

27 de septiembre de 2017

Carteras Weekly

FCI CONSULTATIO

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - Badlar Linked	1.15%	25.56%	2.3
AO17 - BONO NACION ARG \$ BADLAR +300 BONAR 2017 VTO 09/10/2017	0.04%	27.37%	0.1
BONOS CONSOLIDACION PR15 VENC 04/10/2022	1.11%	25.49%	2.4
Bonos Soberanos - CER Linked	0.60%	28.14%	3.0
Cheque de Pago Diferido	0.77%	24.42%	0.0
Fideicomisos Financieros ARS	2.08%	24.63%	0.6
Fondos Comunes de Inversion	1.11%	16.22%	0.0
LEBAC	45.32%	26.52%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	14.57%	25.39%	2.1
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.41%	25.57%	1.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.55%	26.04%	1.9
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	1.42%	25.48%	1.5
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 20 VTO 23/01/2022	0.58%	25.71%	2.6
TITULO DE DEUDA DE LA CIUDAD DE BUENOS AIRES CL 19 VTO 23/07/2018	0.85%	25.26%	0.8
TITULO DE DEUDA PUBLICA DE ENTRE RIOS SERIE I VTO21/12/2017	0.07%	26.29%	0.2
TITULOS DE REESTRUCTURACION DE DEUDAS 2015 MENDOZA VTO 23/11/2018	0.54%	27.48%	0.6
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0.35%	25.03%	2.2
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.35%	25.14%	0.2
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	4.01%	25.45%	3.2
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.21%	25.25%	0.6
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1.76%	24.48%	2.9
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	2.08%	25.54%	2.5
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.39%		0.7
Letras Provinciales - Fixed Rate	12.16%	25.78%	56.0
LETRA DE LA PCIA DE BS AS 119 DIAS VTO 19/10/2017	5.12%	24.30%	20.0
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.73%	26.90%	48.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.43%	26.70%	56.0
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 18-01-18 A 119 DIAS	0.96%	27.13%	111.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.37%	24.34%	120.0
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.69%	27.30%	146.0
LETRA DEL TESORO DE LA CIUDAD DE BS AS A 56 DÍAS VTO 22/11/2017	3.33%	26.90%	54.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.18%	26.75%	148.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.35%	27.75%	176.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	21.66%	25.13%	1.6
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.09%	26.16%	1.2
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	0.04%	25.01%	2.3
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.06%	24.52%	0.2
ON BACS CLASE XI VTO 10/11/2019	0.42%	25.25%	1.3
ON BANCO CIUDAD CLASE 10 VTO 06/12/2020	0.21%	25.26%	2.1
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.07%	26.29%	0.5
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.14%	24.78%	1.5
ON BANCO ITAU CLASE 21 TV A 36 MESES VTO 26/12/2019	0.17%	25.03%	1.7
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.14%	24.79%	1.7
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.36%	24.68%	1.5
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.93%	24.79%	0.9
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0.75%	25.80%	0.9
ON DISAL SA SERIE III CLASE E VTO 15/05/2018	0.08%	26.02%	0.4
ON JOHN DEERE CLASE 6 VENC 30/03/2018	0.07%	25.49%	0.5
ON LEDESMA CLASE 2 VTO. 07/10/2017	0.05%	25.49%	0.0
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.11%	25.03%	1.5
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.46%	25.19%	2.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	0.06%	24.76%	2.4
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	0.15%	25.26%	0.5
ON QUICKFOOD CLASE 9 VTO 24/11/2022	0.27%	26.05%	2.7
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.07%	27.26%	1.0
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0.05%	24.20%	0.1

