

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
AL 31.12.22

(Cifras expresadas en miles de pesos - en moneda constante)

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	-	-	-	3,532,403
Operaciones de pase	Otras Coberturas	-	Títulos Públicos Nacionales	Al vencimiento de diferencias	BCBA	-	-	-	306,337,836
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Títulos Valores Privados	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	3,514,083
Operaciones de pase	Intermediación Cuenta Propia	-	Títulos Públicos Extranjeros	Con entrega del subyacente	OTC - Residentes en el Exterior	-	-	-	838,433
Otros	Cobertura de Moneda extranjera	-	Moneda Extranjera	Diaria de diferencias	ROFEX	-	-	1	791,000
TOTAL									315,013,755

Véase nuestro informe de fecha
9 de marzo de 2023
KPMG

Cr. Alejandro A. García
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
María Gabriela Saavedra
Contadora Pública (U.N.S.)
C.P.C.E.P.B.A. Tomo 172 – Folio 1
Legajo N°44622/0
CUIT 27-22976216-3