

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
AL 30.09.21

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

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	Intermediación Cuenta Propia	-	Moneda Extranjera	Diaria de diferencias	BCBA	-	-	-	827,600
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	-	Moneda Extranjera	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	1,751,102
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	2	271,158,084
Operaciones de pase	Otras coberturas	-	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	1,874,390
<u>TOTAL</u>									<u>275,611,176</u>

 Véase nuestro informe de fecha
 25 de noviembre de 2021
 KPMG