Security	Weight	Yield	Duration
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0.21%	25.24%	1.5
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.34%	25.28%	2.1
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.24%	25.43%	1.8
ON TARJETA NARANJA CLASE 33 SERIE 2 VTO 13/04/2019	0.07%	25.29%	1.3
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	25.25%	2.2
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.14%	24.78%	1.8
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.07%	24.03%	0.5
ON YPF CLASE 35 \$ VTO 24/09/2019	0.27%	25.76%	1.2
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1.81%	25.53%	1.1
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.07%	24.17%	1.2
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.21%	24.73%	0.6
ON YPF CLASE 42 VENC 24/09/2020	0.34%	25.17%	2.0
ON TARJETA NARANJA CL 34 S 1 VTO 29/12/2017	0.60%	24.13%	0.3
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.92%	24.79%	1.9
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.14%	24.81%	1.8
ON LOS GROBO CLASE VI VENCE 09/05/2019	0.21%	25.27%	1.4
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.11%	24.70%	1.0
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.21%	24.77%	1.4
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.55%	24.98%	2.0
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.11%	24.75%	2.0
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.14%	25.21%	0.8
ON BANCO ITAU CLASE 19 VENC 13/07/2019	0.14%	24.70%	1.5
ON SANTANDER RIO CLASE 15 VENC 19/09/2019	0.27%	24.86%	1.8
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.10%	24.66%	1.2
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0.24%	24.72%	1.3
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.21%	24.99%	1.4
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0.29%	25.73%	2.4
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	0.49%	24.78%	2.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.07%	24.45%	1.6
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	0.58%	24.26%	2.0
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.36%	26.29%	2.4
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	0.72%	25.79%	2.4
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0.61%	26.00%	2.6
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	1.60%	25.03%	1.6
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.75%	24.99%	1.9
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.66%	26.06%	2.9
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.35%	25.29%	1.0
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.16%	26.28%	1.4
ON TARJETA NARANJA CLASE 37 VENC 11/04/2022	0.44%	25.14%	2.3
ON Corporativas - Fixed Rate	0.68%	24.59%	0.3
ON AGROFINA CLASE 3 VTO 11/11/2017	0.14%	26.76%	0.1
ON CORDIAL CIA FINANCIERA CL 12 TF VTO 26/12/2017	0.10%	24.88%	0.3
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.18%	24.00%	0.6
ON PSA FINANCE ARGENTINA SERIE 21 VTO 15/11/2017	0.26%	23.74%	0.2
ON Corporativas - Inflation Linked	0.10%	24.32%	1.0
ON Corporativas - Repo Linked	0.56%	27.95%	2.0
Otros	-1.76%	0.00%	0.0
Plazo Fijo CER	1.14%	16.83%	0.0
Grand Total	100.00%	24.16%	279.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	4.42%	26.97%	5.4
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	3.52%	28.14%	3.0
BONO CUASIPAR CUAP ARS	0.89%	22.36%	14.9
Fideicomisos Financieros ARS	2.27%	24.97%	0.7
Fondos Comunes de Inversion	1.56%	16.26%	0.0
LEBAC	52.33%	26.49%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	18.99%	25.30%	2.4
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.20%	25.57%	1.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.68%	26.04%	1.9
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	0.70%	25.48%	1.5
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 20 VTO 23/01/2022	1.80%	25.71%	2.6
TITULO DE DEUDA DE LA PCIA DE SALTA CLASE 1 VTO 24/4/2018	0.02%	27.27%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0.90%	25.03%	2.2
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.60%	25.14%	0.2
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	6.72%	25.45%	3.2
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.55%	25.25%	0.6
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.49%	24.48%	2.9
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1.97%	25.54%	2.5
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	2.36%	25.04%	0.7
Letras Provinciales - Dolar Linked	0.30%	25.77%	0.9
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 1.95% VTO 20/12/2019	0.16%	25.96%	1.2
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.14%	25.54%	0.6
Letras Provinciales - Fixed Rate	4.05%	0.0	0.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.91%	26.70%	0.2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.35%	26.75%	0.4
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.51%	24.34%	0.4
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.64%	27.75%	0.5
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	1.03%	26.90%	48.0
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.96%	27.30%	146.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	23.65%	25.05%	1.7
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.13%	26.16%	1.2
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.03%	24.52%	0.2
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.10%	26.29%	0.5
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.20%	24.78%	1.5
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.15%	24.79%	1.7
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.20%	24.68%	1.5
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE XI VTO 20/01/2019	0.20%	25.28%	1.1
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.41%	24.79%	0.9
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0.68%	25.80%	0.9
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.15%	25.03%	1.5
ON MSU SERIE 4 CLASE 2 VTO 03/12/2017	0.20%	27.29%	0.2
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.91%	25.19%	2.3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0.07%	24.20%	0.1
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 31 VENC 09/05/2018	0.20%	23.33%	0.4
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0.15%	25.24%	1.5
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.34%	25.28%	2.1
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.24%	25.43%	1.8
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.10%	25.25%	2.2
ON TARJETAS CUYANAS CLASE 24 SERIE 2 VTO 05/05/2019	0.21%	26.50%	1.3
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.20%	24.78%	1.8
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.10%	24.03%	0.5
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	2.36%	25.53%	1.1
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.10%	24.17%	1.2
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.30%	24.73%	0.6
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	1.60%	24.79%	1.9
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.30%	24.81%	1.8

