

5 de octubre de 2017

Carteras Weekly

FCI CONSULTATIO

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - Badlar Linked	1.12%	24.47%	2.4
AO17 - BONO NACION ARG \$ BADLAR +300 BONAR 2017 VTO 09/10/2017	0.04%	38.94%	0.0
BONOS CONSOLIDACION PR15 VENC 04/10/2022	1.07%	23.86%	2.5
Bonos Soberanos - CER Linked	0.61%	28.18%	3.0
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	0.61%	28.18%	3.0
Cheque de Pago Diferido	0.61%	24.35%	0.0
Fideicomisos Financieros ARS	1.99%	24.83%	0.6
Fondos Comunes de Inversion	1.90%	16.26%	0.0
LEBAC	46.68%	26.89%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	13.21%	25.87%	2.2
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.41%	25.77%	1.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.55%	26.24%	1.9
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	1.42%	25.68%	1.5
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 20 VTO 23/01/2022	0.58%	25.91%	2.6
TITULO DE DEUDA PUBLICA DE ENTRE RIOS SERIE I VTO21/12/2017	0.07%	26.49%	0.2
TITULOS DE REESTRUCTURACION DE DEUDAS 2015 MENDOZA VTO 23/11/2018	0.53%	34.87%	0.6
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0.35%	26.13%	2.2
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.35%	25.34%	0.1
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	3.77%	25.39%	3.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.21%	25.45%	0.5
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1.78%	24.50%	2.8
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1.81%	25.58%	2.4
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.39%	26.01%	0.6
Letras Provinciales - Fixed Rate	11.99%	25.78%	0.1
LETRA DE LA PCIA DE BS AS 119 DIAS VTO 19/10/2017	5.05%	24.30%	0.0
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.43%	26.70%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.18%	26.75%	0.4
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.36%	24.34%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.35%	27.75%	0.5
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.72%	26.90%	0.1
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.68%	27.30%	0.4
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 18-01-18 A 119 DIAS	0.94%	27.13%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA CIUDAD DE BS AS A 56 DÍAS VTO 22/11/2017	3.28%	26.90%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	21.51%	25.41%	1.6
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.09%	26.36%	1.2
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	0.04%	25.21%	2.2
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.06%	24.72%	0.1
ON BACS CLASE XI VTO 10/11/2019	0.42%	25.45%	1.3
ON BANCO CIUDAD CLASE 10 VTO 06/12/2020	0.21%	25.46%	2.0
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.07%	26.49%	0.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.14%	24.98%	1.5
ON BANCO ITAU CLASE 21 TV A 36 MESES VTO 26/12/2019	0.17%	25.23%	1.8
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.14%	24.99%	1.6
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.36%	24.88%	1.4
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.93%	24.99%	0.9
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0.75%	26.00%	0.9
ON DISAL SA SERIE III CLASE E VTO 15/05/2018	0.08%	26.22%	0.3
ON JOHN DEERE CLASE 6 VENC 30/03/2018	0.07%	25.69%	0.5
ON LEDESMA CLASE 2 VTO. 07/10/2017	0.05%	25.69%	0.0
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.11%	25.23%	1.4
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.46%	25.39%	2.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	0.06%	24.96%	2.3
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	0.15%	25.46%	0.4
ON QUICKFOOD CLASE 9 VTO 24/11/2022	0.27%	26.25%	2.6
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.07%	27.46%	1.1
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0.05%	24.40%	0.0

