

Tel. (54 11) 4317-1312
Fax (54 11) 4317-1303
www.schroder-soc-ger.com.ar

Ciudad Autónoma de Buenos Aires, 5 de febrero de 2016

Señores

COMISION NACIONAL DE VALORES
Subgerencia de Fondos Comunes de Inversión
Presente

Ref.: Instrumentos Financieros Derivados

De nuestra consideración:

A continuación detallamos los instrumentos financieros derivados utilizados según lo establecido en el capítulo II, Sección IV, Art. 16, inciso b.1), de las Normas de la Comisión Nacional de Valores (N.T. 2013).

Posición al **31.01.16**:

FONDO	Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Abril 2016 (DLR042016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	5.000.000
Fecha de vencimiento	30/04/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Enero 2016 (DLR012016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	2.000.000	
Fecha de vencimiento	31/01/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Febrero 2016 (DLR022016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	4.000.000	
Fecha de vencimiento	29/02/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Julio 2016 (DLR072016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	1.000.000	
Fecha de vencimiento	31/07/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Marzo 2016 (DLR032016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	10.500.000	
Fecha de vencimiento	31/03/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312
 Fax (54 11) 4317-1303
 www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Mayo 2016 (DLR052016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	2.000.000	
Fecha de vencimiento	31/05/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Corto Plazo
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Venta	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Agosto 2016 (DLR082016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	1.000.000	
Fecha de vencimiento	31/08/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO	Schroder Renta Fija
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Enero 2016 (DLR012016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	1.800.000
Fecha de vencimiento	31/01/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

FONDO	Schroder Renta Fija
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Marzo 2016 (DLR032016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	6.300.000
Fecha de vencimiento	31/03/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Mayo 2016 (DLR052016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	2.500.000	
Fecha de vencimiento	31/05/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Venta	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Octubre 2016 (DLR102016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	1.500.000	
Fecha de vencimiento	31/10/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312
 Fax (54 11) 4317-1303
 www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Abril 2016 (DLR042016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	4.200.000	
Fecha de vencimiento	30/04/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Enero 2016 (DLR012016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	2.000.000	
Fecha de vencimiento	31/01/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Febrero 2016 (DLR022016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	1.000.000	
Fecha de vencimiento	29/02/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

FONDO		Schroder Argentina
Tipo de contrato	Futuro	
Tipo de Operación	Compra	
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Marzo 2016 (DLR032016)	
Activo subyacente	Dólar estadounidense	
Activo subyacente por lote	DÓLAR	
Cantidad de lotes operados	2.000.000	
Fecha de vencimiento	31/03/2016	
Moneda	Pesos	
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.	
Valuación	Cotización ROFEX	

Tel. (54 11) 4317-1312

Fax (54 11) 4317-1303

www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO	Schroder Renta Global
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Marzo 2016 (DLR032016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	1.000.000
Fecha de vencimiento	31/03/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

FONDO	Schroder Renta Global
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Abril 2016 (DLR042016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	1.000.000
Fecha de vencimiento	30/04/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

Schroder S.A. Sociedad Gerente de F.C.I.
Ing. Enrique Butty 220, Piso 12
C1001AFB Buenos Aires, Argentina



Tel. (54 11) 4317-1312
Fax (54 11) 4317-1303
www.schroder-soc-ger.com.ar

FONDO	Schroder Renta Global
Tipo de contrato	Futuro
Tipo de Operación	Compra
Denominación	ROFEX Dólar Futuro Mayo 2016 (DLR052016)
Activo subyacente	Dólar estadounidense
Activo subyacente por lote	DÓLAR
Cantidad de lotes operados	1.000.000
Fecha de vencimiento	31/05/2016
Moneda	Pesos
Objetivo	Cobertura para acotar el riesgo de depreciación cambiaria sobre la tenencia de valores representativos de deuda denominados en pesos.
Valuación	Cotización ROFEX

Sin otro particular, saludamos a Uds. muy atentamente.

Schroder S.A. S.G.F.C.I.

Noemí S. Garcia
Directora