Security	Weight	Yield	Duration
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.30%	24.70%	1.0
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.60%	24.77%	1.4
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	1.18%	24.98%	2.0
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.20%	24.75%	2.0
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.20%	25.21%	0.8
ON MILICIA SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.15%	24.66%	1.2
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0.44%	24.72%	1.3
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.44%	24.99%	1.4
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC3O	0.10%	25.73%	2.4
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	0.99%	24.78%	2.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	4.09%	24.45%	1.6
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	1.12%	24.26%	2.0
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.51%	26.29%	2.4
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0.99%	26.00%	2.6
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	0.59%	25.03%	1.6
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.79%	24.99%	1.9
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.87%	26.06%	2.9
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.25%	25.29%	1.0
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.21%	26.28%	1.4
ON Corporativas - Fixed Rate	4.41%	19.97%	2.9
ON AGROFINA CLASE 3 VTO 11/11/2017	0.45%	26.76%	0.1
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.16%	24.00%	0.6
ON PSA FINANCE ARGENTINA SERIE 21 VTO 15/11/2017	0.26%	23.74%	0.2
ON YPF CLASE 52 VENC 09/05/2022	3.54%	18.64%	3.5
ON Corporativas - USD	1.34%	27.47%	1.9
ON GENERACION MEDITERRANEA CL 6 VTO 16/02/2020 USD	0.24%	28.83%	2.2
ON JOHN DEERE CLASE IX VTO 22/12/2019	0.30%	27.40%	2.1
ON LOS GROBO CLASE VII VENC 09/05/2019	0.53%	27.34%	1.6
ON LIAG ARGENTINA SERIE VIII CLASE 2 VENC 25/11/2019	0.27%	26.61%	2.0
Otros	-16.33%	0.00%	0.0
Bonos Soberanos - Badlar Linked	1.81%	25.49%	2.4
ON Corporativas - Repo Linked	1.20%	27.95%	2.0
Grand Total	100.00%	23.50%	505.0

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	1.16%	26.69%	4.5
Bonos Soberanos - CER Linked	50.08%	27.65%	4.8
BONCER 2021 - BONO DEL TESORO DE LA NAC ARG 2,5% VENC 22/07/2021	12.64%	27.95%	3.7
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	30.10%	28.14%	3.0
BONCER 2020 - BONO DEL TESORO DE LA NAC ARG 2.25% VENC 28/04/2020	0.18%	27.94%	2.5
BONO CUASIPAR CUAP ARS	3.62%	22.36%	14.9
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	3.54%	27.80%	13.6
Fideicomisos Financieros ARS	0.09%	24.53%	0.4
Fondos Comunes de Inversion	0.02%	16.01%	0.0
LEBAC	33.65%	26.47%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	3.81%	24.91%	2.8
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1.19%	25.45%	3.2
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.24%	25.25%	0.6
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.12%	24.48%	2.9
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	0.27%	25.54%	2.5
Letras Provinciales - Dolar Linked	1.65%	23.13%	0.8
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.08%	37.89%	0.2
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	1.10%	28.14%	1.0
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.46%	25.54%	0.6
Letras Provinciales - Fixed Rate	2.21%	26.97%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.48%	26.70%	0.2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.24%	26.75%	0.4
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.77%	26.90%	0.1
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.72%		0.4
ON Corporativas - BADLAR Linked	4.30%	21.07%	1.5
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.14%	26.16%	1.2
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.87%	25.53%	1.1
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	3.30%	24.45%	1.6
ON Corporativas - Fixed Rate	2.09%	18.64%	3.5
ON Corporativas - USD	0.26%	27.34%	1.6
Otros	0.33%	0.00%	0.0
ON Corporativas - Inflation Linked	0.35%	24.32%	1.0
Grand Total	100.00%	24.32%	2.7

