

11 de octubre de 2017

Carteras Weekly

FCI CONSULTATIO

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	0,64%	27,53%	3,0
Cheque de Pago Diferido	0,51%	24,26%	0,1
Fideicomisos Financieros ARS	2,07%	24,67%	0,6
Fondos Comunes de Inversion	0,02%	16,28%	0,0
LEBAC	46,35%	26,64%	0,1
Letras Provinciales - Badlar Linked	13,22%	25,47%	2,2
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0,42%	25,60%	0,3
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0,57%	26,08%	0,3
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	1,48%	25,52%	0,3
TITULO DE DEUDA PUBLICA DE ENTRE RIOS SERIE I VTO21/12/2017	0,07%	26,33%	0,3
TITULOS DE REESTRUCTURACION DE DEUDAS 2015 MENDOZA VTO 23/11/2018	0,56%	31,12%	0,3
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0,37%	25,97%	0,3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0,37%	25,18%	0,3
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	3,97%	24,96%	0,2
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0,22%	25,28%	0,3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1,86%	24,31%	0,2
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1,89%	25,41%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1,45%	25,85%	0,3
Letras Provinciales - Fixed Rate	12,52%	25,78%	0,1
LETRA DE LA PCIA DE BS AS 119 DIAS VTO 19/10/2017	5,27%	24,30%	0,2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0,45%	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	0,38%	24,34%	0,2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0,37%	27,75%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0,76%	26,90%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0,71%	27,30%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 18-01-18 A 119 DIAS	0,99%	27,13%	0,3
LETRA DEL TESORO DE LA CIUDAD DE BS AS A 56 DÍAS VTO 22/11/2017	3,42%	26,90%	0,3
ON Corporativas - BADLAR Linked	22,38%	25,20%	1,6
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0,10%	26,20%	0,3
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	0,04%	25,05%	0,3
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0,06%	24,56%	0,2
ON BACS CLASE XI VTO 10/11/2019	0,44%	25,28%	0,3
ON BANCO CIUDAD CLASE 10 VTO 06/12/2020	0,22%	25,30%	0,3
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0,07%	26,33%	0,3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0,15%	24,82%	0,2
ON BANCO ITAU CLASE 21 TV A 36 MESES VTO 26/12/2019	0,18%	25,06%	0,3
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0,15%	24,83%	0,2
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0,37%	24,72%	0,2
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0,97%	24,82%	0,2
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0,75%	25,84%	0,3
ON DISAL SA SERIE III CLASE E VTO 15/05/2018	0,08%	26,05%	0,3
ON JOHN DEERE CLASE 6 VENC 30/03/2018	0,07%	25,53%	0,3
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0,11%	25,07%	0,3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0,48%	25,22%	0,3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	0,06%	24,80%	0,2
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	0,16%	25,30%	0,3
ON QUICKFOOD CLASE 9 VTO 24/11/2022	0,28%	26,08%	0,3
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0,07%	27,30%	0,3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0,05%	24,24%	0,2
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0,22%	25,28%	0,3
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0,36%	25,32%	0,3
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0,25%	25,46%	0,3
ON TARJETA NARANJA CLASE 33 SERIE 2 VTO 13/04/2019	0,08%	25,32%	0,3
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0,11%	25,29%	0,3
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0,15%	24,82%	0,2

Security	Weight	Yield	Duration
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0,07%	24,07%	0,2
ON YPF CLASE 35 \$ VTO 24/09/2019	0,28%	25,80%	0,3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1,88%	25,57%	0,3
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0,07%	24,20%	0,2
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0,22%	24,77%	0,2
ON YPF CLASE 42 VENC 24/09/2020	0,36%	25,20%	0,3
ON TARJETA NARANJA CL 34 S 1 VTO 29/12/2017	0,58%	24,16%	0,2
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0,90%	24,83%	0,2
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0,15%	24,85%	0,2
ON LOS GROBO CLASE VI VENCE 09/05/2019	0,22%	25,31%	0,3
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0,11%	24,74%	0,2
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0,22%	24,81%	0,2
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0,58%	25,02%	0,3
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0,11%	24,79%	0,2
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0,15%	25,24%	0,3
ON BANCO ITAU CLASE 19 VENC 13/07/2019	0,15%	24,74%	0,2
ON SANTANDER RIO CLASE 15 VENC 19/09/2019	0,28%	24,90%	0,2
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0,11%	24,69%	0,2
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0,25%	24,76%	0,2
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0,22%	25,02%	0,3
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0,30%	25,76%	0,3
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	0,51%	24,82%	0,2
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2,16%	24,62%	0,2
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	0,60%	24,86%	0,2
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0,37%	26,33%	0,3
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	0,75%	25,83%	0,3
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0,63%	26,04%	0,3
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	1,66%	25,07%	0,3
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0,78%	25,03%	0,3
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0,68%	26,10%	0,3
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0,36%	25,33%	0,3
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0,16%	26,31%	0,3
ON TARJETA NARANJA CLASE 37 VENC 11/04/2022	0,46%	25,18%	0,3
ON Corporativas - Fixed Rate	0,70%	24,59%	0,2
ON AGROFINA CLASE 3 VTO 11/11/2017	0,14%	26,76%	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 PSA FINANCE ARGENTINA SERIE 21 VTO 15/11/2017	0,27%	23,74%	0,2
ON Corporativas - Inflation Linked	0,10%	24,36%	1,0
ON Corporativas - Repo Linked	0,59%	27,99%	2,0
Otros	-0,27%	0,00%	0,0
Plazo Fijo CER	1,18%	16,83%	0,0
Total general	100,00%	25,81%	0,4

