

8 de septiembre de 2017

Carteras Weekly

FCI CONSULTATIO

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	0.64%	29.71%	2.9
Cheque de Pago Diferido	0.07%	24.08%	0.0
Fideicomisos Financieros ARS	2.32%	26.13%	0.6
Fondos Comunes de Inversion	0.02%	16.04%	0.0
LEBAC	48.94%	28.17%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	9.42%	26.59%	1.7
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.42%	26.44%	0.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.60%	26.91%	0.3
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	1.55%	26.36%	0.3
TITULO DE DEUDA PUBLICA DE ENTRE RIOS SERIE I VTO21/12/2017	0.07%	27.16%	0.3
TITULOS DE REESTRUCTURACION DE DEUDAS 2015 MENDOZA VTO 23/11/2018	0.59%	30.91%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0.38%	26.81%	0.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.38%	26.01%	0.3
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1.94%	25.90%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.22%	26.12%	0.3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	0.54%	25.54%	0.3
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1.22%	26.32%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.51%	26.69%	0.3
Letras Provinciales - Fixed Rate	7.58%	26.86%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.47%	26.70%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.19%	26.75%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.39%	24.34%	0.2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.38%	27.75%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.79%	26.90%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.74%	27.30%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 18-01-18 A 119 DIAS	1.03%	27.13%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA CIUDAD DE BS AS A 56 DÍAS VTO 22/11/2017	3.58%	26.90%	0.3
ON Corporativas - BADLAR Linked	29.42%	26.10%	1.7
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.10%	27.04%	0.3
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	0.04%	25.89%	0.3
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.06%	25.39%	0.3
ON BACS CLASE XI VTO 10/11/2019	0.46%	26.12%	0.3
ON BANCO CIUDAD CLASE 10 VTO 06/12/2020	0.23%	26.14%	0.3
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.08%	27.16%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.15%	25.65%	0.3
ON BANCO ITAU CLASE 21 TV A 36 MESES VTO 26/12/2019	0.19%	25.90%	0.3
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.15%	25.66%	0.3
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.37%	25.56%	0.3
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.59%	25.92%	0.3
ON DISAL SA SERIE III CLASE E VTO 15/05/2018	0.09%	26.89%	0.3
ON JOHN DEERE CLASE 6 VENC 30/03/2018	0.07%	26.36%	0.3
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.11%	25.90%	0.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.50%	26.06%	0.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	0.06%	25.64%	0.3
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	0.17%	26.13%	0.3
ON QUICKFOOD CLASE 9 VTO 24/11/2022	0.29%	26.92%	0.3
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.07%	28.13%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.37%	26.15%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.26%	26.30%	0.3
ON TARJETA NARANJA CLASE 33 SERIE 2 VTO 13/04/2019	0.07%	26.16%	0.3

Security	Weight	Yield	Duration
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	26.13%	0.3
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.16%	25.65%	0.3
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.07%	24.90%	0.2
ON YPF CLASE 35 \$ VTO 24/09/2019	0.29%	26.64%	0.3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1.97%	26.46%	0.3
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.08%	25.04%	0.3
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.23%	25.61%	0.3
ON YPF CLASE 42 VENC 24/09/2020	0.37%	26.04%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 34 S 1 VTO 29/12/2017	0.61%	25.00%	0.3
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.95%	25.67%	0.3
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.15%	25.68%	0.3
ON LOS GROBO CLASE VI VENCE 09/05/2019	0.22%	26.15%	0.3
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.12%	25.57%	0.3
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.23%	25.63%	0.3
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.60%	25.86%	0.3
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.11%	25.63%	0.3
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.15%	26.08%	0.3
ON BANCO ITAU CLASE 19 VENC 13/07/2019	0.15%	25.57%	0.3
ON SANTANDER RIO CLASE 15 VENC 19/09/2019	0.30%	25.73%	0.3
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.11%	25.53%	0.3
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.23%	25.86%	0.3
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC3O	0.31%	26.60%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.14%	25.46%	0.3
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	0.59%	25.70%	0.3
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.37%	27.16%	0.3
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	0.78%	26.66%	0.3
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0.66%	26.87%	0.3
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	7.01%	26.17%	0.3
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.76%	25.86%	0.3
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.64%	26.93%	0.3
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.38%	26.17%	0.3
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.17%	27.15%	0.3
ON Rombo Cia Financiera Serie 39	0.55%	26.25%	0.3
ON BANCO CIUDAD - CLASE 14	1.57%	25.96%	0.3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 40 VTO 02/11/2020	0.36%	26.82%	0.3
ON HIPOTECARIO CLASE 48 VTO 07/11/2022	1.45%	26.14%	0.3
ON Corporativas - Fixed Rate	0.29%	24.33%	0.3
ON CORDIAL CIA FINANCIERA CL 12 TF VTO 26/12/2017	0.11%	24.88%	0.2
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.18%	24.00%	0.2
ON Corporativas - Inflation Linked	0.10%	25.22%	1.0
ON Corporativas - Repo Linked	0.37%	26.20%	2.0
Otros	0.82%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	27.24%	0.7

