

16 de noviembre de 2017

Carteras Weekly

FCI CONSULTATIO

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	0.66%	28.99%	2.9
Cheque de Pago Diferido	0.03%	24.28%	0.0
Fideicomisos Financieros ARS	2.27%	26.55%	0.6
Fondos Comunes de Inversion	1.61%	16.13%	0.0
LEBAC	49.12%	28.51%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	7.80%	27.04%	1.8
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.63%	27.28%	0.3
TITULO DE DEUDA PUBLICA DE ENTRE RIOS SERIE I VTO21/12/2017	0.08%	27.53%	0.3
TITULOS DE REESTRUCTURACION DE DEUDAS 2015 MENDOZA VTO 23/11/2018	0.62%	31.27%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	0.40%	27.17%	0.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.40%	26.38%	0.3
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	2.02%	26.35%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.23%	26.48%	0.3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	0.56%	25.90%	0.3
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	1.27%	26.69%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.58%	27.05%	0.3
Letras Provinciales - Fixed Rate	7.95%	26.86%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.49%	26.70%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 213 DIAS VTO 23/02/2018	0.20%	26.75%	0.3
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIII CLASE III 217 DIAS VTO 26/01/2018 / BUE18	0.41%	24.34%	0.2
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.40%	27.75%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.83%	26.90%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 22-02-18 A 154 DIAS	0.77%	27.30%	0.3
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 18-01-18 A 119 DIAS	1.08%	27.13%	0.3
LETRA DEL TESORO DE LA CIUDAD DE BS AS A 56 DÍAS VTO 22/11/2017	3.76%	26.90%	0.3
ON Corporativas - BADLAR Linked	30.05%	26.51%	1.7
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.10%	27.40%	0.3
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	0.04%	26.25%	0.3
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.07%	25.76%	0.3
ON BACS CLASE XI VTO 10/11/2019	0.45%	26.48%	0.3
ON BANCO CIUDAD CLASE 10 VTO 06/12/2020	0.24%	26.50%	0.3
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.08%	27.53%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.16%	26.02%	0.3
ON BANCO ITAU CLASE 21 TV A 36 MESES VTO 26/12/2019	0.20%	26.26%	0.3
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.15%	26.03%	0.3
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.38%	25.92%	0.3
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	0.62%	26.28%	0.3
ON DISAL SA SERIE III CLASE E VTO 15/05/2018	0.06%	27.25%	0.3
ON JOHN DEERE CLASE 6 VENC 30/03/2018	0.08%	26.73%	0.3
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.11%	26.27%	0.3
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	0.07%	26.00%	0.3
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	0.18%	26.50%	0.3
ON QUICKFOOD CLASE 9 VTO 24/11/2022	0.31%	27.28%	0.3
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.08%	28.50%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.39%	26.52%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.28%	26.66%	0.3
ON TARJETA NARANJA CLASE 33 SERIE 2 VTO 13/04/2019	0.08%	26.52%	0.3
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	26.49%	0.3
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.15%	26.02%	0.3
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.08%	25.27%	0.3

Security	Weight	Yield	Duration
ON YPF CLASE 35 \$ VTO 24/09/2019	0.31%	27.00%	0.3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	2.06%	26.20%	0.3
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.08%	25.40%	0.3
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.24%	25.97%	0.3
ON YPF CLASE 42 VENC 24/09/2020	0.39%	26.40%	0.3
ON TARJETA NARANJA CL 34 S 1 VTO 29/12/2017	0.64%	25.36%	0.3
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.99%	26.03%	0.3
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.15%	26.05%	0.3
ON LOS GROBO CLASE VI VENCE 09/05/2019	0.23%	26.51%	0.3
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.11%	25.94%	0.3
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.23%	25.99%	0.3
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.63%	26.22%	0.3
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.12%	25.99%	0.3
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.16%	26.44%	0.3
ON BANCO ITAU CLASE 19 VENC 13/07/2019	0.15%	25.94%	0.3
ON SANTANDER RIO CLASE 15 VENC 19/09/2019	0.31%	26.10%	0.3
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.12%	25.89%	0.3
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.24%	26.22%	0.3
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0.33%	26.96%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.24%	26.44%	0.3
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	0.62%	26.06%	0.3
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.38%	27.53%	0.3
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	0.82%	27.03%	0.3
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	0.69%	27.82%	0.3
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	7.32%	26.73%	0.3
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.80%	26.23%	0.3
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.67%	27.30%	0.3
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.40%	26.53%	0.3
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.18%	27.51%	0.3
ON Rombo Cia Financiera Serie 39	0.54%	26.62%	0.3
ON BANCO CIUDAD - CLASE 14	1.54%	26.32%	0.3
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 40 VTO 02/11/2020	0.38%	27.18%	0.3
ON HIPOTECARIO CLASE 48 VTO 07/11/2022	1.52%	26.24%	0.3
ON Corporativas - Fixed Rate	0.31%	24.33%	0.3
ON CORDIAL CIA FINANCIERA CL 12 TF VTO 26/12/2017	0.12%	24.88%	0.2
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.19%	24.00%	0.2
ON Corporativas - Inflation Linked	0.11%	25.59%	0.9
ON Corporativas - Repo Linked	0.39%	26.57%	2.0
Otros	-0.28%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	27.13%	267.0

