

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

AL 30.06.22

(Cifras expresadas en miles de pesos - en moneda constante)

Hoja 1 de 1

| TIPO DE CONTRATO | OBJETIVO DE LAS OPERACIONES | TIPO DE COBERTURA | 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 | MAE | 1 | 1 | 1 | 26,260,000 |
| Futuros | Cobertura de Moneda extranjera | - | Moneda Extranjera | Con entrega del subyacente | OTC - Residentes en el Exterior | - | - | - | 2,405,009 |
| Operaciones de pase | Intermediación Cuenta Propia | - | Otros | Con entrega del subyacente | BCBA | - | - | 1 | 106,505,874 |
| Operaciones de pase | Intermediación Cuenta Propia | - | Títulos Valores Privados | Con entrega del subyacente | OTC - Residentes en el Exterior | - | - | - | 2,325,496 |
| Operaciones de pase | Intermediación Cuenta Propia | - | Títulos Públicos Extranjeros | Con entrega del subyacente | OTC - Residentes en el Exterior | - | - | - | 496,329 |
| <u>TOTAL</u> | | | | | | | | | <u>137,992,708</u> |

Véase nuestro informe de fecha
25 de agosto de 2022
KPMG

Cr. Alejandro A. García
Contador General

Cr. Rubén O. González Ocantos
Gerente General

Lic. Juan M. Cuattromo
Presidente

(Socia)
C.P.C.E.P.B.A. T° 1 F°193 Leg. 193
María Gabriela Saavedra
Contadora Pública (U.N.S.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
Legajo N°44622/0
CUIT 27-22976216-3