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	3.42%	29.24%	7.42
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	1.20%	29.71%	0.30
BONOS DISCOUNT EN PESOS AL 5.83 VENC 15/12/2033	1.60%	28.86%	0.29
BONO CUASIPAR CUAP ARS	0.43%	29.37%	0.29
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	0.18%	29.14%	0.29
Fideicomisos Financieros ARS	2.36%	26.21%	0.63
Fondos Comunes de Inversion	0.12%	16.46%	0.00
LEBAC	42.15%	27.98%	0.05
Letras Provinciales - Badlar Linked	9.52%	26.29%	1.85
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.22%	26.44%	0.26
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.78%	26.91%	0.27
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	0.81%	26.36%	0.26
TITULO DE DEUDA DE LA PCIA DE SALTA CLASE 1 VTO 24/4/2018	0.01%	28.14%	0.28
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	1.03%	26.81%	0.27
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.69%	26.01%	0.26
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	2.83%	25.90%	0.26
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.60%	26.12%	0.26
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	0.46%	25.54%	0.26
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	0.50%	26.32%	0.26
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.58%	26.69%	0.27
Letras Provinciales - Dolar Linked	0.31%	25.01%	0.87
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 1.95% VTO 20/12/2019	0.18%	25.13%	0.25
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.13%	24.83%	0.25
Letras Provinciales - Fixed Rate	4.66%	26.73%	0.18
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	1.05%	26.70%	0.27
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.41%	26.75%	0.27
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.59%	24.34%	0.24
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.74%	27.75%	0.28
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.97%	26.90%	0.27
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.90%	27.30%	0.27
ON Corporativas - BADLAR Linked	24.99%	26.05%	1.78
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.15%	27.04%	0.27
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.04%	25.39%	0.25
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.11%	27.16%	0.27
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.23%	25.65%	0.26
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.16%	25.66%	0.26
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.22%	25.56%	0.26
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE XI VTO 20/01/2019	0.22%	26.15%	0.26
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.16%	25.90%	0.26
ON MSU SERIE 4 CLASE 2 VTO 03/12/2017	0.23%	28.16%	0.28
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	1.04%	26.06%	0.26
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 31 VENC 09/05/2018	0.15%	24.20%	0.24
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.39%	26.15%	0.26
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.28%	26.30%	0.26
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	26.13%	0.26
ON TARJETAS CUYANAS CLASE 24 SERIE 2 VTO 05/05/2019	0.22%	27.38%	0.27
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.23%	25.65%	0.26
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.11%	24.90%	0.25
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.11%	25.04%	0.25
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.34%	25.61%	0.26