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	5,18%	26,53%	5,31
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	4,15%	27,53%	0,28
BONO CUASIPAR CUAP ARS	1,03%	22,47%	0,22
Fideicomisos Financieros ARS	2,45%	25,02%	0,63
Fondos Comunes de Inversion	0,03%	16,27%	0,00
LEBAC	41,20%	26,64%	0,05
Letras Provinciales - Badlar Linked	13,59%	25,18%	2,21
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES CLASE 16 VENC 01/02/2020	0,23%	25,60%	0,26
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0,79%	26,08%	0,26
TITULO DE DEUDA CIUDAD DE BS AS CLASE 18 VTO	0,81%	25,52%	0,26
TITULO DE DEUDA DE LA PCIA DE SALTA CLASE 1 VTO 24/4/2018	0,02%	27,30%	0,27
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	1,04%	25,97%	0,26
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0,69%	25,18%	0,25
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	3,74%	24,96%	0,25
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0,64%	25,28%	0,25
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2,91%	24,31%	0,24
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1,13%	25,41%	0,25
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1,59%	25,85%	0,26
Letras Provinciales - Dolar Linked	0,35%	25,39%	0,87
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 1.95% VTO 20/12/2019	0,18%	26,67%	0,27
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0,16%	23,95%	0,24
Letras Provinciales - Fixed Rate	4,68%	26,73%	0,26
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	0,91%	27,30%	0,27
ON Corporativas - BADLAR Linked	24,98%	25,19%	1,65
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0,15%	26,20%	0,26
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0,04%	24,56%	0,25
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0,11%	26,33%	0,26
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0,23%	24,82%	0,25
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0,17%	24,83%	0,25
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0,23%	24,72%	0,25
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE XI VTO 20/01/2019	0,23%	25,32%	0,25
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0,47%	24,82%	0,25
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	0,75%	25,84%	0,26
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0,17%	25,07%	0,25
ON MSU SERIE 4 CLASE 2 VTO 03/12/2017	0,23%	27,33%	0,27
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	1,05%	25,22%	0,25
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 30 VTO 21/10/2017	0,08%	24,24%	0,24
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 31 VENC 09/05/2018	0,23%	23,36%	0,23
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 35 VTO 28/10/2019	0,17%	25,28%	0,25
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0,39%	25,32%	0,25
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0,28%	25,46%	0,25
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0,12%	25,29%	0,25
ON TARJETAS CUYANAS CLASE 24 SERIE 2 VTO 05/05/2019	0,24%	26,54%	0,27
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0,24%	24,82%	0,25
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0,11%	24,07%	0,24
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	2,73%	25,57%	0,26
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0,11%	24,20%	0,24
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0,34%	24,77%	0,25
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	1,75%	24,83%	0,25
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0,35%	24,85%	0,25
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0,35%	24,74%	0,25