Security	Weight	Yield	Duration
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0.21%	25.44%	1.4
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.34%	25.48%	2.2
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.24%	25.63%	1.7
ON TARJETA NARANJA CLASE 33 SERIE 2 VTO 13/04/2019	0.07%	25.49%	1.2
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	25.45%	2.1
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.14%	24.98%	1.8
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.07%	24.23%	0.4
ON YPF CLASE 35 \$ VTO 24/09/2019	0.27%	25.96%	1.3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1.80%	25.73%	1.0
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.07%	24.37%	1.2
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.21%	24.93%	0.6
ON YPF CLASE 42 VENC 24/09/2020	0.34%	25.37%	2.2
ON TARJETA NARANJA CL 34 S 1 VTO 29/12/2017	0.56%	24.33%	0.2
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.87%	24.99%	1.9
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.14%	25.01%	1.7
ON LOS GROBO CLASE VI VENCE 09/05/2019	0.21%	25.47%	1.3
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.11%	24.90%	1.0
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.21%	24.97%	1.3
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.55%	25.18%	2.0
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.11%	24.95%	1.9
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.14%	25.41%	0.7
ON BANCO ITAU CLASE 19 VENC 13/07/2019	0.14%	24.90%	1.4
ON SANTANDER RIO CLASE 15 VENC 19/09/2019	0.27%	25.06%	1.6
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.10%	24.86%	1.1
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0.24%	24.92%	1.2
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.21%	25.19%	1.4
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0.29%	25.93%	2.4
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	0.49%	24.98%	2.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.06%	25.30%	1.6
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	0.57%	25.02%	1.9
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.36%	26.49%	2.4
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	0.72%	25.99%	2.4
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0.61%	26.20%	2.8
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	1.59%	25.23%	1.6
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.75%	25.19%	1.8
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.65%	26.26%	2.9
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.35%	25.49%	1.0
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.16%	26.48%	1.4
ON TARJETA NARANJA CLASE 37 VENC 11/04/2022	0.44%	25.34%	2.3
ON Corporativas - Fixed Rate	0.67%	24.59%	0.2
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%	0.2
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%	0.1
ON Corporativas - Inflation Linked	0.09%	24.52%	1.0
ON Corporativas - Repo Linked	0.56%	28.15%	2.0
Otros	-2.07%	0.00%	0.0
Plazo Fijo CER	1.14%	16.83%	12.0
Total general	100.00%	23.06%	10.8

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	5.20%	27.06%	5.3
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	4.16%	28.18%	3.0
BONO CUASIPAR CUAP ARS	1.05%	22.63%	14.6
Fideicomisos Financieros ARS	2.49%	25.17%	0.6
Fondos Comunes de Inversion	0.21%	16.46%	0.0
LEBAC	28.12%	26.85%	0.0
Letras Provinciales - Badlar Linked	19.47%	25.47%	2.5
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0.24%	25.77%	1.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.80%	26.24%	1.9
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	0.82%	25.68%	1.5
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 20 VTO 23/01/2022	2.10%	25.91%	2.6
TITULO DE DEUDA DE LA PCIA DE SALTA CLASE 1 VTO 24/4/2018	0.02%	27.47%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	1.05%	26.13%	2.2
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.70%	25.34%	0.1
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	7.40%	25.39%	3.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.64%	25.45%	0.5
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.94%	24.50%	2.8
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1.15%	25.58%	2.4
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.61%	26.01%	0.6
Letras Provinciales - Dolar Linked	0.35%	24.43%	0.9
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 1.95% VTO 20/12/2019	0.19%	25.69%	1.2
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.17%	23.02%	0.6
Letras Provinciales - Fixed Rate	4.73%	26.73%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	1.07%	26.70%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.41%	26.75%	0.4
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.60%	24.34%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.75%	27.75%	0.5
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.98%	26.90%	0.1
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.92%	27.30%	0.4
ON Corporativas - BADLAR Linked	27.51%	25.39%	1.6
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.15%	26.36%	1.2
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.04%	24.72%	0.1
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.11%	26.49%	0.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.23%	24.98%	1.5
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.18%	24.99%	1.6
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.24%	24.88%	1.4
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE XI VTO 20/01/2019	0.24%	25.48%	1.1
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.48%	24.99%	0.9
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0.80%	26.00%	0.9
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.18%	25.23%	1.4
ON MSU SERIE 4 CLASE 2 VTO 03/12/2017	0.23%	27.49%	0.2
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	1.06%	25.39%	2.3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0.08%	24.40%	0.0
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 31 VENC 09/05/2018	0.24%	23.53%	0.3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0.18%	25.44%	1.4
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.40%	25.48%	2.2
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.29%	25.63%	1.7
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.12%	25.45%	2.1
ON TARJETAS CUYANAS CLASE 24 SERIE 2 VTO 05/05/2019	0.24%	26.70%	1.3
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.24%	24.98%	1.8
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.11%	24.23%	0.4
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	2.76%	25.73%	1.0
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.12%	24.37%	1.2
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.35%	24.93%	0.6
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	1.77%	24.99%	1.9
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.35%	25.01%	1.7

