

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERIODO TERMINADO EL 30.09.17

(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	2	-	179,640
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Moneda Extranjera	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	-	347,280
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Nacionales	Con entrega del subyacente	MAE	3	3	-	8,949,011
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	-	86,272
Otros	Otras coberturas	Titulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	-	283,960
Otros	Intermediación Cuenta de Terceros	Otros	Con entrega del subyacente	MAE	3	3	-	1,788,405
TOTAL								11,634,568

 Véase nuestro informe de fecha
09 de Noviembre 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 Bercholc
Contador Público (U.B.A.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 69 – Folio 241
Legajo N° 17786-5
CUIT 20 – 12400104 - 9