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	35.95%	26.30%	3.3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	10.42%	26.47%	2.1
BONO PROV DE BS AS REGS 6,5% 15/02/2023	1.95%	25.78%	3.9
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	10.05%	26.69%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	11.43%	25.74%	2.8
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0.64%	26.76%	4.3
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	1.46%	27.19%	7.2
Bonos Soberanos - BCS	52.45%	25.33%	6.2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	5.83%	24.82%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	16.00%	24.39%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.25%	26.64%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	9.61%	25.22%	5.5
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5.07%	24.82%	8.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	3.56%	27.40%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.83%	25.74%	6.5
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3.29%	27.34%	11.7
Fondos Comunes de Inversion	1.70%	16.25%	0.0
LEBAC	2.09%	26.45%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	0.23%	28.79%	1.9
ON Corporativas - Dolar Linked	1.09%	35.03%	1.6
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.09%	19.29%	0.0
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	1.00%	36.48%	1.7
ON Corporativas - USD	6.80%		2.7
ON IRSA CLASE 8 VTO 09/09/2019	4.62%	27.63%	1.9
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	2.18%	26.59%	4.5
Otros	-0.30%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	21.82%	4.6

Security	Weights	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	39.54%	5.95%	3.7
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	9.46%	6.02%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	12.93%	6.21%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	12.84%	5.41%	2.8
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	4.31%	6.62%	7.2
Bonos Soberanos - BCS	60.32%	5.07%	6.1
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	16.18%	4.64%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	11.58%	4.28%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.37%	6.16%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	11.26%	4.97%	5.5
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5.36%	4.64%	8.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.63%	6.80%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.31%	5.41%	6.5
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3.64%	6.75%	11.7
Otros	0.14%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	5.45%	5.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	6.42%	25.92%	2.6
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	1.60%	26.47%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	4.81%	25.74%	2.8
Bonos Soberanos - BCS	25.53%	25.84%	7.1
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	3.69%	24.82%	3.5
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.33%	26.64%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	9.81%	25.22%	5.5
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.20%	24.82%	8.8
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	1.83%	25.74%	6.5
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	5.68%	27.34%	11.7
Bonos Soberanos - CER Linked	4.64%	28.14%	3.0
Fondos Comunes de Inversion	0.04%	16.27%	0.0
LEBAC	37.54%	26.52%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	6.89%	25.15%	3.1
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	4.71%	25.45%	3.2
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.18%	24.48%	2.9
Letras Provinciales - Dolar Linked	5.99%	28.32%	1.2
LETRA DE LA PCIA DEL CHUBUT CLASE 2 4,5% VENC 30/03/2021 - DOLAR LINKED	3.59%	29.23%	1.6
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.21%	37.89%	0.2
Título de Deuda Pcia Mendoza III usd link 2018	0.45%	24.71%	0.7
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	1.26%	25.54%	0.6
Títulos de Deuda Pcia Mendoza II usd link 2018	0.48%	27.99%	0.6
ON Corporativas - Dolar Linked	3.94%		1.1
ON CRESUD SERIE 8 CLASE 16 USD LINK 19/01/2018	2.88%	35.24%	0.9
ON IMPSA 11 18/6/2016 dolar link	0.03%	19.29%	0.0
ON IMPSA 12 28/12/2015 dolar link	0.05%	19.29%	0.0
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.03%	19.29%	0.0
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	0.95%	36.48%	1.7
ON Corporativas - Fixed Rate	1.39%	18.64%	3.5
ON Corporativas - USD	1.65%	26.69%	4.2
ON AGROFINA CL 6 VTO 16/02/19 USD	0.16%	27.61%	1.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	1.49%	26.59%	4.5
Otros	3.14%	0.00%	0.0
Bonos Soberanos - Badlar Linked	2.83%	25.49%	2.4
Grand Total	100.00%	23.75%	2.7

Security	Weight C	YTM BID	MD
Bonos Provinciales - BCS	24.41%	5.85%	3.3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	4.87%	6.02%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	9.65%	6.21%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	9.88%	5.41%	2.8
Bonos Soberanos - BCS	27.30%	5.27%	6.2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	7.97%	4.64%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	6.57%	4.28%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.15%	6.16%	7.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.75%	6.80%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	3.86%	5.41%	6.5
Fondos Comunes de Inversion	0.01%	-2.92%	0.0
LEBAC	10.41%	6.00%	0.1
Letras Provinciales - Dolar Linked	10.22%	6.48%	1.0
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 17/05/19	5.62%	5.71%	0.9
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	4.60%	7.42%	1.0
ON Corporativas - USD	1.09%	6.12%	4.5
Otros	1.09%	0.00%	0.0
BRAZIL - Corporate USD	17.42%	4.67%	4.1
BANBRA 5 7/8 VENC 01/19/2023	5.36%	4.67%	4.6
CAIXBR 3 1/2 VENC 11/07/2022	4.99%	3.82%	4.7
CAIXBR 7 1/4 VENC 07/23/2024	3.53%	6.51%	1.7
ITAU 5 1/8 VTO 13/05/2023 CORP	3.54%	4.04%	4.9
URUGUAY - Sovereign USD	8.05%		6.4
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 1/2 08/14/2024	4.02%	2.81%	5.3
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 3/8 10/27/2027	4.03%	3.37%	7.6
Grand Total	100.00%	5.86%	2.3

