

Estados Financieros

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.
(Puesto de Bolsa)

31 de diciembre de 2018
(Conjuntamente con el Informe de los Auditores Independientes)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

CONTENIDO

	Página (s)
Informe de los Auditores Independientes.....	1-4
Estados de Situación Financiera.....	5
Estados de Resultados Integrales.....	6
Estados de Cambios en el Patrimonio.....	7
Estados de Flujos de Efectivo.....	8
Notas a los Estados Financieros.....	9-59
Información Suplementaria:	
Estados de Cartera de Inversión.....	Anexo I
Estados de Cartera en Custodia.....	Anexo II
Estados de Otros Resultados Integrales.....	Anexo III
Tablas de Riesgo de Liquidez.....	Anexo IV
Otras Notas Informativas.....	Anexo V

Informe de los Auditores Independientes

A la Junta de Directores y a los Accionistas de
ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Opinión

Hemos auditado los estados financieros adjuntos de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. (en lo adelante "la Compañía"), los cuales comprenden el estado de situación financiera al 31 de diciembre de 2018, y los estados de resultados integrales, de cambios en el patrimonio y de flujos de efectivo por el año terminado en esa fecha, así como las notas a los estados financieros, incluyendo un resumen de las principales políticas contables.

En nuestra opinión, los estados financieros adjuntos presentan razonablemente, en todos sus aspectos significativos, la situación financiera de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2018, su desempeño financiero y sus flujos de efectivo por el año terminado en esa fecha, de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera ("NIIFs").

Base para la opinión

Efectuamos nuestra auditoría de conformidad con las Normas Internacionales de Auditoría ("NIAs"). Nuestras responsabilidades bajo dichas normas se encuentran descritas en la sección de *Responsabilidades del auditor con relación a la auditoría de los estados financieros de nuestro informe*. Somos independientes de la Compañía, de conformidad con el Código de Ética de Contadores Profesionales del Consejo Internacional de Normas de Ética para Contadores ("IESBA", por sus siglas en inglés), el Código de Ética Profesional del Instituto de Contadores Públicos Autorizados de la República Dominicana (ICPARD), junto con los requerimientos de ética que son relevantes para nuestra auditoría de los estados financieros y hemos cumplido con nuestras otras responsabilidades éticas de acuerdo con esos requerimientos y con el Código de Ética del IESBA y el ICPARD. Consideramos que la evidencia de auditoría que hemos obtenido es suficiente y apropiada para proporcionar una base para nuestra opinión de auditoría.

Asunto clave de auditoría

El asunto clave de auditoría es aquel que, basado en nuestro juicio profesional, ha sido de la mayor significatividad en nuestra auditoría de los estados financieros del año terminado el 31 de diciembre de 2018. Este asunto fue considerado en el contexto de nuestra auditoría de los estados financieros en su conjunto y en la formación de nuestra opinión de auditoría sobre este, y no expresamos una opinión separada sobre ese asunto. Hemos determinado que el asunto que se describe a continuación es el asunto clave de la auditoría que se debe comunicar en nuestro informe.

Hemos cumplido con las responsabilidades descritas en la sección "Responsabilidades del auditor con relación a la auditoría de los estados financieros" respecto al asunto clave de auditoría. Consecuentemente, nuestra auditoría incluyó la ejecución de procedimientos diseñados para responder a nuestra evaluación de los riesgos de error material en los estados financieros. Los resultados de nuestros procedimientos de auditoría, incluyendo los procedimientos ejecutados para soportar el asunto clave detallado a continuación, proporcionan una base para nuestra opinión de auditoría.

Inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados

La Compañía mantiene inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados, las cuales se valúan por los precios cotizados en el mercado de valores y para aquellos instrumentos financieros que no existe un mercado de valores activo, se determinan utilizando técnicas de valoración observables y no observables en el mercado aprobadas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana y de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera. El importe en libros de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados al 31 de diciembre de 2018, se incluye en la nota 10 de los estados financieros adjuntos. Hemos enfocado nuestra atención en la valoración de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados en los que se utilizan técnicas de valoración con datos observables en el mercado clasificados como nivel 2, con la finalidad de identificar si existen hechos o circunstancias que indiquen que los precios y técnicas de valoración utilizadas son razonables al 31 de diciembre de 2018, de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera.