Security	Weight	Yield	Duration
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.35%	24.90%	1.0
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.70%	24.97%	1.3
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	1.37%	25.18%	2.0
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.23%	24.95%	1.9
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.23%	25.41%	0.7
ON MILICIA SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.17%	24.86%	1.1
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0.52%	24.92%	1.2
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.52%	25.19%	1.4
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC3O	0.12%	25.93%	2.4
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	1.16%	24.98%	2.4
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	4.77%	25.30%	1.6
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	1.31%	25.02%	1.9
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.59%	26.49%	2.4
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	1.16%	26.20%	2.8
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	0.69%	25.23%	1.6
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.93%	25.19%	1.8
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	1.01%	26.26%	2.9
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.29%	25.49%	1.0
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.25%	26.48%	1.4
ON Corporativas - Fixed Rate	5.09%	19.58%	2.7
ON AGROFINA CLASE 3 VTO 11/11/2017	0.53%	26.76%	0.1
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.19%	24.00%	0.6
ON PSA FINANCE ARGENTINA SERIE 21 VTO 15/11/2017	0.30%	23.74%	0.1
ON YPF CLASE 52 VENC 09/05/2022	4.07%	18.13%	3.4
ON Corporativas - USD	1.55%	27.68%	1.9
ON GENERACION MEDITERRANEA CL 6 VTO 16/02/2020 USD	0.27%	29.05%	2.2
ON JOHN DEERE CLASE IX VTO 22/12/2019	0.35%	27.61%	2.1
ON LOS GROBO CLASE VII VENC 09/05/2019	0.61%	27.55%	1.5
ON LIAG ARGENTINA SERIE VIII CLASE 2 VENC 25/11/2019	0.31%	26.82%	2.0
Otros	1.81%	0.00%	0.0
Bonos Soberanos - Badlar Linked	2.06%	23.86%	2.5
BONOS CONSOLIDACION PR15 VENC 04/10/2022	2.06%	23.86%	2.5
ON Corporativas - Repo Linked	1.40%	28.15%	2.0
Grand Total	100.00%	22.08%	1.2

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	1.14%	26.84%	4.5
Bonos Soberanos - CER Linked	50.41%	27.57%	4.7
BONCER 2021 - BONO DEL TESORO DE LA NAC ARG 2,5% VENC 22/07/2021	13.07%	27.46%	3.6
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	30.22%	28.18%	3.0
BONO CUASIPAR CUAP ARS	3.61%	22.63%	14.6
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	3.51%	27.82%	13.8
Fideicomisos Financieros ARS	0.09%	24.73%	0.4
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.41%	0.0
LEBAC	33.84%	26.86%	0.0
Letras Provinciales - Badlar Linked	3.48%	24.85%	2.8
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1.11%	25.39%	3.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.24%	25.45%	0.5
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.13%	24.50%	2.8
Letras Provinciales - Dolar Linked	1.64%	26.27%	0.8
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.08%	38.12%	0.1
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	1.09%	26.82%	1.0
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.47%	23.02%	0.6
Letras Provinciales - Fixed Rate	2.20%	26.97%	0.2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.48%	26.70%	0.1
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%	27.30%	0.4
ON Corporativas - BADLAR Linked	4.28%	25.42%	1.4
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.14%	26.36%	1.2
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.87%	25.73%	1.0
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	3.28%	25.30%	1.6
ON Corporativas - Fixed Rate	2.10%	18.13%	3.4
ON Corporativas - USD	0.26%	27.55%	1.5
Otros	0.21%	0.00%	0.0
ON Corporativas - Inflation Linked	0.35%	24.52%	1.0
Total general	100.00%	14.49%	1.2

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	35.64%	26.36%	3.3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	10.30%	26.52%	2.1
BONO PROV DE BS AS REGS 6,5% 15/02/2023	1.94%	25.83%	3.8
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	9.97%	26.84%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	11.34%	25.76%	2.8
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0.63%	26.88%	4.3
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	1.46%	27.13%	7.2
Bonos Soberanos - BCS	52.07%	25.43%	6.2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	5.80%	24.64%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	15.86%	24.58%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.23%	26.92%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	9.45%	25.18%	5.4
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5.08%	24.64%	8.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	3.58%	27.46%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.81%	26.26%	6.4
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3.26%	27.58%	11.8
Fondos Comunes de Inversion	1.61%	16.23%	0.0
LEBAC	0.27%	26.85%	0.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	0.23%	28.99%	1.8
ON Corporativas - Dolar Linked	1.07%	35.26%	1.5
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.09%	19.49%	0.0
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	0.98%	36.71%	1.7
ON Corporativas - USD	6.63%	27.40%	2.7
ON IRSA CLASE 8 VTO 09/09/2019	4.55%	27.84%	1.8
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	2.08%	26.44%	4.6
Otros	2.49%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	16.61%	2.6

