

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS

AL 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos de deuda a valor razonable con cambios en resultados				519,845,994	241,827,705	519,845,994	-	519,845,994
Del País				519,845,994	241,827,705	519,845,994	-	519,845,994
Títulos Públicos				85,812,972	93,975,682	85,812,972	-	85,812,972
. Bono Tesoro Nacional Mayo 2022	TY22P		2	44,583,012	47,292,931	44,583,012	-	44,583,012
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Junio 2022	X30J2		1	8,105,535	8,731,729	8,105,535	-	8,105,535
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Enero 2023	X20E3		1	5,812,899	-	5,812,899	-	5,812,899
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Agosto 2022	X16G2		1	4,587,976	3,650,980	4,587,976	-	4,587,976
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Febrero 2023	X17F3		1	3,994,473	-	3,994,473	-	3,994,473
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Mayo 2022	X23Y2		1	3,935,511	8,613,634	3,935,511	-	3,935,511
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Octubre 2022	X21O2		1	3,334,860	-	3,334,860	-	3,334,860
. Bono Tesoro Nacional vinculado al Dólar Abril 2022	TV22		1	2,784,564	4,186,924	2,784,564	-	2,784,564
. Bonos del Tesoro Nacional Ajustado por CER + 1,3% Septiembre 2022	T2X2		1	2,472,285	2,518,169	2,472,285	-	2,472,285
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Diciembre 2022	X16D2		1	1,296,673	-	1,296,673	-	1,296,673
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Marzo 2022	X31M2		1	-	8,537,473	-	-	-
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Diciembre 2021	X31D1		1	-	3,339,620	-	-	-
. Otros				4,905,184	7,104,222	4,905,184	-	4,905,184

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Letras B.C.R.A.				416,768,122	147,852,023	416,768,122	-	416,768,122
. Letras del B.C.R.A.	Y21A2		2	90,855,805	-	90,855,805	-	90,855,805
. Letras del B.C.R.A.	Y12A2		2	50,885,547	-	50,885,547	-	50,885,547
. Letras del B.C.R.A.	Y05A2		1	46,213,801	-	46,213,801	-	46,213,801
. Letras del B.C.R.A.	Y07A2		2	46,073,796	-	46,073,796	-	46,073,796
. Letras del B.C.R.A.	Y26A2		2	40,094,060	-	40,094,060	-	40,094,060
. Letras del B.C.R.A.	Y28A2		1	39,999,541	-	39,999,541	-	39,999,541
. Letras del B.C.R.A.	Y13A2		2	35,536,768	-	35,536,768	-	35,536,768
. Letras del B.C.R.A.	Y19A2		2	35,322,768	-	35,322,768	-	35,322,768
. Letras del B.C.R.A.	Y13L2		2	31,786,036	-	31,786,036	-	31,786,036
. Letras del B.C.R.A.	Y04E2		2	-	21,389,635	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y06E2		2	-	21,345,429	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y20E2		2	-	19,872,158	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y18E2		2	-	19,326,560	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y11E2		2	-	17,696,788	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y13E2		2	-	17,660,469	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y25E2		1	-	17,445,418	-	-	-
. Letras del B.C.R.A.	Y27E2		2	-	13,115,566	-	-	-
Notas B.C.R.A.				17,264,900	-	17,264,900	-	17,264,900
. Notas del B.C.R.A.	N21S2		1	5,053,500	-	5,053,500	-	5,053,500
. Notas del B.C.R.A.	N28S2		1	5,031,500	-	5,031,500	-	5,031,500
. Notas del B.C.R.A.	N14S2		1	3,056,700	-	3,056,700	-	3,056,700
. Notas del B.C.R.A.	N31G2		1	2,068,800	-	2,068,800	-	2,068,800
. Notas del B.C.R.A.	N07S2		2	2,054,400	-	2,054,400	-	2,054,400

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 Nº44622/0
CUIT 27-22976216-3