Para soportar este asunto, efectuamos, entre otros, los siguientes procedimientos:

- Evaluamos y probamos los controles internos de los procesos de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados de la Compañía, al 31 de diciembre de 2018.
- Realizamos la conciliación de los auxiliares de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados con el saldo según auxiliar de las mismas al 31 de diciembre de 2018.
- Enviamos a confirmar cada una de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados existentes según auxiliar de los mismos al 31 de diciembre de 2018.
- Revisamos las políticas y técnicas de valuación para las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados según la jerarquía del valor razonable que se indica en las Normas Internacionales de Información Financiera.
- Realizamos el recálculo de valuación de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados al 31 de diciembre de 2018, considerando los precios transados en el mercado de estos instrumentos financieros al 31 de diciembre de 2018.

Otra información incluida en la memoria anual de la Compañía e información suplementaria

La otra información consiste en la información incluida en la memoria anual de la Administración y la información suplementaria incluida en los anexos I hasta el V, esta información es de naturaleza distinta de los estados financieros y de nuestro informe de auditoría sobre ellos.

Hemos obtenido la información suplementaria incluida en los anexos I hasta el V antes de la fecha de nuestro informe y esperamos que la memoria anual de la Compañía esté disponible para nosotros después de la fecha de este informe de auditoría. La Administración es responsable por la otra información.

Nuestra opinión sobre los estados financieros no cubre la otra información y por ende no expresaremos una opinión o ninguna otra forma de conclusión de aseguramiento sobre esta.

En relación con nuestra auditoría de los estados financieros, nuestra responsabilidad es leer la otra información que identificamos más arriba y al hacerlo, considerar si hay una desviación material entre esa otra información y los estados financieros, o el conocimiento obtenido por nosotros durante el curso de la auditoría.

Basándonos en el trabajo que hemos realizado sobre la otra información que obtuvimos antes de la fecha de este informe de auditoría, concluimos que no existe una desviación material en esa otra información y no tenemos nada que informar al respecto.

Responsabilidades de la Administración y de aquellos encargados del Gobierno Corporativo sobre los estados financieros

La Administración es responsable por la preparación y presentación razonable de estos estados financieros de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera, así como por el control interno que la Administración determine que es necesario para permitir la preparación de estados financieros que estén libres de errores significativos, ya sea debido a fraude o error.

En la preparación de los estados financieros, la Administración también es responsable de la evaluación de la capacidad de la Compañía para continuar como empresa en marcha, revelando, según corresponda, los asuntos relacionados con la empresa en marcha, excepto si la Administración tiene la intención de liquidar la Compañía o de terminar sus operaciones, o bien no exista otra alternativa realista sino hacerlo. Los responsables del Gobierno Corporativo de la Compañía son responsables de la supervisión del proceso de información financiera de la Compañía.

Responsabilidades del auditor con relación a la auditoría de los estados financieros

Nuestros objetivos son obtener una seguridad razonable acerca de si los estados financieros considerados en su conjunto están libres de representaciones erróneas significativas, debido a fraude o error, y emitir un informe de auditoría que incluye nuestra opinión. La seguridad razonable es un nivel alto de seguridad, pero no es una garantía de que una auditoría efectuada de acuerdo con las Normas Internacionales de Auditoría siempre detectará un error significativo cuando exista. Los errores pueden deberse a fraude o error y son considerados significativos cuando, individualmente o en su conjunto, pudiera esperarse razonablemente que influyan en las decisiones económicas que tomen los usuarios basándose en estos estados financieros. Como parte de una auditoría de conformidad con las NIAs, nosotros ejercemos el juicio profesional y mantenemos escepticismo profesional durante la auditoría. Asimismo, nosotros como auditores, también:

- Identificamos y evaluamos los riesgos de error material en los estados financieros, ya sea debido a fraude o error, diseñamos y aplicamos procedimientos de auditoría para responder a dichos riesgos, y obtenemos evidencia de auditoría suficiente y adecuada para proporcionar una base para nuestra opinión. El riesgo de no detectar un error material debido a fraude es más alto que en el caso de un error material debido a error, ya que el fraude puede implicar colusión, falsificación, omisiones intencionales, manifestaciones intencionalmente erróneas, o la elusión del control interno.
- Obtenemos un entendimiento del control interno relevante para la auditoría con el propósito de diseñar procedimientos de auditoría que sean adecuados en función de las circunstancias, pero no con el propósito de expresar una opinión sobre la efectividad del control interno de la Compañía.
- Evaluamos que las políticas contables utilizadas sean adecuadas, así como la razonabilidad de las estimaciones contables y las revelaciones efectuadas por la Administración.
- Concluimos sobre el uso adecuado por parte de la Administración del principio contable de empresa en marcha y, basándonos en la evidencia de auditoría obtenida, concluimos sobre si existe una incertidumbre material relacionada con hechos o condiciones que pueden generar dudas significativas sobre la capacidad de la Compañía para continuar como empresa en marcha. Si concluimos que existe una incertidumbre material, se requiere que llamemos la atención en nuestro informe de auditoría sobre las revelaciones correspondientes en los estados financieros o, si dichas revelaciones no son adecuadas, que expresemos una opinión modificada. Nuestras conclusiones están basadas en la evidencia de auditoría obtenida hasta la fecha de nuestro informe de auditoría. No obstante, hechos o condiciones futuros pueden causar que la Compañía no continúe como una empresa en marcha.

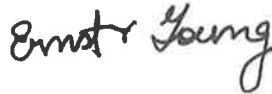
- Evaluamos la presentación global, estructura y contenido de los estados financieros, incluyendo las revelaciones, y si dichos estados financieros representan las transacciones subyacentes y eventos de manera que logren la presentación razonable.

Nos comunicamos con los encargados de la Administración de la Compañía con relación, entre otros asuntos, al alcance y oportunidad de nuestra auditoría y los hallazgos significativos incluyendo cualquier deficiencia significativa en el control interno que hayamos identificado durante nuestra auditoría.

También proporcionamos a los encargados de la Administración de la Compañía una declaración de que hemos cumplido con los requerimientos éticos aplicables con relación a la independencia y comunicado con ellos acerca de todas las relaciones y otras cuestiones de las que se puede esperar razonablemente que puedan afectar a nuestra independencia, y en su caso, las correspondientes salvaguardas.

Entre los asuntos comunicados a los encargados de la Administración de la Compañía, determinamos que ha sido de la mayor significatividad en la auditoría de los estados financieros al 31 de diciembre de 2018 y que por lo tanto es el asunto clave de auditoría. Hemos descrito dicho asunto clave de auditoría en nuestro informe de auditoría, a menos que una ley o regulación no permita la revelación pública del asunto o, en circunstancias extremadamente raras, determinemos que el asunto no debe ser comunicado en nuestro informe debido a que sería razonable esperar que las consecuencias adversas de hacerlo superarían los beneficios de interés público de su comunicación.

La socia encargada de la auditoría de la que ha resultado este informe de los auditores independientes es Maylen A. Guerrero P. (CPA No. 5296).

The logo for Ernst & Young, featuring the company name in a stylized, handwritten-style script.

30 de abril de 2019
Torre Empresarial Reyna II,
Suite 900, Piso 9,
Pedro Henríquez Ureña No. 138.
Santo Domingo, República Dominicana