Security	Weight	Yield	Duration
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0,69%	24,81%	0,25
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	1,36%	25,02%	0,25
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0,23%	24,79%	0,25
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0,23%	25,24%	0,25
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0,17%	24,69%	0,25
ON TOYOTA CF CLASE 23 VENC 08/06/2019	0,51%	24,76%	0,25
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0,51%	25,02%	0,25
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0,12%	25,76%	0,26
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	1,14%	24,82%	0,25
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2,55%	24,62%	0,25
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	1,29%	24,86%	0,25
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0,58%	26,33%	0,26
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	1,14%	26,04%	0,26
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	0,68%	25,07%	0,25
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0,92%	25,03%	0,25
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	1,00%	26,10%	0,26
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0,29%	25,33%	0,25
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0,24%	26,31%	0,26
ON Corporativas - Fixed Rate	5,02%	19,58%	2,72
ON AGROFINA CLASE 3 VTO 11/11/2017	0,52%	26,76%	0,27
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0,18%	24,00%	0,24
ON PSA FINANCE ARGENTINA SERIE 21 VTO 15/11/2017	0,30%	23,74%	0,24
ON YPF CLASE 52 VENC 09/05/2022	4,02%	18,13%	0,18
ON Corporativas - USD	1,53%	27,51%	1,84
ON GENERACION MEDITERRANEA CL 6 VTO 16/02/2020 USD	0,27%	28,87%	0,29
ON JOHN DEERE CLASE IX VTO 22/12/2019	0,35%	27,44%	0,27
ON LOS GROBO CLASE VII VENC 09/05/2019	0,60%	27,38%	0,27
ON LIAG ARGENTINA SERIE VIII CLASE 2 VENC 25/11/2019	0,31%	26,65%	0,27
Otros	-0,39%	0,00%	0,00
ON Corporativas - Repo Linked	1,38%	27,99%	1,98
Total general	100,00%	25,71%	0,77

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	1,15%	26,65%	4,5
Bonos Soberanos - CER Linked	50,54%	27,07%	4,7
BONCER 2021 - BONO DEL TESORO DE LA NAC ARG 2,5% VENC 22/07/2021	13,18%	27,10%	0,3
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	30,22%	27,53%	0,3
BONO CUASIPAR CUAP ARS	3,61%	22,47%	0,2
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	3,53%	27,64%	0,3
Fideicomisos Financieros ARS	0,09%	24,57%	0,4
Fondos Comunes de Inversion	0,00%	16,41%	0,0
LEBAC	33,85%	26,61%	0,0
Letras Provinciales - Badlar Linked	3,51%	24,58%	2,8
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1,13%	24,96%	0,2
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0,24%	25,28%	0,3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	2,14%	24,31%	0,2
Letras Provinciales - Dolar Linked	1,65%	26,41%	0,8
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0,08%	37,94%	0,4
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	1,10%	26,64%	0,3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0,47%	23,95%	0,2
Letras Provinciales - Fixed Rate	2,21%	26,97%	0,2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0,48%	26,70%	0,3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0,24%	26,75%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0,77%	26,90%	0,3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0,72%	27,30%	0,3
ON Corporativas - BADLAR Linked	4,33%	24,87%	1,4
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0,14%	26,20%	0,3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0,87%	25,57%	0,3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	3,31%	24,62%	0,2
ON Corporativas - Fixed Rate	2,11%	18,13%	3,4
ON Corporativas - USD	0,26%	27,38%	1,5
Otros	-0,03%	0,00%	0,0
ON Corporativas - Inflation Linked	0,35%	24,36%	1,0
Total general	100,00%	26,57%	2,7

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	35,52%	26,17%	3,3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	10,26%	26,36%	0,3
BONO PROV DE BS AS REGS 6,5% 15/02/2023	1,93%	25,62%	0,3
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	9,93%	26,65%	0,3
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	11,30%	25,54%	0,3
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0,63%	26,68%	0,3
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	1,46%	26,87%	0,3
Bonos Soberanos - BCS	54,61%	25,28%	6,2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	5,78%	24,46%	0,2
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	15,83%	24,42%	0,2
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4,23%	26,70%	0,3
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	9,47%	24,89%	0,2
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5,07%	24,46%	0,2
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	3,56%	27,25%	0,3
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	7,41%	26,13%	0,3
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3,26%	27,36%	0,3
Fondos Comunes de Inversion	0,00%	16,19%	0,0
LEBAC	2,00%	26,60%	0,0
ON Corporativas - BADLAR Linked	0,23%	28,83%	1,8
ON Corporativas - Dolar Linked	1,07%	35,07%	1,5
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0,09%	19,33%	0,2
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	0,98%	36,52%	0,4
ON Corporativas - USD	6,61%	27,32%	2,7
ON IRSA CLASE 8 VTO 09/09/2019	4,54%	27,67%	0,3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	2,07%	26,56%	0,3
Otros	-0,03%	0,00%	0,0
Total general	100,00%	25,85%	4,7