DETALLE DE TÍTULOS PÚBLICOS Y PRIVADOS

AL 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Otros Títulos de deuda (*)				52,003,919	55,152,249	52,003,919	-	52,003,919
<u>Medidos a valor razonable con cambios en ORI</u>				4,699,604	4,518,133	4,699,604	-	4,699,604
Del País				3,102,389	2,799,988	3,102,389	-	3,102,389
Títulos Públicos				839,655	897,219	839,655	-	839,655
. Bono del Tesoro Nacional vinculado al USD Noviembre 2022	T2V2		1	398,157	449,930	398,157	-	398,157
. Bonos del Tesoro Nacional Ajustado por CER + 1,45% Agosto 2023	T2X3		1	263,393	266,250	263,393	-	263,393
. Bonos del Tesoro Nacional Ajustado por CER + 1,3% Septiembre 2022	T2X2		1	168,573	171,701	168,573	-	168,573
. Bono Par 2038	PARP		1	6,341	5,747	6,341	-	6,341
. Bocon 2024	PR13		1	3,191	3,591	3,191	-	3,191
Títulos Privados (Nota 7)				2,262,734	1,902,769	2,262,734	-	2,262,734
. Obligaciones negociables CT BARRAGAN UVA - Clase II	TBC2O		1	430,631	442,882	430,631	-	430,631
. Obligaciones negociables Pan American Energy	PN7CO		1	377,972	458,498	377,972	-	377,972
. Obligaciones negociables YPF UVA - Clase XIX	55218		2	317,166	331,860	317,166	-	317,166
. Obligaciones negociables CIA GRAL COMB Clase XXIV USD	CP24O		1	276,724	-	276,724	-	276,724
. Obligaciones negociables YPF Dólar linked - Clase XIV	55072		1	230,002	252,803	230,002	-	230,002
. Obligaciones negociables ALUAR	LMS30		1	187,718	208,778	187,718	-	187,718
. Obligaciones negociables NEWSAN Clase 11 \$ C.G Venc.24/02/2023	WNCBO		2	152,040	-	152,040	-	152,040

(*) No incluye Provisiones Títulos privados por \$ 478.634 al 31.03.2022 y \$ 513.381 al 31.12.2021 - Según Anexo "R"

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 31.03.22 Y AL 31.12.21

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

CONCEPTO	IDENTIFICACION	TENENCIA				POSICIÓN		
		VALOR RAZONABLE	NIVEL DE VALOR RAZONABLE	SALDO DE LIBROS 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
. Obligaciones negociables PROFERTIL USD - Clase I	PFC1O		2	114,763	127,467	114,763	-	114,763
. Obligaciones negociables AA2000	AER6O		2	105,566	-	105,566	-	105,566
. Obligaciones negociables San Miguel	SNS6O		1	35,502	38,922	35,502	-	35,502
. Obligaciones negociables BARRAGAN - Clase IV	TBC4O		1	34,650	41,559	34,650	-	34,650
Del Exterior				<u>1,597,215</u>	<u>1,718,145</u>	<u>1,597,215</u>	-	<u>1,597,215</u>
Títulos Públicos				<u>1,299,853</u>	<u>1,193,534</u>	<u>1,299,853</u>	-	<u>1,299,853</u>
. Treasury Bill Mayo 2022			1	746,590	-	746,590	-	746,590
. Treasury Bill Agosto 2022			1	553,263	-	553,263	-	553,263
. Treasury Bill Enero 2022			1	-	1,193,534	-	-	-
Títulos Privados				<u>297,362</u>	<u>524,611</u>	<u>297,362</u>	-	<u>297,362</u>
. Banco Santander España 2022			1	222,821	240,418	222,821	-	222,821
. Royal Bank of Scotland 2023			1	74,541	80,421	74,541	-	74,541
. Barclays 2023			1	-	203,772	-	-	-

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
<u>Medición a costo amortizado</u>		<u>31,665,398</u>		<u>47,304,315</u>	<u>50,634,116</u>	<u>47,304,315</u>	-	<u>47,304,315</u>
Del País		<u>28,378,472</u>		<u>43,821,060</u>	<u>47,231,970</u>	<u>43,821,060</u>	-	<u>43,821,060</u>
Títulos públicos		<u>27,983,159</u>		<u>43,034,471</u>	<u>46,371,786</u>	<u>43,034,471</u>	-	<u>43,034,471</u>
. Bonar USD Step up 2035	AL35	13,153,200	1	27,341,777	29,290,170	27,341,777	-	27,341,777
. Letras del Tesoro Nacional ajustadas por CER a descuento Julio 2022	X29L2	6,548,579	1	6,244,630	6,526,831	6,244,630	-	6,244,630
. Bono de la Provincia de Bs. As. Caja de Jubilaciones 2023	32880	3,004,795	2	3,012,922	4,324,452	3,012,922	-	3,012,922
. Bono de la Provincia de Bs. As. Enero 2024	42047	2,870,834	2	2,788,425	3,585,290	2,788,425	-	2,788,425
. Bono de la Provincia de Bs. As. Julio 2024	42269	927,799	2	1,964,405	2,242,441	1,964,405	-	1,964,405
. Letras del Tesoro de la Provincia de Bs.As. Septiembre 2022	BLS22	700,000	1	700,000	-	700,000	-	700,000
. Letras del Tesoro de la Provincia de Bs.As. Agosto 2022	BBG22	628,891	2	624,715	-	624,715	-	624,715
. Bono Provincia de Buenos Aires Regs New USD Agosto 2037	BA37D	60,498	1	126,909	136,907	126,909	-	126,909
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2035	GD35	32,530	1	113,184	121,400	113,184	-	113,184
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2030	GD30	19,480	1	59,171	63,744	59,171	-	59,171
. Bonos de consolidación 8° Serie	PR15	33,208	1	48,470	69,907	48,470	-	48,470
. Bonos Globales de la Rep. Argentina en USD Step Up 2029	GD29	3,345	1	9,863	10,644	9,863	-	9,863