Security	Weights	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	39.49%	5.82%	3.6
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	9.41%	5.88%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	12.91%	6.16%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	12.82%	5.25%	2.8
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	4.34%	6.39%	7.2
Bonos Soberanos - BCS	60.32%	4.92%	6.0
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	16.21%	4.31%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	11.56%	4.26%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.37%	6.22%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	11.14%	4.76%	5.4
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5.40%	4.31%	8.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.68%	6.68%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.32%	5.67%	6.4
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3.63%	6.77%	11.8
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	-3.49%	0.0
Otros	0.19%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	2.43%	2.9

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	6.57%	25.95%	2.6
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	1.64%	26.52%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	4.93%	25.76%	2.8
Bonos Soberanos - BCS	26.10%	25.91%	7.1
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	3.79%	24.64%	3.5
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.42%	26.92%	7.8
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	9.96%	25.18%	5.4
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.24%	24.64%	8.8
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	1.88%	26.26%	6.4
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	5.80%	27.58%	11.8
Bonos Soberanos - CER Linked	4.84%	28.18%	3.0
Fondos Comunes de Inversion	0.21%	16.27%	0.0
LEBAC	36.83%	26.89%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	6.87%	25.10%	3.2
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	4.59%	25.39%	3.3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2.28%	24.50%	2.8
Letras Provinciales - Dolar Linked	6.01%	25.73%	1.2
LETRA DE LA PCIA DEL CHUBUT CLASE 2 4,5% VENC 30/03/2021 - DOLAR LINKED	3.49%	26.15%	1.7
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.21%	38.12%	0.1
Título de Deuda Pcia Mendoza III usd link 2018	0.46%	27.52%	0.7
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	1.34%	23.02%	0.6
Títulos de Deuda Pcia Mendoza II usd link 2018	0.51%	23.21%	0.6
ON Corporativas - Dolar Linked	4.02%	35.34%	1.0
ON CRESUD SERIE 8 CLASE 16 USD LINK 19/01/2018	2.94%	35.47%	0.9
ON IMPSA 11 18/6/2016 dolar link	0.03%	19.49%	0.0
ON IMPSA 12 28/12/2015 dolar link	0.05%	19.49%	0.0
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.03%	19.49%	0.0
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	0.97%	36.71%	1.7
ON Corporativas - Fixed Rate	1.45%	18.13%	3.4
ON Corporativas - USD	1.63%	26.58%	4.3
ON AGROFINA CL 6 VTO 16/02/19 USD	0.16%	27.83%	1.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	1.47%	26.44%	4.6
Otros	2.62%	0.00%	0.0
Bonos Soberanos - Badlar Linked	2.84%	23.86%	2.5
Total general	100.00%	16.04%	1.6

Security	Weight C	YTM BID	MD
Bonos Provinciales - BCS	24.34%	5.73%	3.3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	4.85%	5.88%	2.1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	9.63%	6.16%	4.5
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	9.86%	5.25%	2.8
Bonos Soberanos - BCS	27.35%	5.20%	6.2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	7.98%	4.31%	3.5
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	6.55%	4.26%	3.9
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.15%	6.22%	7.8
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.80%	6.68%	12.4
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	3.86%	5.67%	6.4
Fondos Comunes de Inversion	0.27%	-3.03%	0.0
LEBAC	10.06%	6.16%	0.0
Letras Provinciales - Dolar Linked	10.23%	5.23%	0.9
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 17/05/19	5.61%	4.49%	0.8
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	4.62%	6.13%	1.0
ON Corporativas - USD	1.05%	5.82%	4.6
Otros	1.39%	0.00%	0.0
BRAZIL - Corporate USD	17.32%	4.69%	4.1
BANBRA 5 7/8 VENC 01/19/2023	5.34%	4.51%	4.6
CAIXBR 3 1/2 VENC 11/07/2022	4.96%	3.85%	4.6
CAIXBR 7 1/4 VENC 07/23/2024	3.51%	6.59%	1.7
ITAU 5 1/8 VTO 13/05/2023 CORP	3.52%	4.26%	4.9
URUGUAY - Sovereign USD	7.99%	3.20%	6.4
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 1/2 08/14/2024	3.99%	2.93%	5.2
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 3/8 10/27/2027	4.00%	3.46%	7.5
Total general	100.00%	2.17%	2.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	87.26%	2.54%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17	2.49%	2.25%	0.2
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18	3.20%	2.50%	0.5
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-10-17	7.60%	2.05%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-01-18	5.29%	2.10%	0.3
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-04-18	1.92%	3.35%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-10-17	6.51%	2.25%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOALRES 27/04/18	0.91%	2.55%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 10-11-17	4.52%	2.50%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-11-17	2.02%	2.55%	0.1
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-05-18	5.88%	2.85%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-01-18	4.67%	2.45%	0.3
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-06-18	1.07%	3.10%	0.7
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-06-18	0.60%	3.10%	0.7
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18 A 273 DIAS	4.92%	2.70%	0.5
LETE DEL TESORO A 196 DIAS VTO 09/02/2018 / LTDF8D	6.19%	2.30%	0.3
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 23-02-18 A 196 DIAS	6.97%	2.35%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES A 455 DIAS VENC 10/08/2018	2.40%	3.10%	0.8
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-03-18 A 182 DIAS	9.36%	2.78%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 28-09-18 A 378 DIAS	5.01%	3.10%	1.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 11-05-18 A 224 DIAS	4.50%	2.85%	0.6
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17 - L2DD7D	1.23%	2.25%	0.2
Otros	12.74%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	1.49%	0.2