Security	Weights	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	40,60%	5,80%	3,6
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	9,68%	5,90%	0,1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	13,28%	6,14%	0,1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	13,18%	5,21%	0,1
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	4,47%	6,33%	0,1
Bonos Soberanos - BCS	59,39%	5,05%	6,3
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	16,66%	4,30%	0,0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	4,12%	4,27%	0,0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3,48%	6,18%	0,1
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	11,51%	4,66%	0,0
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	5,57%	4,30%	0,0
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4,80%	6,64%	0,1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	9,50%	5,70%	0,1
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	3,75%	6,73%	0,1
Fondos Comunes de Inversion	0,00%	-3,33%	0,0
Otros	0,01%	0,00%	0,0
Total general	100,00%	5,32%	5,2

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	5,48%	25,74%	2,6
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	1,36%	26,36%	0,3
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	4,11%	25,54%	0,3
Bonos Soberanos - BCS	25,15%	25,74%	7,0
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	3,16%	24,46%	0,2
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	2,86%	26,70%	0,3
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 5.75% VENC. 2025	8,34%	24,89%	0,2
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1,04%	24,46%	0,2
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4,90%	26,13%	0,3
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	4,85%	27,36%	0,3
Bonos Soberanos - CER Linked	4,06%	27,53%	3,0
Fondos Comunes de Inversion	0,00%	16,34%	0,0
LEBAC	50,60%	26,64%	0,1
Letras Provinciales - Badlar Linked	3,69%	24,62%	3,1
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1,79%	24,96%	0,2
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1,89%	24,31%	0,2
Letras Provinciales - Dolar Linked	4,99%	26,26%	1,2
LETRA DE LA PCIA DEL CHUBUT CLASE 2 4,5% VENC 30/03/2021 - DOLAR LINKED	2,90%	26,09%	0,3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0,18%	37,94%	0,4
Título de Deuda Pcia Mendoza III usd link 2018	0,39%	27,34%	0,3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	1,11%	23,95%	0,2
Títulos de Deuda Pcia Mendoza II usd link 2018	0,42%	27,58%	0,3
ON Corporativas - Dolar Linked	3,35%	35,16%	1,0
ON CRESUD SERIE 8 CLASE 16 USD LINK 19/01/2018	2,45%	35,29%	0,4
ON IMPSA 11 18/6/2016 dolar link	0,02%	19,33%	0,2
ON IMPSA 12 28/12/2015 dolar link	0,04%	19,33%	0,2
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0,02%	19,33%	0,2
ON YPF CLASE 22 VENC 29/07/2020	0,81%	36,52%	0,4
ON Corporativas - Fixed Rate	1,20%	18,10%	3,4
ON Corporativas - USD	1,36%	26,67%	4,3
ON AGROFINA CL 6 VTO 16/02/19 USD	0,14%	27,66%	0,3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	1,22%	26,56%	0,3
Otros	0,12%	0,00%	0,0
Total general	100,00%	26,44%	2,4

Security	Weight C	YTM BID	MD
Bonos Provinciales - BCS	24,38%	5,71%	3,3
BONO PROV BS AS 2021 10.875 VTO 26/01/2021	4,85%	5,90%	0,1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	9,65%	6,14%	0,1
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9.95 VENC 09/06/2021	9,88%	5,21%	0,1
Bonos Soberanos - BCS	27,41%	5,19%	6,2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	7,99%	4,30%	0,0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	6,58%	4,27%	0,0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4,18%	6,18%	0,1
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4,80%	6,64%	0,1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	3,86%	5,70%	0,1
Fondos Comunes de Inversion	0,27%	-2,87%	0,0
LEBAC	10,03%	6,10%	0,0
Letras Provinciales - Dolar Linked	10,19%	5,23%	0,9
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 17/05/19	5,59%	4,49%	0,0
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	4,60%	6,13%	0,1
ON Corporativas - USD	1,05%	6,07%	4,6
Otros	1,32%	0,00%	0,0
BRAZIL - Corporate USD	17,36%	4,81%	4,1
BANBRA 5 7/8 VENC 01/19/2023	5,35%	4,84%	0,0
CAIXBR 3 1/2 VENC 11/07/2022	4,97%	3,89%	0,0
CAIXBR 7 1/4 VENC 07/23/2024	3,51%	6,59%	0,1
ITAU 5 1/8 VTO 13/05/2023 CORP	3,53%	4,25%	0,0
URUGUAY - Sovereign USD	7,99%	3,21%	6,3
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 1/2 08/14/2024	3,99%	2,94%	0,0
REPUBLICA ORIENT URUGUAY / URUGUA 4 3/8 10/27/2027	4,00%	3,47%	0,0
Total general	100,00%	5,15%	3,9