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos Privados		<u>395,313</u>		<u>786,589</u>	<u>860,184</u>	<u>786,589</u>	-	<u>786,589</u>
. Fideicomiso Financiero Vicentin Exportaciones VIII - Clase A	VC08A	24,532	2	490,839	527,481	490,839	-	490,839
. Obligaciones Negociables ON NEWSAN CL. 9	WNC9O	155,350	2	156,156	180,304	156,156	-	156,156
. Obligaciones Negociables CRESUD CL. 33 Julio 2024	CSKZO	193,723	2	112,747	123,327	112,747	-	112,747
. Obligaciones Negociables AA2000 2031	82076	16,045	1	21,184	22,835	21,184	-	21,184
. Certificado de Participación Fondo Fiduciario Fuerza Solidario Clase A	TRVA1	5,663	2	5,663	6,237	5,663	-	5,663
Del Exterior		<u>3,286,926</u>		<u>3,483,255</u>	<u>3,402,146</u>	<u>3,483,255</u>	-	<u>3,483,255</u>
Títulos públicos		<u>1,244,901</u>		<u>1,247,630</u>	<u>982,685</u>	<u>1,247,630</u>	-	<u>1,247,630</u>
. Global 2024		379,553	1	382,486	418,682	382,486	-	382,486
. Letras Financieras del Tesoro		673,310	1	673,310	361,277	673,310	-	673,310
. Global 2022		175,660	1	175,456	187,776	175,456	-	175,456
. Bonos Caja de JYPB		16,378	2	16,378	14,950	16,378	-	16,378
Títulos privados		<u>2,042,025</u>		<u>2,235,625</u>	<u>2,419,461</u>	<u>2,235,625</u>	-	<u>2,235,625</u>
. Macquarie Bank 2025		266,315	1	267,053	284,619	267,053	-	267,053
. Santander UK Group Holdings 2025		221,665	1	233,181	254,860	233,181	-	233,181
. BBVA Bancomer 2022		225,891	1	224,764	247,353	224,764	-	224,764

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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 31.03.22 Y AL 31.12.21

(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 31.03.22	SALDO DE LIBROS 31.12.21	POSICIÓN SIN OPCIONES	OPCIONES	POSICIÓN FINAL
Títulos privados								
. Banco Nacional de Desarrollo Económico e Social 2024		233,499	1	229,545	244,557	229,545	-	229,545
. Credit Suisse 2023		218,672	1	221,174	243,262	221,174	-	221,174
. Banco Do Brasil 2025		228,347	1	219,582	238,640	219,582	-	219,582
. Banco de Credito del Perú 2025		201,664	1	213,423	231,751	213,423	-	213,423
. ABN AMRO Bank 2026		3,834	1	190,485	203,202	190,485	-	190,485
. Danske Bank 2024		144,867	1	142,574	155,740	142,574	-	142,574
. HSBC Holdings plc 2026		131,988	1	131,186	139,728	131,186	-	131,186
. ABN AMRO Bank 2025		114,545	1	113,519	123,681	113,519	-	113,519
. BBVA Colombia 2025		50,738	1	49,139	52,068	49,139	-	49,139
Instrumentos de Patrimonio		1,559,955		1,559,955	1,780,872	1,559,955	-	1,559,955
Medidos a valor razonable con cambios en resultados		1,559,955		1,559,955	1,780,872	1,559,955	-	1,559,955
Del País		29,580		29,580	26,548	29,580	-	29,580
. Mercado Abierto Electrónico S.A.		29,580	3	29,580	26,548	29,580	-	29,580
Del Exterior		1,530,375		1,530,375	1,754,324	1,530,375	-	1,530,375
. Bladex S.A.		1,530,252	2	1,530,252	1,754,189	1,530,252	-	1,530,252
. Swift Bélgica		123	3	123	135	123	-	123
TOTAL DE TITULOS PUBLICOS Y PRIVADOS				573,409,868	298,760,826	573,409,868	-	573,409,868

Véase nuestro informe de fecha
26 de mayo de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador 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