Security	Weight	Yield	Duration
Cheque de Pago Diferido	70.47%	17.06%	257.6
Fideicomisos Financieros ARS	0.90%	24.49%	0.7
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.37%	0.0
LEBAC	23.97%	26.85%	0.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	5.01%	24.75%	0.8
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 1 VTO 27/8/2018	0.00%	27.49%	0.6
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 2 VTO 27/8/2018	0.00%	27.89%	0.6
ON BICE CLASE 3 VTO 19/06/2018	1.65%	24.73%	0.7
ON IMPSA Clase 10 18/06/15	0.00%		0.0
ON INVAP CLASE 3 VTO 21/10/2020	0.23%	27.49%	1.2
ON PYME EMP. INDUSTRIAL MEDITERRANEO SERIE I VTO 26/2/2018	0.00%	31.30%	0.3
ON PYME MONTEVER SA SERIE 1 VTO 14/05/2018	0.01%	28.49%	0.3
ON PYME PLASTICOS DISE CLASE 3 VTO 18/12/2018	0.01%	28.47%	0.9
ON PYME PLURAL COOP CLASE 2 VTO 10/09/2019	0.03%	28.52%	0.9
ON PYME SOUTH MANAGEMENT 10/12/2018	0.00%	27.49%	0.5
ON PYMES ACTUAL SERIE 4 VTO 26/11/2018	0.00%	29.21%	0.5
ON PYMES MERANOL EN PESOS CLASE 2 VENC 30/06/2019	0.03%	21.49%	1.3
ON PYMES VARCAM CLASE 1 VENC 11/11/2018	0.00%	27.49%	0.5
ON ROGIRO ACEROS CLASE 9 VTO 31/10/2018	0.04%	27.49%	0.5
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.14%	27.46%	1.1
ON SAVANT PHARM SERIE 3 CLASE G VTO 30/9/2018	0.00%	27.49%	0.7
ON BICE CLASE 1 VTO 16/02/2018	0.37%	20.47%	0.4
ON PYMES DEL FABRO HERMANOS Y CIA SA SERIE I VENC 02/05/2019	0.03%	27.46%	0.8
ON ANGEL ESTRADA CLASE 5 VTO 01/06/2018	0.63%	25.72%	0.5
ON ROGIRO CLASE 12 VTO 31/05/2019	0.25%	25.03%	0.8
ON BICE CLASE 5 VTO 27/12/2018	1.38%	24.23%	1.1
ON PYME CNV RED SURCOS SERIE I \$ VTO 27/06/2019	0.03%	25.69%	0.9
ON SICOM SERIE IV VTO 12-09-2020	0.04%	27.98%	1.6
ON INTEGRACION ELECTRICA SUR ARG SA VCP CL 5 VTO 25/09/2018	0.12%	26.49%	0.7
ON Corporativas - USD	0.19%	28.15%	1.6
Otros	-0.55%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	22.27%	163.4

