3,247,088		3,247,088	3,462,644	3,247,088	-	3,247,088
Del País		1,715,254		1,715,254	1,871,474	1,715,254	-	1,715,254
. Prisma Medios de Pago S.A.		1,693,495	3	1,693,495	1,849,528	1,693,495	-	1,693,495
. Mercado Abierto Electrónico S.A.		21,759	3	21,759	21,946	21,759	-	21,759
Del Exterior		1,531,834		1,531,834	1,591,170	1,531,834	-	1,531,834
. Bladex S.A.		1,531,720	2	1,531,720	1,591,028	1,531,720	-	1,531,720
. Swift Bélgica		114	3	114	142	114	-	114
TOTAL DE TITULOS PUBLICOS Y PRIVADOS				298,865,607	343,052,295	298,865,607	-	298,865,607

 Véase nuestro informe de fecha
25 de noviembre de 2021
KPMG

 Cr. Alejandro A. García
Subcontador General

 Cr. Rubén O. González Ocantos
Gerente General

 Lic. Juan M. Cuattromo
Presidente

 (Socia)
C.P.C.E.P.B.A. Tº 1 Fº193 Leg. 193
María Gabriela Saavedra
Contadora Pública (U.N.S.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
Legajo N°44622/0
CUIT 27-22976216-3