

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 30.06.18

(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	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	721,419
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	144,022
Otros	Otras coberturas	Titulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	474,970
<u>TOTAL</u>								<u>1,340,411</u>

Véase nuestro informe de fecha
22 de agosto de 2018
KPMG

Dr. Fernando L. Arriola
Contador General

Dr. Daniel H. Alonso
Gerente General

Dr. Juan E. Curutchet
Presidente

(Socia)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F° 193 Leg. 193
Dra. Lorena Lardizábal
Contadora Pública (U.B.A.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 155 – Folio 141
Legajo N° 40284/2
CUIT 27 – 21506212-6