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE SITUACIÓN FINANCIERA

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		2018	2017
	Notas		
Activos			
Efectivo y equivalentes de efectivo	6 y 7	2,350,058,741	3,141,530,760
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	6 y 8	3,671,151,309	5,366,584,733
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	6 y 9	60,219,789	60,106,379
A costo amortizado corto plazo	6 y 10	1,237,148,708	401,066,667
Otras cuentas por cobrar	6 y 11	30,962,364	144,577,112
Anticipos de impuesto sobre la renta	20	65,692,596	63,921,030
Impuesto sobre la renta diferido	20	35,988,543	25,608,873
Total activos Corrientes		7,451,222,050	9,203,395,554
Inversiones en acciones	12	118,279,510	28,385,553
Mobiliario y equipos	13	5,006,304	6,613,855
Cargos diferidos	14	5,483,334	7,878,342
Otros activos		1,093,412	1,263,603
Total de activos		7,581,084,610	9,247,536,907
Pasivos y Patrimonio			
Pasivos financieros:			
A valor razonable	6 y 15	4,143,275,233	3,624,844,611
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados	6 y 9	141,111,748	823,544,771
A costo amortizado:			
Obligaciones con bancos	6 y 16	-	1,865,120,141
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo	17	688,420,342	12,782,740
Otras cuentas por pagar		31,572,619	7,366,036
Cuentas por pagar a relacionadas	18	1,615,094	2,224,156
Acumulaciones y otras obligaciones por pagar	19	73,073,394	50,612,888
Total pasivos Corrientes		5,079,068,430	6,386,495,343
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo	17	600,000,000	875,000,000
Total Pasivos		5,679,068,430	7,261,495,343
Compromisos y contingencias	24		
Patrimonio			
Capital	21	900,000,000	900,000,000
Aportes para futura capitalización		138	138
Reserva de capital		180,000,000	180,000,000
Resultados acumulados		822,016,042	906,041,426
Total de patrimonio		1,902,016,180	1,986,041,564
TOTAL DE PASIVOS Y PATRIMONIO		7,581,084,610	9,247,536,907

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas



Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRALES

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		<u>2018</u>	<u>2017</u>
	Notas		
Resultado por instrumentos financieros			
A valor razonable	8 y 15	2,645,009,048	2,196,249,262
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	9	(2,084,642,727)	(1,428,745,242)
A costo amortizado	10	86,394,548	137,973,388
Total resultados por instrumentos financieros		<u>646,760,869</u>	<u>(17,240,137)</u>
Resultado por intermediación			
Comisiones por operaciones bursátiles y extrabursátiles		2,071,498	2,445,188
Gastos por comisiones y servicios		(22,234,998)	(19,729,334)
Total Resultados por intermediación		<u>(20,163,500)</u>	<u>(17,284,146)</u>
Gastos por financiamiento	16 y 17	(124,449,629)	(134,696,258)
Gastos de administración y comercialización	23	(300,499,429)	(239,557,703)
Otros resultados			
Ganancia en cambio de moneda extranjera, neta	6	100,141,144	55,472,787
Resultado de inversiones en sociedades	12	7,794,184	561
Otros ingresos	7	96,061,370	41,781,559
Total otros resultados		<u>203,996,698</u>	<u>97,254,907</u>
Resultado antes del impuesto sobre la renta		405,645,009	611,194,208
Impuesto sobre la renta	20	10,329,607	(30,245,057)
Utilidad neta		<u>415,974,616</u>	<u>580,949,151</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas



Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>



Sociedad de Valores, S. A.

Financieros

DE CAMBIOS EN EL PATRIMONIO
los terminados el 31 de diciembre de 2018 y 2017
expresados en pesos dominicanos-DOP)

	Notas	Capital	Aportes para futura Capitalización	Reserva de Capital	Resultados Acumulados	Total de Patrimonio
iales al 1ro. de enero de 2017		650,000,000	138	130,000,000	875,092,275	1,655,092,413
cia y aumento de capital	21	250,000,000	-	50,000,000	(300,000,000)	-
del ejercicio		-	-	-	580,949,151	580,949,151
declarados		-	-	-	(250,000,000)	(250,000,000)
1 de diciembre de 2017		900,000,000	138	180,000,000	906,041,426	1,986,041,564
del ejercicio		-	-	-	415,974,616	415,974,616
declarados	21	-	-	-	(500,000,000)	(500,000,000)
1 de diciembre de 2018		900,000,000	138	180,000,000	822,016,042	1,902,016,180

adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE FLUJOS DE EFECTIVO

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Flujo neto originado por actividades de la operación:		
Comisiones pagadas	(20,203,000)	(111,670,476)
Ingreso neto por instrumentos financieros a valor razonable	4,890,419,948	2,957,899,495
Egreso neto por instrumentos financieros a derivados	(2,642,649,919)	(842,667,124)
Ingreso (Egreso) neto por instrumentos financieros a costo amortizado	(509,647,115)	36,345,218
Gastos de administración y comercialización pagados	(251,304,846)	(221,190,083)
Intereses pagados	(108,112,988)	(134,909,248)
Impuestos pagados	(12,329,860)	(1,463,938)
Otros ingresos netos por actividades de la operación	81,829,412	41,781,558
Flujo neto originado por las actividades de operación	<u>1,428,001,632</u>	<u>1,724,125,402</u>
Flujo neto originado por actividades de inversión:		
Dividendos y otros ingresos percibidos de inversiones en sociedades	7,794,184	561
Incorporación de propiedades, planta y equipo	779,520	(2,831,421)
Inversiones en sociedades	(89,893,958)	-
Flujo neto usado en las actividades de inversión	<u>(81,320,254)</u>	<u>(2,830,860)</u>
Flujo neto originado por actividades de financiamiento:		
Ingreso (Egreso) neto por pasivos financieros	(1,738,294,541)	333,397,940
Dividendos pagados	(500,000,000)	(250,000,000)
Flujo neto originado por (usado en) las actividades de financiamiento	<u>(2,238,294,541)</u>	<u>83,397,940</u>
Flujo neto total positivo (negativo) del período	(891,613,163)	1,804,692,482
Efecto de la variación por cambios en la tasa de cambio sobre el efectivo y equivalentes de efectivo	100,141,144	55,472,787
Aumento (disminución) neto en el efectivo	(791,472,019)	1,860,165,269
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	3,141,530,760	1,281,365,491
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	<u>2,350,058,741</u>	<u>3,141,530,760</u>
Transacciones no monetarias:		
Capital	-	250,000,000
Reserva legal	-	50,000,000
Resultados acumulados	-	(300,000,000)

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas



Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

1. Información corporativa

Naturaleza del negocio y datos generales

ALPHA Sociedad de Valores, S. A. - Puesto de Bolsa - procedió a modificar el Artículo 1ro. de los estatutos sociales, mediante Acta de Asamblea Extraordinaria de fecha 8 de julio de 2011, para que a partir de ese momento se denomine ALPHA Sociedad de Valores, S. A. La Compañía fue constituida bajo las leyes de la República Dominicana el 4 de noviembre de 2008 y tiene por objetivo principal dedicarse a la compra y venta de todo tipo de títulos y documentos financieros, a la intermediación de valores y operaciones del mercado de valores, así como cualesquiera otras operaciones y servicios que sean compatibles con la actividad de intermediación en el mercado de valores y que previamente y de manera general autorice la Superintendencia de Valores de la República Dominicana.

La Compañía está domiciliada en la calle Ángel Severo Cabral No. 7, Ensanche Julieta, en Santo Domingo D. N. y cuenta con 66 empleados al 31 de diciembre de 2018 (2017: 55 empleados).

Sus principales funcionarios son:

Nombre

Posición

Santiago Camarena
Juan Manuel Barranco

Vicepresidente Ejecutivo
Vicepresidente de Finanzas

Los estados financieros de la Compañía por el año terminado el 31 de diciembre de 2018, fueron autorizados para su emisión por la Administración en fecha 30 de abril de 2019.

2. Base para la preparación de los estados financieros

2.1 Base de preparación

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2018, fueron preparados de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF o IFRS, por sus siglas en inglés), emitidas por el Consejo de Normas Internacionales de Contabilidad (IASB, por sus siglas en inglés).

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2018, fueron preparados con base en costos históricos, excepto por ciertas partidas que han sido valuadas bajo los métodos que se detallan en la Nota 4. Los estados financieros están expresados en pesos dominicanos, la cual ha sido definida como la moneda funcional y de presentación.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Cambios en políticas contables

Las siguientes modificaciones a las Normas Internacionales de Información Financiera entraron en vigencia antes o a partir del 1ro. de enero de 2018. Esas modificaciones no han causado ningún efecto importante en los estados financieros de la Compañía.