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	88.92%	2.33%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17	2.71%	3.20%	0.2
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18	2.93%	3.40%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-09-17	8.38%	2.05%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-10-17	8.28%	2.05%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-01-18	3.08%	3.17%	0.3
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-04-18	2.10%	3.35%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-10-17	7.09%	2.25%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES 27/04/18	0.65%	2.75%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 10-11-17	4.93%	2.50%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-11-17	2.20%	2.55%	0.2
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-05-18	6.40%	2.85%	0.7
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-01-18	5.08%	2.45%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-06-18	1.17%	3.10%	0.7
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-06-18	0.66%	3.10%	0.8
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18 A 273 DIAS	5.36%	2.70%	0.6
LETE DEL TESORO A 196 DIAS VTO 09/02/2018 / LTDF8D	5.40%	2.75%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 23-02-18 A 196 DIAS	4.92%	2.83%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES A 455 DIAS VENC 10/08/2018	2.62%	3.00%	0.9
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-03-18 A 182 DIAS	10.20%	3.11%	#N/A
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 28-09-18 A 378 DIAS	4.77%	3.12%	1.0
Otros	11.08%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	2.56%	0.0

Security	Weight	Yield	Duration
Cheque de Pago Diferido	69.40%	16.89%	251.4
Fideicomisos Financieros ARS	0.76%	23.80%	0.7
Fondos Comunes de Inversion	0.09%	16.46%	0.0
LEBAC	24.10%	26.45%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	5.05%	20.39%	294.6
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 1 VTO 27/8/2018	0.00%	27.29%	0.7
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 2 VTO 27/8/2018	0.00%	27.69%	0.7
ON BICE CLASE 3 VTO 19/06/2018	1.65%	24.53%	0.9
ON INVAP CLASE 3 VTO 21/10/2020	0.23%	27.29%	1.2
ON PYME EMP. INDUSTRIAL MEDITERRANEO SERIE I VTO 26/2/2018	0.00%	31.10%	0.3
ON PYME MONTEVER SA SERIE 1 VTO 14/05/2018	0.01%	28.29%	0.4
ON PYME PLASTICOS DISE CLASE 3 VTO 18/12/2018	0.01%	28.27%	0.9
ON PYME PLURAL COOP CLASE 2 VTO 10/09/2019	0.03%	28.32%	1.0
ON PYME SOUTH MANAGEMENT 10/12/2018	0.00%	27.29%	0.6
ON PYMES ACTUAL SERIE 4 VTO 26/11/2018	0.00%	29.01%	0.5
ON PYMES MERANOL EN PESOS CLASE 2 VENC 30/06/2019	0.03%	21.29%	1.3
ON PYMES VARCAM CLASE 1 VENC 11/11/2018	0.00%	27.29%	0.6
ON ROGIRO ACEROS CLASE 9 VTO 31/10/2018	0.04%	27.29%	0.6
ON ROGIRO ACEROS SERIE 8 CLASE I VTO 30/9/2017	0.04%	23.76%	0.0
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.15%	27.26%	1.0
ON SAVANT PHARM SERIE 3 CLASE G VTO 30/9/2018	0.00%	27.29%	0.5
ON BICE CLASE 1 VTO 16/02/2018	0.37%	20.27%	0.4
ON PYMES DEL FABRO HERMANOS Y CIA SA SERIE I VENC 02/05/2019	0.03%		0.8
ON ANGEL ESTRADA CLASE 5 VTO 01/06/2018	0.63%	25.52%	0.6
ON ROGIRO CLASE 12 VTO 31/05/2019	0.26%	24.83%	0.8
ON BICE CLASE 5 VTO 27/12/2018	1.39%	24.03%	1.1
ON PYME CNV RED SURCOS SERIE I \$ VTO 27/06/2019	0.03%	25.49%	0.8
ON SICOM SERIE IV VTO 12-09-2020	0.05%	27.78%	1.6
ON INTEGRACION ELECTRICA SUR ARG SA VCP CL 5 VTO 25/09/2018	0.12%	22.14%	250.0
ON Corporativas - USD	0.20%	27.93%	1.6
Otros	0.36%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	23.41%	202.1