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	3.38%	29.30%	7.33
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 T.A.S. 2% ESC	1.20%	28.99%	0.29
BONOS DISCOUNT EN PESOS AL 5.83 VENC 15/12/2033	1.58%	29.33%	0.29
BONO CUASIPAR CUAP ARS	0.42%	30.05%	0.30
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	0.18%	29.30%	0.29
Fideicomisos Financieros ARS	2.26%	26.57%	0.64
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.24%	0.00
LEBAC	52.26%	28.50%	0.13
Letras Provinciales - Badlar Linked	8.03%	26.70%	1.79
LETRAS DE LA PCIA DE NEQUEN MEDIANO PZO CL1 S1 VTO 9/9/2020	0.79%	27.28%	0.27
TITULO DE DEUDA DE LA PCIA DE SALTA CLASE 1 VTO 24/4/2018	0.01%	28.50%	0.29
LETRA DEL TESORO DE LA PCIA DE NEUQUEN CLASE 1 SERIE 1 VENC 2021	1.05%	27.17%	0.27
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 1 VTO 23/11/2017	0.70%	26.38%	0.26
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	2.30%	26.35%	0.26
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE RIO NEGRO SERIE III CLASE 3	0.60%	26.48%	0.26
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	0.46%	25.90%	0.26
T.D. PCIA. MENDOZA VTO 09/06/2021 CL.1 \$ / 32913 / PMJ21	0.51%	26.69%	0.27
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA NEUQUEN GARANTIZADAS CLASE 2 SERIE II VENC 06/06/18	1.60%	27.05%	0.27
Letras Provinciales - Dolar Linked	0.32%	25.82%	0.86
BONO CIUDAD DE BUENOS AIRES 1.95% VTO 20/12/2019	0.19%	24.66%	0.25
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.13%	27.51%	0.28
Letras Provinciales - Fixed Rate	4.72%	26.73%	0.16
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	1.06%	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	0.60%	24.34%	0.24
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXV CLASE II 211 DIAS VTO 23/03/2018	0.75%	27.75%	0.28
LETRAS DEL TESORO DE LA PCIA DE BS AS EN PESOS VTO 16-11-17 A 56 DIAS	0.98%	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	24.14%	26.53%	1.74
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.15%	27.40%	0.27
ON BACS CLASE 7 VENC 18/11/2017	0.04%	25.76%	0.26
ON BANCO COMAFI CLASE 15 TASA VARIABLE VENC 15/03/2018	0.11%	27.53%	0.28
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 39 VENC 18/08/2019	0.23%	26.02%	0.26
ON BANCO PROVINCIA CL 2 A TV A 36 MESES, VTO 08/11/2019	0.17%	26.03%	0.26
ON BANCO SANTANDER RIO CLASE 13 VENC 20/07/2019	0.22%	25.92%	0.26
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE XI VTO 20/01/2019	0.22%	26.52%	0.27
ON LEDESMA CLASE 5 VENC 25/07/2019	0.17%	26.27%	0.26
ON MSU SERIE 4 CLASE 2 VTO 03/12/2017	0.23%	28.53%	0.29
ON ROMBO CIA FINANCIERA SERIE 31 VENC 09/05/2018	0.15%	24.56%	0.25
ON TARJETA NARANJA CL 35 S2 VTO 27/09/2020	0.39%	26.52%	0.27
ON TARJETA NARANJA CL 36 S2 VTO 07/12/2019	0.29%	26.66%	0.27
ON TARJETAS CUYANAS CL XXVI S2 VTO 24/10/2020	0.11%	26.49%	0.26
ON TARJETAS CUYANAS CLASE 24 SERIE 2 VTO 05/05/2019	0.23%	27.74%	0.28
ON TARJETAS CUYANAS SA CL 27 VTO 10/02/2020	0.22%	26.02%	0.26
ON TOYOTA CIA FCIERA ARG CLASE 19 VTO 22/06/2018	0.11%	25.27%	0.25
ON BANCO COMAFI CLASE 17 VENC 23/02/2019	0.12%	25.40%	0.25
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	0.35%	25.97%	0.26
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	1.76%	26.03%	0.26
ON BACS CLASE 13 VENC 28/04/2020	0.33%	26.05%	0.26
ON CCF CCLASE 14 VENC 10/05/2019	0.33%	25.94%	0.26