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	90,34%	2,54%	0,4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17 - L2DD7D	1,27%	2,25%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-10-17	7,87%	2,50%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-10-17	6,73%	2,05%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 10-11-17	4,68%	2,10%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-11-17	2,09%	3,35%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17	2,58%	2,25%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-01-18	5,48%	2,55%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-01-18	4,83%	2,50%	0,0
LETE DEL TESORO A 196 DIAS VTO 09/02/2018 / LTDF8D	6,41%	2,55%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 23-02-18 A 196 DIAS	7,21%	2,85%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-03-18 A 182 DIAS	9,69%	2,45%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18 A 273 DIAS	5,09%	3,10%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18	3,31%	3,10%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-04-18	1,99%	2,70%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27/04/18	0,94%	2,30%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 11-05-18 A 224 DIAS	4,66%	2,35%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-05-18	6,08%	3,10%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-06-18	1,11%	2,78%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-06-18	0,62%	3,10%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES A 455 DIAS VENC 10/08/2018	2,49%	2,85%	0,0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 28-09-18 A 378 DIAS	5,18%	2,25%	0,0
Otros	9,66%	0,00%	0,0
Total general	100,00%	2,54%	0,4

Security	Weight	Yield	Duration
Cheque de Pago Diferido	70,79%	24,34%	0,9
Fideicomisos Financieros ARS	1,18%	24,40%	0,7
Fondos Comunes de Inversion	0,00%	16,37%	0,0
LEBAC	30,72%	26,60%	0,0
ON Corporativas - BADLAR Linked	6,61%	24,65%	0,8
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 1 VTO 27/8/2018	0,00%	27,33%	0,6
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 2 VTO 27/8/2018	0,00%	27,73%	0,6
ON BICE CLASE 3 VTO 19/06/2018	2,18%	24,56%	0,7
ON IMPSA Clase 10 18/06/15	0,00%	0,00%	0,0
ON INVAP CLASE 3 VTO 21/10/2020	0,31%	27,33%	1,1
ON PYME EMP. INDUSTRIAL MEDITERRANEO SERIE I VTO 26/2/2018	0,00%	31,14%	0,3
ON PYME MONTEVER SA SERIE 1 VTO 14/05/2018	0,01%	28,33%	0,3
ON PYME PLASTICOS DISE CLASE 3 VTO 18/12/2018	0,01%	28,31%	0,9
ON PYME PLURAL COOP CLASE 2 VTO 10/09/2019	0,04%	28,36%	0,9
ON PYME SOUTH MANAGEMENT 10/12/2018	0,01%	27,33%	0,5
ON PYMES ACTUAL SERIE 4 VTO 26/11/2018	0,00%	29,05%	0,5
ON PYMES MERANOL EN PESOS CLASE 2 VENC 30/06/2019	0,04%	21,33%	1,3
ON PYMES VARCAM CLASE 1 VENC 11/11/2018	0,00%	27,33%	0,5
ON ROGIRO ACEROS CLASE 9 VTO 31/10/2018	0,06%	27,33%	0,5
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0,19%	27,30%	1,1
ON SAVANT PHARM SERIE 3 CLASE G VTO 30/9/2018	0,00%	27,33%	0,7
ON BICE CLASE 1 VTO 16/02/2018	0,49%	20,31%	0,3
ON PYMES DEL FABRO HERMANOS Y CIA SA SERIE I VENC 02/05/2019	0,04%	27,30%	0,8
ON ANGEL ESTRADA CLASE 5 VTO 01/06/2018	0,82%	25,56%	0,5
ON ROGIRO CLASE 12 VTO 31/05/2019	0,34%	24,87%	0,8
ON BICE CLASE 5 VTO 27/12/2018	1,83%	24,07%	1,1
ON PYME CNV RED SURCOS SERIE I \$ VTO 27/06/2019	0,04%	25,52%	0,9
ON SICOM SERIE IV VTO 12-09-2020	0,06%	27,81%	1,5
ON INTEGRACION ELECTRICA SUR ARG SA VCP CL 5 VTO 25/09/2018	0,16%	29,09%	0,7
ON Corporativas - USD	0,26%	27,97%	1,6
Otros	-0,33%	0,00%	0,0
Total general	100,00%	24,62%	0,6

