

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 30.09.20

(Cifras expresadas en miles de pesos en moneda constante - Nota 2.e)

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	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	476,353
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	-	95,683,639
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Títulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	422,595
Operaciones de pase	Otras coberturas	-	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	1,276,139
TOTAL									97,858,726

 Véase nuestro informe de fecha
3 de diciembre de 2020
KPMG

 Dr. Héctor O. Rodríguez
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
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