Security	Weight	Yield	Duration
ON GPAT SERIE 27 CLASE B VENC 10/05/2020	0.66%	25.99%	0.26
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	1.37%	26.22%	0.26
ON BANCO COMAFI 18 CLASE A VENC 18/02/2020	0.23%	25.99%	0.26
ON AGROMETAL CLASE 1 VENC 24/11/2018	0.23%	26.44%	0.26
ON MILICIC SERIE 4 VENC 06/06/2019	0.17%	25.89%	0.26
ON TARJETAS CUYANAS CL 28 SERIE II VTO 09/06/2021	0.51%	26.22%	0.26
ON ALBANESI CLASE III \$ VTO 15/06/2021 / LSC30	0.12%	26.96%	0.27
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	2.42%	26.44%	0.26
ON BANCO SUPERVIELLE CL A BADLAR 4.50% \$ VTO 09/08/2020	1.22%	26.06%	0.26
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	0.55%	27.53%	0.28
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	1.15%	27.82%	0.28
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	5.46%	26.73%	0.27
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	0.87%	26.23%	0.26
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.91%	27.30%	0.27
ON BANCO SANTANDER RIO SA CLASE 9 VTO 19/11/2018	0.29%	26.53%	0.27
ON GENERACION MEDITERRANEA CLASE 8 VTO 29/08/2021	0.25%	27.51%	0.28
ON Rombo Cia Financiera Serie 39	0.44%	26.62%	0.27
ON HIPOTECARIO CLASE 48 VTO 07/11/2022	1.37%	26.24%	0.26
ON Corporativas - Fixed Rate	4.29%	18.76%	3.40
ON GPAT CIA FINANCIERA SERIE XXV VTO 08/05/2018	0.18%	24.00%	0.24
ON YPF CLASE 52 VENC 09/05/2022	4.11%	18.53%	0.19
ON Corporativas - USD	1.51%	28.79%	1.75
ON GENERACION MEDITERRANEA CL 6 VTO 16/02/2020 USD	0.27%	30.17%	0.30
ON JOHN DEERE CLASE IX VTO 22/12/2019	0.34%	28.72%	0.29
ON LOS GROBO CLASE VII VENC 09/05/2019	0.59%	28.66%	0.29
ON LIAG ARGENTINA SERIE VIII CLASE 2 VENC 25/11/2019	0.31%	27.92%	0.28
Otros	-1.14%	0.00%	0.0
ON Corporativas - Repo Linked	0.23%	26.57%	1.99
Grand Total	100.00%	26.81%	449.00

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - CER Linked	34.26%	29.11%	5.2
BONOS CONSOLIDACION PESOS 6 TA.S. 2% ESC	27.00%	28.99%	0.3
BONO CUASIPAR CUAP ARS	2.34%	30.05%	0.3
BONOS PAR EN PESOS VENC 31/12/2038	4.92%	29.30%	0.3
Fideicomisos Financieros ARS	0.07%	25.77%	0.2
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.24%	0.0
LEBAC	51.42%	28.48%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	0.31%	26.48%	0.4
Letras Provinciales - Dolar Linked	1.92%	27.73%	0.8
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.11%	39.32%	0.4
PUO19 BONO PARA EL DESARROLLO E INFRAESTRUCTURA DEL CHUBUT - CLASE I	1.31%	26.87%	0.3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.50%	27.51%	0.3
Letras Provinciales - Fixed Rate	3.04%	26.97%	0.1
LETRA PCIA CHUBUT SERIE XXXIV CLASE III 121 DIAS VTO 23/11/2017 / BU3N7	0.66%	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	0.99%	27.30%	0.3
ON Corporativas - BADLAR Linked	5.68%	26.42%	1.4
ON AGROFINA CL 5 VTO 16/02/2019	0.19%	27.40%	0.3
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	1.20%	26.20%	0.3
ON BANCO HIPOTECARIO SERIE 40 VTO 12/01/2020	4.29%	26.44%	0.3
ON Corporativas - Fixed Rate	2.61%	18.53%	3.5
ON Corporativas - USD	0.34%	28.66%	1.4
Otros	-0.12%	0.00%	0.0
ON Corporativas - Inflation Linked	0.48%	25.59%	0.9
Grand Total	100.00%	28.10%	2.1