Security	Weight	MAR	Over / Under
CRESUD S.A.C.I.F.Y A.	1,15%	3,88%	-2,73%
OVOPROT INTERNATIONAL SA	0,05%	0,00%	0,05%
YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,65%	0,00%	1,66%
YPF S.A.-D	11,23%	7,93%	3,31%
IRSA SA	0,52%	0,00%	0,52%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	1,52%	1,24%	0,28%
BBVA BANCO FRANCES SA	5,83%	5,07%	0,76%
BBVA BANCO FRANCES SA	5,83%	5,07%	0,76%
BANCO MACRO SA-B	7,51%	4,19%	3,32%
BANCO HIPOTECARIO SA-D SHS	0,00%	0,00%	0,00%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	12,91%	8,88%	4,04%
SIDERAR-A	5,53%	5,05%	0,49%
ALUAR ALUMINIO	1,87%	3,21%	-1,34%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	2,86%	3,06%	-0,20%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2,29%	0,00%	2,29%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	7,07%	3,17%	3,90%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	7,07%	3,17%	3,90%
PAMPA ENERGIA SA	18,70%	11,26%	7,46%
PAMPA ENERGIA SA	18,70%	11,26%	7,46%
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	0,45%	3,03%	-2,59%
TRANSENER S.A.-B	5,66%	4,45%	1,21%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4,63%	4,66%	-0,03%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4,63%	4,66%	-0,03%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	0,37%	4,45%	-4,08%
Total Cartera Renta Variable	92,795%	0,98	-4,859%
Total Cartera Renta Fija	7,256%		
Total Cartera de Inversiones	100,000%		

Security	ARS	Weight C	Dilution W
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	3.450.000	0,83%	0,80%
YPF S.A.-D	56.297.187	13,51%	13,09%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	6.658.028	1,60%	1,55%
BBVA BANCO FRANCES SA	19.941.680	4,78%	4,64%
BANCO MACRO SA-B	41.366.716	9,92%	9,62%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	63.247.890	15,17%	14,71%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	3.092.092	0,74%	0,72%
CRESUD S.A.C.I.F.Y A.	349.445	0,08%	0,08%
ADECOAGRO SA	10.224.790	2,45%	2,38%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	3.025.000	0,73%	0,70%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	15.684.499	3,76%	3,65%
PAMPA ENERGIA SA	80.250.620	19,25%	18,67%
PAMPA ENERGIA SA	80.250.620	19,25%	18,67%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	43.198.286	10,36%	10,05%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17.367.761	4,17%	4,04%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17.367.761	4,17%	4,04%
TRANSENER S.A.-B	29.769.230	7,14%	6,92%
Equities	399.021.029	95,73%	92,81%
Fixed Income	17.783.357	4,27%	4,14%
Total Cartera de Inversiones	416.804.386	100,00%	96,95%

Security	Weight	Yield	Duration
Fondos Comunes de Inversion	0,07%	16,45%	0,00
LEBAC	10,02%	26,60%	0,02
ON Corporativas - BADLAR Linked	89,97%	25,19%	1,52
ON ALBANESI CALASE II \$ VTO 25/10/2018	0,20%	26,15%	0,26
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	10,65%	25,05%	0,25
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	1,23%	25,84%	0,26
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 4 VTO 07/11/2017	1,93%	24,83%	0,25
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	0,10%	25,22%	0,25
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	9,76%	24,80%	0,25
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	5,84%	25,30%	0,25
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0,38%	25,57%	0,26
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	14,34%	24,77%	0,25
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0,36%	24,83%	0,25
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0,38%	25,02%	0,25
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	1,17%	26,33%	0,26
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	4,89%	25,83%	0,26
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	5,47%	26,04%	0,26
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	5,20%	25,07%	0,25
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	8,48%	25,03%	0,25
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0,21%	26,10%	0,26
ON YPF CLASE 29 VENC 07/03/2020	2,71%	25,06%	0,25
ON YPF CLASE 36 VENC 10/02/2020	4,39%	25,58%	0,26
ON YPF CLASE 13 VENC 20/12/2018	7,64%	25,14%	0,25
ON AXION ENERGY CLASE 3 VENC 12/03/2020	0,38%	24,82%	0,25
ON YPF CLASE 41 VENC 24/09/2020	3,52%	25,84%	0,26
ON TARJETA NARANJA CLASE XXXII VTO 20/10/2017	0,72%	25,22%	0,25
Otros	-0,06%	0,00%	0,00
Total general	100,00%	25,35%	1,36