

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 30.09.18

(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	Diaria de Diferencias	ROFEX	1	1	-	473,000
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Moneda Extranjera	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	931,101
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Títulos Públicos Nacionales	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	51,002
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	-	897
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Otros	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	246,966
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Titulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	198,912
Otros	Otras coberturas	Titulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	415,996
TOTAL								2,317,874

 Véase nuestro informe de fecha
22 de noviembre 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