

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 30.09.16

(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	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	-	306,870
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Otros	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	167,369
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos públicos extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	6	1	-	76,379
Otros	Otras coberturas	Titulos públicos extranjeros	Con entrega del subyacente	Residentes en el Exterior	-	-	-	196,523
<u>TOTAL</u>								<u>747,141</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