

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 30.06.19
 (Cifras expresadas en miles de pesos)

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	-	-	-	700,181
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Moneda Extranjera	Otra	BCBA	1	1	-	2,670,788
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	-	499,781
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Títulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	238,441
Otros	Otras coberturas	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	228,791
Otros	Otras coberturas	Títulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	1,107
TOTAL								4,339,089

Véase nuestro informe de fecha
8 de agosto de 2019
KPMG

Dr. Héctor O. Rodríguez
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
 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