

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
CORRESPONDIENTE AL EJERCICIO TERMINADO EL 31.12.20

(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	-	-	-	963,600
Futuros	Intermediación Cuenta Propia	-	Moneda Extranjera	Diaria de diferencias	ROFEX	-	-	-	963,600
Futuros	Cobertura de Moneda extranjera	-	Moneda Extranjera	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	718,138
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Otros	Con entrega del subyacente	BCBA	-	-	-	119,155,150
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Títulos Públicos Extranjeros	Al vencimiento de diferencias	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	469,580
Operaciones de pase	Otras coberturas	-	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	1,532,488
TOTAL									123,802,556

 Véase nuestro informe de fecha
25 de marzo de 2021
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