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	14.17%	27.84%	4.5
BONO PROV DE BS AS REGS 6,5% 15/02/2023	1.95%	27.06%	0.3
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	10.10%	27.94%	0.3
TITULOS DE DEUDA PCIA DE CORDOBA CLASE 1 VENC 27/10/2026	0.64%	27.95%	0.3
BONO PCIA DE CORDOBA PDCAR 7 VTO 01/08/2027	1.48%	28.19%	0.3
Bonos Soberanos - BCS	76.42%	25.92%	4.8
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	14.45%	25.88%	0.3
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	20.34%	25.96%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	14.87%	25.70%	0.3
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.29%	27.99%	0.3
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.87%	25.88%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	1.93%	28.74%	0.3
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	7.43%	27.14%	0.3
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	4.15%	22.93%	0.2
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.97%	28.79%	0.3
BONOS DE LA NACIÓN ARGENTINA EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES 8% 2020" (BONAR 2020 USD	5.12%	23.24%	0.2
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.22%	0.0
LEBAC	1.03%	28.40%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	0.24%	30.03%	1.7
ON Corporativas - Dolar Linked	0.09%	20.53%	0.0
ON Corporativas - USD	6.75%	28.59%	2.6
ON IRSA CLASE 8 VTO 09/09/2019	4.65%	28.95%	0.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	2.10%	27.77%	0.3
Otros	1.30%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	26.39%	4.6

Security	Weights	Yield	Duration
Bonos Provinciales - BCS	18.76%	6.20%	5.0
PROVINCIA DE BUENOS AIRES 9 1/8 03/16/2024	13.53%	6.15%	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	4.77%	6.36%	0.1
Bonos Soberanos - BCS	76.92%	4.51%	4.9
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	14.64%	4.45%	0.0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	19.66%	4.51%	0.0
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	14.54%	4.30%	0.0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	3.71%	6.19%	0.1
BONOS DE LA NACION ARGENTINA EN DOLARES ESTADOUNIDENSES 7.625% VENC. 2037	1.58%	4.45%	0.0
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	2.04%	6.82%	0.1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	10.00%	5.49%	0.1
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	3.91%	2.00%	0.0
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.85%	6.85%	0.1
BONOS DE LA NACIÓN ARGENTINA EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES 8% 2020" (BONAR 2020 USD	4.99%	2.25%	0.0
Otros	4.32%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	4.84%	4.9

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	18.13%	26.49%	6.3
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	5.52%	25.96%	0.3
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 6 7/8 VTO 22/04/2021	1.19%	25.70%	0.3
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	2.88%	27.99%	0.3
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	4.87%	27.14%	0.3
TITULOS DISCOUNT EN USD (LA LEY ARG) / DICA	2.06%	22.93%	0.2
PARY - TÍTULOS PAR EN DÓLARES ESTADOUNIDENSES LA LEY NY VTO 31/12/2038	1.62%	28.79%	0.3
Bonos Soberanos - CER Linked	6.19%	29.12%	4.8
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.22%	0.0
LEBAC	64.18%	28.56%	0.1
Letras Provinciales - Badlar Linked	3.51%	26.10%	2.9
TITULOS DE DEUDA PUBLICA CLASE 22 A TASA VARIABLE CON VENC 29/03/2024	1.57%	26.35%	0.3
TITULOS DE DEUDA EN PESOS DE LA PCIA DE BS AS VENC 31/05/2022	1.93%	25.90%	0.3
Letras Provinciales - Dolar Linked	4.63%	27.97%	1.2
LETRA DE LA PCIA DEL CHUBUT CLASE 2 4,5% VENC 30/03/2021 - DOLAR LINKED	2.82%	27.93%	0.3
LETRAS DE LA PCIA DE NEUQUEN SERIE 3 CLASE 2 U\$S VTO 23/11/2017	0.18%	39.32%	0.4
Título de Deuda Pcia Mendoza III usd link 2018	0.40%	26.21%	0.3
TITULOS DE DEUDA DE NEUQUEN GARANTIZADOS CLASE 2 SERIE I	0.89%	27.51%	0.3
Títulos de Deuda Pcia Mendoza II usd link 2018	0.34%	25.36%	0.3
ON Corporativas - Dolar Linked	0.09%	20.53%	0.0
ON IMPSA 11 18/6/2016 dolar link	0.02%	20.53%	0.2
ON IMPSA 12 28/12/2015 dolar link	0.05%	20.53%	0.2
ON IMPSA Clase 9 cupon 7% 26/12/14	0.02%	20.53%	0.2
ON Corporativas - Fixed Rate	1.12%	18.53%	3.5
ON Corporativas - USD	1.37%	27.89%	4.2
ON AGROFINA CL 6 VTO 16/02/19 USD	0.14%	28.94%	0.3
ON YPF CLASE 28 8,75% VENC 04/04/2024	1.23%	27.77%	0.3
Otros	0.78%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	27.66%	1.9