Security	Weight	Yield	Duration
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	1.74%	25.67%	0.26
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.33%	25.68%	0.26
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.34%	25.57%	0.26
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.69%	25.63%	0.26
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	1.35%	25.86%	0.26
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.23%	25.63%	0.26
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.23%	26.08%	0.26
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.17%	25.53%	0.26
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.51%	25.86%	0.26
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0.12%	26.60%	0.27
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.39%	25.46%	0.25
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	1.21%	25.70%	0.26
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.55%	27.16%	0.27
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	1.14%	26.87%	0.27
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	5.40%	26.17%	0.26
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.86%	25.86%	0.26
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.89%	26.93%	0.27
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.28%	26.17%	0.26
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.24%	27.15%	0.27
ON Rombo Cia Financiera Serie 39	0.47%	26.25%	0.26
ON HIPOTECARIO CLASE 48 VTO 07/11/2022	1.35%	26.14%	0.26
ON Corporativas - Fixed Rate	5.18%	18.50%	3.44
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.17%	24.00%	0.24
ON YPF CLASE 52 VENC 09/05/2022	5.01%	18.31%	0.18
ON Corporativas - USD	1.50%	28.41%	1.76
ON GENERACION MEDITERRANEA CL 6 VTO 16/02/2020 USD	0.27%	29.78%	0.30
ON JOHN DEERE CLASE IX VTO 22/12/2019	0.34%	28.33%	0.28
ON LOS GROBO CLASE VII VENC 09/05/2019	0.58%	28.27%	0.28
ON LIAG ARGENTINA SERIE VIII CLASE 2 VENC 25/11/2019	0.30%	27.54%	0.28
Otros	5.57%	0.00%	0.00
ON Corporativas - Repo Linked	0.22%	26.20%	1.99
Total general	100.00%	26.70%	1.20

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	34.79%	29.60%	5.2
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	27.37%	29.71%	0.3
BONO CUASIPAR CUAP ARS	2.41%	29.37%	0.3
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	5.01%	29.14%	0.3
Fideicomisos Financieros ARS	0.09%	25.40%	0.3
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.24%	0.0
LEBAC	47.22%	28.04%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	0.30%	26.12%	0.5
Letras Provinciales - Dolar Linked	1.93%	26.40%	0.9
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.11%	38.90%	0.4
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	1.32%	25.99%	0.3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.50%	24.83%	0.2
Letras Provinciales - Fixed Rate	3.02%	26.97%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.65%	26.70%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.33%	26.75%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	1.06%	26.90%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.98%	27.30%	0.3
ON Corporativas - BADLAR Linked	5.66%	25.73%	1.4
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.19%	27.04%	0.3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1.19%	26.46%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	4.27%	25.46%	0.3
ON Corporativas - Fixed Rate	2.62%	18.31%	3.5
ON Corporativas - USD	0.34%	28.27%	1.4
Otros	3.54%	0.00%	0.0
ON Corporativas - Inflation Linked	0.48%	25.22%	1.0
Total general	100.00%	28.11%	2.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	14.02%	27.57%	4.6
BONO PROV DE BS AS REGS 6,5% 15/02/2023	1.93%	26.84%	0.3
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	10.00%	27.66%	0.3
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0.63%	27.57%	0.3
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	1.46%	27.92%	0.3
Bonos Soberanos - BCS	70.84%	25.60%	5.0
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	7.40%	25.45%	0.3
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	20.18%	25.56%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	14.68%	25.32%	0.3
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.22%	27.80%	0.3
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	2.12%	25.86%	0.3
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.83%	25.45%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	1.95%	28.17%	0.3
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	7.33%	26.76%	0.3
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	4.10%	22.72%	0.2
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.96%	28.34%	0.3
BONOS DE LA NACIÓN ARGENTINA EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES 8% 2020" (BONAR 2020 USD	5.05%	23.55%	0.2
Fondos Comunes de Inversion	0.11%	16.45%	0.0
LEBAC	0.96%	27.70%	0.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	0.24%	29.66%	1.7
ON Corporativas - Dolar Linked	0.09%	20.16%	0.0
ON Corporativas - USD	6.67%	28.19%	2.6
ON IRSA CLASE 8 VTO 09/09/2019	4.59%	28.57%	0.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	2.08%	27.38%	0.3
Otros	7.07%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	26.10%	4.7