Security	Weight	MAR	Over / Under
CRESUD S.A.C.I.F.Y.A.	1.18%	4.02%	-2.83%
OVOPIOT INTERNATIONAL SA	0.05%	0.00%	0.05%
YPF SA	1.66%	0.00%	1.67%
YPF S.A.-D	11.22%	8.07%	3.23%
IRSA SA	0.53%	0.00%	0.53%
GRUPO SUPERVIELLE ACC ORD B 1 V.\$ ESC	1.52%	1.25%	0.28%
BBVA BANCO FRANCES SA	0.13%	0.00%	0.13%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.60%	5.10%	0.54%
BANCO MACRO SA-B	7.40%	4.28%	3.17%
BANCO HIPOTECARIO SA-D SHS	0.00%	0.00%	0.00%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	13.01%	9.03%	4.07%
SIDERAR-A	5.30%	4.89%	0.45%
ALUAR ALUMINIO	1.84%	3.19%	-1.34%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	2.89%	3.11%	-0.21%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2.34%	0.00%	2.35%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	7.02%	3.17%	3.89%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	0.23%	0.00%	0.23%
PAMPA ENERGIA SA	0.37%	0.00%	0.37%
PAMPA ENERGIA SA	18.07%	11.15%	7.04%
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	0.41%	2.79%	-2.38%
TRANSENER S.A.-B	5.59%	4.59%	1.03%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	0.19%	0.00%	0.19%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.57%	4.65%	-0.04%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	0.39%	4.69%	-4.30%
Total Cartera Renta Variable	91.502%	0.9763	-6.128%
Total Cartera Renta Fija	8.498%		
Total Cartera de Inversiones	100.000%		

Security	ARS	Weight C	Dilution W
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	3,110,000	1%	0.74%
YPF S.A.-D	50,992,334	12%	12.05%
GRUPO SUPERVIELLE ACC ORD B 1 V.\$ ESC	6,603,132	2%	1.56%
BBVA BANCO FRANCES SA	19,650,206	5%	4.64%
BANCO MACRO SA-B	41,337,701	10%	9.77%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	63,007,664	15%	14.89%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	3,115,255	1%	0.74%
CRESUD S.A.C.I.F.Y A.	354,846	0%	0.08%
ADECOAGRO	10,740,584	2%	2.54%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	3,122,500	1%	0.74%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	15,655,667	4%	3.70%
PAMPA ENERGIA SA	3,468,044	1%	0.82%
PAMPA ENERGIA SA	75,762,576	17%	17.91%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	42,433,193	10%	10.03%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	1,485,196	0%	0.35%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	16,945,587	4%	4.01%
TRANSENER S.A.-B	28,035,068	6%	6.63%
Equities	385,819,554	88.89%	91.19%
Fixed Income	48,234,912	11.11%	11.40%
Total Cartera de Inversiones	434,054,466	100.00%	102.59%

Security	Weight	Yield	Duration
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.23%	0.0
LEBAC	10.01%	26.85%	0.0
ON Corporativas - BADLAR Linked	90.01%	25.35%	1.5
ON ALBANESI CALASE II \$ VTO 25/10/2018	0.20%	26.31%	0.9
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	10.65%	25.21%	2.2
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	1.30%	26.00%	0.9
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 4 VTO 07/11/2017	1.93%	24.98%	0.1
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0.10%	25.38%	2.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	9.76%	24.96%	2.3
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	5.84%	25.46%	0.4
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.38%	25.73%	1.0
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	14.33%	24.93%	0.6
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.36%	24.99%	1.9
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.38%	25.18%	2.0
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	1.17%	26.49%	2.4
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	4.89%	25.99%	2.4
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	5.47%	26.20%	2.8
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	5.20%	25.23%	1.6
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	8.48%	25.18%	1.8
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.21%	26.26%	2.9
ON YPF CLASE 29 VENC 07/03/2020	2.71%	25.22%	1.2
ON YPF CLASE 36 VENC 10/02/2020	4.39%	25.74%	1.8
ON YPF CLASE 13 VENC 20/12/2018	7.64%	25.30%	0.6
ON AXION ENERGY CLASE 3 VENC 12/03/2020	0.38%	24.98%	1.9
ON YPF CLASE 41 VENC 24/09/2020	3.52%	26.00%	1.6
ON TARJETA NARANJA CLASE XXXII VTO 20/10/2017	0.72%	25.38%	0.0
Otros	-0.03%	0.00%	0.0
Total general	100.00%	19.59%	1.1