Security	Weight C	YTM BID	MD
Bonos Provinciales - BCS	9.62%	6.15%	4.3
Bonos Soberanos - BCS	43.11%	4.97%	5.2
AY24D - BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES EST 8,75% 07/05/2024 (BONAR 2024)	19.20%	4.45%	0.0
BONO INTERNACIONAL EURO- DOLAR DE LA REP ARG USD 5 5/8 VTO 26/01/2022	11.43%	4.51%	0.0
DICY - TÍTULOS DISCOUNT EN USD LEY DE NY VENC 31/12/2033	4.16%	6.19%	0.1
BONOS DE LA NACION ARG EN DOLARES 7.625% VTO22/04/2046	4.56%	6.82%	0.1
BONO DE LA NACION ARG INT DOLARES 7,5% VENC 22/04/2026	3.77%	5.49%	0.1
Fondos Comunes de Inversion	0.25%	-4.07%	0.0
LEBAC	11.03%	0.00%	0.0
Letras Provinciales - Dolar Linked	9.77%	4.31%	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	4.12%	5.27%	0.1
ON Corporativas - USD	1.04%	6.01%	4.5
BRAZIL - Corporate USD	16.94%	5.10%	4.0
BANBRA 5 7/8 VENC 01/19/2023	5.27%	4.79%	0.0
CAIXBR 3 1/2 VENC 11/07/2022	4.82%	4.50%	0.0
CAIXBR 7 1/4 VENC 07/23/2024	3.45%	7.03%	0.1
ITAU 5 1/8 VTO 13/05/2023 CORP	3.40%	4.45%	0.0
URUGUAY - Sovereign USD	7.91%	3.22%	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%	3.45%	0.0
Otros	0.33%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	5.09%	3.7

Security	Weight	Yield	Duration
Bonos Soberanos - BCS	97.98%	2.41%	0.4
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17	2.69%	2.25%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18	3.45%	2.50%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-01-18	5.70%	2.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 27-04-18	2.08%	3.35%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOALRES 27/04/18	0.98%	2.55%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-11-17	2.18%	2.55%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 24-05-18	8.29%	2.25%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-01-18	5.03%	2.45%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-06-18	4.12%	2.60%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 29-06-18	0.65%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-04-18 A 273 DIAS	5.31%	2.70%	0.0
LETE DEL TESORO A 196 DIAS VTO 09/02/2018 / LTDF8D	6.67%	2.30%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 23-02-18 A 196 DIAS	7.51%	2.35%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES A 455 DIAS VENC 10/08/2018	4.95%	2.50%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-03-18 A 182 DIAS	11.45%	1.73%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 28-09-18 A 378 DIAS	8.65%	2.80%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 11-05-18 A 224 DIAS	9.17%	2.40%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 15-12-17 - L2DD7D	1.32%	2.25%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 12-10-18 A 364 DIAS	3.03%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 26-10-18	0.78%	3.10%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 16-11-18	0.43%	3.11%	0.0
LETRAS DEL TESORO EN DOLARES VTO 13-07-18	3.54%	2.60%	0.0
Otros	2.02%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	2.41%	160.0

