

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL PERÍODO TERMINADO EL 31.03.19

(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	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	1	1	-	1,259,243
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Títulos Públicos Extranjeros	Otra	BCRA	1	1	-	541,200
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	Títulos Públicos Extranjeros	Otra	ROFEX	1	1	-	90,300
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	Títulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	239,703
Otros	Otras coberturas	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	1	1	-	24,997
<u>TOTAL</u>								<u>2,155,443</u>

Véase nuestro informe de fecha
9 de mayo de 2019
KPMG

Dr. Héctor O. Rodríguez
Subcontador 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