

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL EJERCICIO TERMINADO EL 31.12.19

(Cifras expresadas en miles de pesos)

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	-	-	-	480,001
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Otros	Con entrega del subyacente	MAE	-	-	-	33,999,150
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Títulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	341,769
Operaciones de pase	Otras coberturas	-	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	787,589
<u>TOTAL</u>									<u>35,608,509</u>

Véase nuestro informe de fecha
27 de febrero 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