Security	Weight	Yield	Duration
Cheque de Pago Diferido	74.12%	25.66%	253.6
Fideicomisos Financieros ARS	0.70%	25.71%	0.7
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.25%	0.0
LEBAC	20.25%	28.40%	0.1
ON Corporativas - BADLAR Linked	4.83%	25.80%	0.7
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 1 VTO 27/8/2018	0.00%	28.53%	0.5
ON ALGABO SA SERIE 1 CLASE 2 VTO 27/8/2018	0.00%	28.93%	0.5
ON BICE CLASE 3 VTO 19/06/2018	1.63%	25.76%	0.5
ON IMPSA Clase 10 18/06/15	0.00%	0.00%	0.0
ON INVAP CLASE 3 VTO 21/10/2020	0.18%	28.53%	1.4
ON PYME EMP. INDUSTRIAL MEDITERRANEO SERIE I VTO 26/2/2018	0.00%	32.34%	0.1
ON PYME MONTEVER SA SERIE 1 VTO 14/05/2018	0.00%	29.53%	0.5
ON PYME PLASTICOS DISE CLASE 3 VTO 18/12/2018	0.01%	29.51%	0.8
ON PYME PLURAL COOP CLASE 2 VTO 10/09/2019	0.03%	29.56%	0.8
ON PYME SOUTH MANAGEMENT 10/12/2018	0.00%	28.53%	0.5
ON PYMES ACTUAL SERIE 4 VTO 26/11/2018	0.00%	30.25%	0.5
ON PYMES MERANOL EN PESOS CLASE 2 VENC 30/06/2019	0.03%	22.53%	1.2
ON PYMES VARCAM CLASE 1 VENC 11/11/2018	0.00%	28.53%	0.6
ON ROGIRO ACEROS CLASE 9 VTO 31/10/2018	0.03%	28.53%	0.7
ON ROGIRO CLASE 11 VTO 30/09/2019	0.14%	28.50%	0.9
ON SAVANT PHARM SERIE 3 CLASE G VTO 30/9/2018	0.00%	28.53%	0.6
ON BICE CLASE 1 VTO 16/02/2018	0.36%	21.51%	0.5
ON PYMES DEL FABRO HERMANOS Y CIA SA SERIE I VENC 02/05/2019	0.02%	28.50%	0.9
ON ANGEL ESTRADA CLASE 5 VTO 01/06/2018	0.60%	26.76%	0.4
ON ROGIRO CLASE 12 VTO 31/05/2019	0.25%	26.07%	0.7
ON BICE CLASE 5 VTO 27/12/2018	1.36%	25.27%	1.0
ON PYME CNV RED SURCOS SERIE I \$ VTO 27/06/2019	0.03%	26.72%	0.7
ON SICOM SERIE IV VTO 12-09-2020	0.04%	29.01%	1.4
ON INTEGRACION ELECTRICA SUR ARG SA VCP CL 5 VTO 25/09/2018	0.11%	30.29%	0.7
ON Corporativas - USD	0.19%	29.26%	1.5
Otros	-0.09%	0.00%	0.0
Grand Total	100.00%	25.94%	217.0

Security	Weight	MAR	Over / Under
CRESUD S.A.C.I.F.Y A.	1.39%	4.50%	-3.11%
OVOPROT INTERNATIONAL SA	0.04%		0.04%
YPF S.A.-SPONSORED ADR	1.57%		1.58%
YPF S.A.-D	11.09%	7.98%	3.12%
IRSA SA	0.59%		0.59%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	1.69%	1.27%	0.42%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.84%	4.94%	0.91%
BBVA BANCO FRANCES SA	5.84%	4.94%	0.91%
BANCO MACRO SA-B	6.53%	3.65%	2.88%
BANCO HIPOTECARIO SA-D SHS	0.00%		0.00%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	13.01%	9.08%	3.94%
SIDERAR-A	5.72%	5.14%	0.58%
ALUAR ALUMINIO	1.89%	3.39%	-1.49%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	3.03%	3.25%	-0.22%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	2.34%		2.35%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	6.39%	3.29%	3.11%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	6.39%	3.29%	3.11%
PAMPA ENERGIA SA	18.60%	10.70%	7.92%
PAMPA ENERGIA SA	18.60%	10.70%	7.92%
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	0.61%	3.43%	-2.82%
TRANSENER S.A.-B	6.59%	4.75%	1.84%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.39%	4.59%	-0.20%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	4.39%	4.59%	-0.20%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	0.35%	4.43%	-4.07%
Total Cartera Renta Variable	92.536%	0.9798	-5.353%
Total Cartera Renta Fija	7.464%		
Total Cartera de Inversiones	100.000%		