Security	Weight	MAR	Over / Under
CRESUD S.A.C.I.F.Y.A.	1.21%	4.94%	-3.73%
OVOPTOT INTERNATIONAL SA	0.05%	0.00%	0.05%
YPF SA	1.69%	0.00%	1.69%
YPF S.A.-D	11.15%	9.86%	1.29%
IRSA SA	0.55%	0.00%	0.55%
GRUPO SUPERVIELLE ACC ORD B 1 V.\$ ESC	1.56%	0.00%	1.56%
BBVA BANCO FRANCES SA	0.13%	0.00%	0.13%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.52%	4.14%	1.38%
BANCO MACRO SA-B	7.13%	4.47%	2.66%
BANCO HIPOTECARIO SA-D SHS	0.00%	0.00%	0.00%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	13.10%	10.01%	3.09%
SIDERAR-A	5.49%	6.07%	-0.58%
ALUAR ALUMINIO	1.91%	4.03%	-2.12%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	2.97%	2.63%	0.34%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2.27%	0.00%	2.27%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	6.84%	3.30%	3.54%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	0.22%	0.00%	0.22%
PAMPA ENERGIA SA	0.36%	0.00%	0.36%
PAMPA ENERGIA SA	17.69%	11.23%	6.46%
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	0.31%	1.62%	-1.31%
TRANSENER S.A.-B	5.65%	4.25%	1.40%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	0.19%	0.00%	0.19%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.55%		0.70%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	0.36%	4.03%	-3.67%
Total Cartera Renta Variable	91.489%	1.0010	-8.611%
Total Cartera Renta Fija	9.156%		
Total Cartera de Inversiones	100.000%		

Security	ARS	Weight C	Dilution W
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	2,457,000	1%	0.62%
YPF S.A.-D	43,734,148	11%	11.05%
GRUPO SUPERVIELLE ACC ORD B 1 V.S ESC	6,493,342	2%	1.64%
BBVA BANCO FRANCES SA	18,581,468	5%	4.69%
BANCO MACRO SA-B	38,194,333	10%	9.65%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	60,845,637	15%	15.37%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2,905,282	1%	0.73%
CRESUD S.A.C.I.F.Y A.	348,905	0%	0.09%
ADECOAGRO	10,446,034	3%	2.64%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	2,747,500	1%	0.69%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	15,446,637	4%	3.90%
PAMPA ENERGIA SA	3,288,449	1%	0.83%
PAMPA ENERGIA SA	68,157,729	17%	17.22%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	39,667,091	10%	10.02%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	1,419,452	0%	0.36%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	16,183,329	4%	4.09%
TRANSENER S.A.-B	27,388,194	7%	6.92%
Equities	358,305,214	90.05%	90.53%
Fixed Income	39,604,307	9.95%	10.01%
Total Cartera de Inversiones	397,909,521		100.54%

Security	Weight	Yield	Duration
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.23%	0.0
LEBAC	9.55%	27.00%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	90.60%	20.83%	564.1
ON ALBANESI CALASE II \$ VTO 25/10/2018	0.20%	21.96%	340.5
ON AXION ENERGY CLASE 3 VENC 12/03/2020	0.38%	20.63%	691.0
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	10.72%	20.86%	814.4
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.38%	20.83%	718.2
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	1.30%	21.65%	327.1
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 4 VTO 07/11/2017	1.94%	20.64%	40.0
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	5.88%	21.11%	166.4
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.10%	21.04%	830.4
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	9.82%	20.61%	852.4
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	1.18%	22.14%	878.7
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.39%	20.64%	673.8
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	14.42%	20.58%	214.7
ON YPF CLASE 13 VENC 20/12/2018	7.69%	20.95%	239.9
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.38%	21.38%	385.5
ON YPF CLASE 29 VENC 07/03/2020	2.73%	20.87%	459.6
ON YPF CLASE 41 VENC 24/09/2020	3.54%	21.66%	599.2
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	5.23%	20.88%	590.9
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	8.53%	20.84%	673.8
ON YPF CLASE 36 VENC 10/02/2020	4.41%	21.39%	677.5
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	4.92%		879.6
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	5.50%	21.85%	1032.3
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.22%	21.91%	1050.3
Otros	-0.15%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	21.42%	510.3