Security	Weights	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	18.87%	6.29%	5.0
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	13.62%	6.24%	0.1
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0.46%	6.16%	0.1
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	4.79%	6.45%	0.1
Bonos Soberanos - BCS	76.08%	4.56%	5.0
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	10.75%	4.40%	0.0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	19.83%	4.49%	0.0
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	14.59%	4.30%	0.0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.71%	6.35%	0.1
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	2.69%	4.74%	0.0
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.57%	4.40%	0.0
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	2.10%	6.66%	0.1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	10.03%	5.49%	0.1
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	3.93%	2.13%	0.0
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.87%	6.81%	0.1
BONOS DE LA NACIÓN ARGENTINA EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES 8% 2020" (BONAR 2020 USD	5.01%	2.82%	0.0
Otros	5.05%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	4.90%	5.0

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	18.14%	26.15%	6.3
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	5.54%	25.56%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	1.19%	25.32%	0.3
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	2.86%	27.80%	0.3
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.86%	26.76%	0.3
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	2.06%	22.72%	0.2
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.63%	28.34%	0.3
Bonos Soberanos - CER Linked	6.29%	29.40%	4.9
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.24%	0.0
LEBAC	56.28%	28.07%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	3.50%	25.70%	2.9
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1.57%	25.90%	0.3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1.93%	25.54%	0.3
Letras Provinciales - Dolar Linked	4.70%	27.64%	1.2
LETRA DE LA PCIA DEL CHUBUT CLASE 2 4,5% VENC 30/03/2021 - DOLAR LINKED	2.89%	28.37%	0.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.18%	38.90%	0.4
Título de Deuda Pcia Mendoza III usd link 2018	0.40%	26.59%	0.3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.89%	24.83%	0.2
Títulos de Deuda Pcia Mendoza II usd link 2018	0.34%	23.92%	0.2
ON Corporativas - Dolar Linked	0.09%	20.16%	0.0
ON IMPSA 11 18/6/2016 dolar link	0.02%	20.16%	0.2
ON IMPSA 12 28/12/2015 dolar link	0.05%	20.16%	0.2
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.02%	20.16%	0.2
ON Corporativas - Fixed Rate	1.12%	18.31%	3.5
ON Corporativas - USD	1.37%	27.50%	4.2
ON AGROFINA CL 6 VTO 16/02/19 USD	0.14%	28.55%	0.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	1.24%	27.38%	0.3
Otros	8.50%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	27.53%	1.9

Security	Weight C	YTM BID	MD
Bonos Provinciales - BCS	9.61%	6.24%	4.4
Bonos Soberanos - BCS	32.63%	5.13%	5.8
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	8.63%	4.40%	0.0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	11.43%	4.49%	0.0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.13%	6.35%	0.1
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.67%	6.66%	0.1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	3.78%	5.49%	0.1
Fondos Comunes de Inversion	0.25%	-3.71%	0.0
LEBAC	10.97%	6.27%	0.0
Letras Provinciales - Dolar Linked	9.78%	4.13%	0.9
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 17/05/19	5.65%	3.60%	0.0
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	4.13%	4.85%	0.0
ON Corporativas - USD	1.05%	6.01%	4.5
BRAZIL - Corporate USD	17.00%	4.93%	4.0
BANBRA 5 7/8 VENC 01/19/2023	5.30%	4.72%	0.0
CAIXBR 3 1/2 VENC 11/07/2022	4.83%	4.03%	0.0
CAIXBR 7 1/4 VENC 07/23/2024	3.48%	6.89%	0.1
ITAU 5 1/8 VTO 13/05/2023 CORP	3.39%	4.51%	0.0
URUGUAY - Sovereign USD	7.90%	3.25%	6.3
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 1/2 08/14/2024	3.98%	3.01%	0.0
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 3/8 10/27/2027	3.92%	3.50%	0.0
Otros	10.81%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	5.06%	4.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	95.03%	2.63%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17	2.96%	2.25%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18	3.80%	2.50%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-01-18	6.29%	2.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-04-18	2.29%	3.35%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOALRES 27/04/18	1.08%	2.55%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 10-11-17	5.38%	2.50%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-11-17	2.40%	2.55%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-05-18	8.39%	2.82%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-01-18	5.55%	2.45%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-06-18	1.27%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-06-18	0.72%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18 A 273 DIAS	5.85%	2.70%	0.0
LETE DEL TESORO A 196 DIAS VTO 09/02/2018 / LTDF8D	7.36%	2.30%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 23-02-18 A 196 DIAS	8.28%	2.35%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES A 455 DIAS VENC 10/08/2018	2.86%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-03-18 A 182 DIAS	11.14%	2.78%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 28-09-18 A 378 DIAS	5.96%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 11-05-18 A 224 DIAS	7.79%	2.56%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17 - L2DD7D	1.46%	2.25%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-10-18 A 364 DIAS	3.34%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-10-18	0.86%	3.10%	0.0
Otros	4.97%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	2.63%	0.4