Security	ARS	Weight C	Dilution W
DISTRIBUIDORA DE GAS CUYANA SA	165,000	1.00%	1.49%
YPF S.A.-D	58,035,093	13.25%	13.24%
GRUPO SUPERVIELLE SA CL-B	6,936,426	1.58%	1.58%
BBVA BANCO FRANCES SA	19,755,460	4.51%	4.51%
BANCO MACRO SA-B	36,637,157	8.37%	8.36%
GRUPO FINANCIERO GALICIA-B	65,821,732	15.03%	15.02%
NORTEL INVERSORA-ADR PFD B	3,345,574	0.76%	0.76%
CRESUD S.A.C.I.F.Y.A.	412,636	0.09%	0.09%
ADECOAGRO SA	9,018,011	2.06%	2.06%
TRANSPORTADORA GAS NORTE-C	3,062,500	0.70%	0.70%
TELECOM ARGENTINA S.A.-B	16,989,138	3.88%	3.88%
PAMPA ENERGIA SA	80,785,557	18.45%	18.43%
PAMPA ENERGIA SA	80,785,557	18.45%	18.43%
EMP DISTRIB Y COMERC NORTE	45,670,122	10.43%	10.42%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17,402,942	3.97%	3.97%
TRANSPORTADORA DE GAS SUR-B	17,402,942	3.97%	3.97%
TRANSENER S.A.-B	35,330,895	8.07%	8.06%
Equities	410,676,469	93.79%	93.71%
Fixed Income	27,169,235	6.21%	6.20%
Total Cartera de Inversiones	437,845,703	100.00%	99.91%

Security	Weight	Yield	Duration
Fideicomisos Financieros ARS	0.18%	28.38%	0.28
Fondos Comunes de Inversion	0.00%	16.22%	0.00
LEBAC	10.36%	28.40%	0.09
ON Corporativas - BADLAR Linked	89.56%	26.48%	1.62
ON ALBANESI CALASE II \$ VTO 25/10/2018	0.19%	27.35%	0.27
ON AXION ENERGY CLASE 6 VTO 03/11/2020	10.11%	26.25%	0.26
ON BCO SUPERVIELLE CL 6, VTO 12/10/2018	2.59%	26.28%	0.26
ON CENTRAL TERMICA LOMA DE LA LATA CLASE A VTO 05/10/2018	4.45%	27.01%	0.27
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 7 VENC 20/11/2020	4.89%	26.26%	0.26
ON PAN AMERICAN ENERGY CLASE 8 VTO 10/12/2020	9.80%	26.00%	0.26
ON PANAMERICAN ENERGIA LLC ARG VENC 18/03/2018	5.86%	26.50%	0.26
ON YPF CLASE 44 VENC 10/12/2018	0.38%	26.20%	0.26
ON TELECOM PERSONAL SERIE 3 VENC 16/05/2018	14.37%	25.97%	0.26
ON SANTANDER RIO CLASE 19 VENC 30/03/2020	0.37%	26.03%	0.26
ON BANCO GALICIA CLASE 4 VENC 18/05/2020	0.38%	26.22%	0.26
ON ARCOR CLASE 11 VENC 03/05/2021	4.15%	26.01%	0.26
ON CENTRAL TERMICA ROCA 4 VTO 24-07-2021	1.10%	27.53%	0.28
ON YPF CLASE 46 VENC 04/03/20121	4.90%	27.03%	0.27
ON YPF SERIE 34 VENC 24/09/2024	5.50%	27.82%	0.28
ON YPF CLASE 17 SIMPLES \$ VTO 30/04/2020	1.33%	26.73%	0.27
ON YPF CLASE 49 VENC 18/04/2020	7.98%	26.23%	0.26
ON YPF CLASE 43 VTO 21/10/2023	0.19%	27.30%	0.27
ON YPF CLASE 29 VENC 07/03/2020	2.72%	26.26%	0.26
ON YPF CLASE 36 VENC 10/02/2020	4.40%	26.78%	0.27
ON AXION ENERGY CLASE 3 VENC 12/03/2020	0.38%	26.02%	0.26
ON YPF CLASE 41 VENC 24/09/2020	3.53%	27.91%	0.28
Otros	-0.10%	0.00%	0.00
Grand Total	100.00%	26.68%	532