

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERIODO TERMINADO EL 30.06.17

(Cifras expresadas en miles de pesos)

Hoja 1 de 1

TIPO DE CONTRATO	OBJETIVO DE LAS OPERACIONES	ACTIVO SUBYACENTE	TIPO DE LIQUIDACION	AMBITO DE NEGOCIACION O CONTRAPARTE	PLAZO PROMEDIO PONDERADO ORIGINALMENTE PACTADO	PLAZO PROMEDIO PONDERADO RESIDUAL	PLAZO PROMEDIO PONDERADO DE LIQUIDACION DE DIFERENCIAS	MONTO
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Moneda Extranjera	Diaria de Diferencias	ROFEX	3	1	-	67,300
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Moneda Extranjera	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	1	105,573
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Nacionales	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	25,011
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	3	3	-	82,920
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	-	33,717,608
Otros	Otras coberturas	Titulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	1	188,998
Otros	Intermediación Cuenta de Terceros	Otros	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	1,413,837
<u>TOTAL</u>								<u>35,601,247</u>

 Véase nuestro informe de fecha
09 de Agosto de 2017
KPMG

 Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

 Dr. Daniel H. Alonso
Gerente General

 Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

 (Socio)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 193 Leg. 193
Dr. Claudio Bercholz
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 69 – Folio 241
Legajo N° 17786-5
CUIT 20 – 12400104 - 9