Security	Weight	Yield	Duration
Cheque de Pago Diferido	73.57%	17.79%	248.3
Fideicomisos Financieros ARS	0.77%	25.28%	0.7
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.23%	0.0
LEBAC	20.84%	27.70%	0.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	4.93%	25.44%	0.7
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 1 VTO 27/8/2018	0.00%	28.16%	0.5
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 2 VTO 27/8/2018	0.00%	28.56%	0.5
ON BICE CLASE 3 VTO 19/06/2018	1.66%	25.40%	0.6
ON IMPSA Clase 10 18/06/15	0.00%	0.00%	0.0
ON INVAP CLASE 3 VTO 21/10/2020	0.18%	28.16%	1.4
ON PYME EMP. INDUSTRIAL MEDITERRANEO SERIE I VTO 26/2/2018	0.00%	31.98%	0.2
ON PYME MONTEVER SA SERIE 1 VTO 14/05/2018	0.01%	29.16%	0.2
ON PYME PLASTICOS DISE CLASE 3 VTO 18/12/2018	0.01%	29.14%	0.8
ON PYME PLURAL COOP CLASE 2 VTO 10/09/2019	0.03%	29.19%	0.8
ON PYME SOUTH MANAGEMENT 10/12/2018	0.00%	28.16%	0.5
ON PYMES ACTUAL SERIE 4 VTO 26/11/2018	0.00%	29.89%	0.5
ON PYMES MERANOL EN PESOS CLASE 2 VENC 30/06/2019	0.03%	22.16%	1.2
ON PYMES VARCAM CLASE 1 VENC 11/11/2018	0.00%	28.16%	0.4
ON ROGIRO ACEROS CLASE 9 VTO 31/10/2018	0.03%	28.16%	0.7
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.14%	28.13%	1.0
ON SAVANT PHARM SERIE 3 CLASE G VTO 30/9/2018	0.00%	28.16%	0.6
ON BICE CLASE 1 VTO 16/02/2018	0.37%	21.15%	0.3
ON PYMES DEL FABRO HERMANOS Y CIA SA SERIE I VENC 02/05/2019	0.02%	28.14%	0.9
ON ANGEL ESTRADA CLASE 5 VTO 01/06/2018	0.61%	26.40%	0.5
ON ROGIRO CLASE 12 VTO 31/05/2019	0.26%	25.71%	0.7
ON BICE CLASE 5 VTO 27/12/2018	1.39%	24.90%	1.0
ON PYME CNV RED SURCOS SERIE I \$ VTO 27/06/2019	0.03%	26.36%	0.8
ON SICOM SERIE IV VTO 12-09-2020	0.05%	28.65%	1.5
ON INTEGRACION ELECTRICA SUR ARG SA VCP CL 5 VTO 25/09/2018	0.11%	29.92%	0.7
ON Corporativas - USD	0.19%	28.87%	1.5
Otros	-0.30%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	25.44%	205.0

Security	Weight	MAR	Over / Under
CRESUD S.A.C.I.F.Y.A.	1.44%	4.65%	-3.22%
OVOPROT INTERNATIONAL SA	0.04%	0.00%	0.04%
YPF S.A.-SPONSORED ADR	1.63%	0.00%	1.63%
YPF S.A.-D	11.43%	8.23%	3.20%
IRSA SA	0.59%	0.00%	0.59%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	1.71%	1.28%	0.42%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.78%	4.90%	0.89%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.78%	4.90%	0.89%
BANCO MACRO SA-B	7.20%	4.03%	3.17%
BANCO HIPOTECARIO SA-D SHS	0.00%	0.00%	0.00%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	12.73%	8.90%	3.83%
SIDERAR-A	5.89%	5.30%	0.59%
ALUAR ALUMINIO	1.99%	3.57%	-1.57%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	2.94%	3.16%	-0.22%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2.28%	0.00%	2.28%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	6.19%	3.19%	3.00%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	6.19%	3.19%	3.00%
PAMPA ENERGIA SA	18.79%	10.82%	7.97%
PAMPA ENERGIA SA	18.79%	10.82%	7.97%
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	0.53%	3.00%	-2.47%
TRANSENER S.A.-B	6.44%	4.65%	1.79%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.23%	4.44%	-0.20%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.23%	4.44%	-0.20%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	0.34%	4.19%	-3.85%
Total Cartera Renta Variable	93.039%	0.9801	-4.976%
Total Cartera Renta Fija	7.001%		
Total Cartera de Inversiones	100.000%		

Security	ARS	Weight C	Dilution W
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	5,816,250	1.31%	1.31%
YPF S.A.-D	60,858,188	13.68%	13.67%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	7,136,402	1.60%	1.60%
BBVA BANCO FRANCES SA	19,909,294	4.48%	4.47%
BANCO MACRO SA-B	41,115,247	9.24%	9.23%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	65,512,871	14.73%	14.71%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	3,303,895	0.74%	0.74%
CRESUD S.A.C.I.F.Y.A.	433,160	0.10%	0.10%
ADECOAGRO SA	9,277,719	2.09%	2.08%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	2,942,500	0.66%	0.66%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	16,765,692	3.77%	3.77%
PAMPA ENERGIA SA	83,007,382	18.66%	18.64%
PAMPA ENERGIA SA	83,007,382	18.66%	18.64%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	45,022,736	10.12%	10.11%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17,086,312	3.84%	3.84%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17,086,312	3.84%	3.84%
TRANSENER S.A.-B	35,131,736	7.90%	7.89%
Equities	418,365,041	94.04%	93.97%
Fixed Income	26,514,678	5.96%	5.96%
Total Cartera de Inversiones	444,879,719	100.00%	99.92%

Security	Weight	Yield	Duration
Fideicomisos Financieros ARS	0.18%	28.01%	0.28
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.22%	0.00
LEBAC	11.59%	27.70%	0.01
ON Corporativas - BADLAR Linked	88.29%	26.06%	1.57
ON ALBANESI CALASE II \$ VTO 25/10/2018	0.19%	26.99%	0.27
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	10.10%	25.89%	0.26
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	2.59%	25.92%	0.26
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	4.45%	26.65%	0.27
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.10%	26.06%	0.26
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	9.79%	25.64%	0.26
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	5.85%	26.13%	0.26
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.38%	26.46%	0.26
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	14.36%	25.61%	0.26
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.37%	25.67%	0.26
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.38%	25.86%	0.26
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	4.15%	25.65%	0.26
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	1.10%	27.16%	0.27
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	4.90%	26.66%	0.27
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	5.49%	26.87%	0.27
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	4.90%	26.17%	0.26
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	7.97%	25.86%	0.26
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.19%	26.93%	0.27
ON YPF CLASE 29 VENC 07/03/2020	2.72%	25.90%	0.26
ON YPF CLASE 36 VENC 10/02/2020	4.40%	26.41%	0.26
ON AXION ENERGY CLASE 3 VENC 12/03/2020	0.38%	25.65%	0.26
ON YPF CLASE 41 VENC 24/09/2020	3.53%	26.68%	0.27
Otros	-0.06%	0.00%	0.00
Total general	100.00%	26.25%	1.39