La Compañía ha aplicado la NIIF 9 por primera vez. La naturaleza y el efecto de los cambios por la adopción de estas nuevas normas contables se describen a continuación. Otras modificaciones e interpretaciones se aplican por primera vez en 2018, pero no tienen ningún impacto en los estados financieros de la Compañía. La Compañía no ha aplicado anticipadamente ninguna norma, interpretación o modificación que haya sido emitida pero que no sea efectiva todavía.

NIIF 9 Instrumentos Financieros

La NIIF 9 Instrumentos financieros sustituye a la NIC 39 Instrumentos financieros: Reconocimiento y valoración para los ejercicios anuales que se inician el 1ro. de enero de 2018 o posteriormente, y recopila los tres aspectos relativos a la contabilidad de los instrumentos financieros: clasificación y valoración, deterioro y contabilidad de coberturas.

La Compañía adoptó la nueva norma en la fecha de aplicación requerida y no re-expresó la información comparativa. En general, la Compañía no tuvo grandes cambios en su estado de situación financiera, estados de resultados integrales, estados de cambios en el patrimonio y estados de flujos de efectivo.

A continuación, presentamos la evaluación de los tres (3) principales aspectos que consideramos:

(a) Clasificación y valoración

De acuerdo con la NIIF 9, los activos financieros se valoran posteriormente a valor razonable con cambios en resultados, a costo amortizado o a valor razonable con cambios en otro resultado integral. La clasificación se basa en dos criterios: el modelo de negocio de la Compañía para gestionar los activos; y si los flujos de efectivo contractuales de los instrumentos representan “únicamente pagos de principal e intereses” sobre la cantidad de principal pendiente.

La evaluación de si los flujos de efectivo contractuales de los instrumentos de deuda corresponden únicamente a principal e intereses se realizó en base a los hechos y circunstancias existentes en el momento del reconocimiento inicial de los activos.

Los requisitos de clasificación y valoración de la NIIF 9 no han tenido un impacto para la Compañía producto que se continuó valorando a su valor razonable todos los activos financieros que se registraban a valor razonable. Los instrumentos de deuda se continúan valorando a valor razonable reflejando las variaciones en el estado de resultados integrales de acuerdo con la NIIF 9, ya que la Compañía espera no solo mantener los activos para cobrar los flujos de efectivo contractuales, sino que también venderá los mismos según las condiciones y necesidades de la Compañía.

La Compañía aplicó la opción de presentar las variaciones del valor razonable en el estado de resultados integrales y, por tanto, la aplicación de la NIIF 9 no tubo un impacto significativo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Cambios en políticas contables (continuación)

Los deudores comerciales se mantienen para recibir los flujos de efectivo contractuales y se espera que supongan flujos de efectivo que representan únicamente pagos de principal e intereses. La Compañía analizó las características de los flujos de efectivo de estos instrumentos y concluyó que cumplen los criterios para ser valorados al costo amortizado de acuerdo con la NIIF 9. En consecuencia, no se requiere la reclasificación de estos instrumentos.

(b) Deterioro

La NIIF 9 requiere que la Compañía registre las pérdidas crediticias esperadas de todos sus títulos de deuda y deudores comerciales, ya sea sobre una base de 12 meses o de por vida. La Compañía aplicó el modelo simplificado. La Compañía determinó que, debido a la naturaleza de sus partidas a cobrar, no existen pérdidas importantes por deterioro a la fecha.

(c) Contabilidad de coberturas

La Compañía no tiene contabilidad de coberturas a la fecha, por lo cual no tuvo ningún impacto como resultado de la aplicación de esta norma.

NIIF 15 Ingresos Procedentes de Contratos con Clientes

La NIIF 15 reemplaza la NIC 11 Contratos de Construcción, la NIC 18 Ingresos e interpretaciones relacionadas y aplica, con limitadas excepciones, a todos los ingresos que surgen de contratos con sus clientes. La NIIF 15 establece un modelo de cinco (5) pasos para registrar los ingresos que surgen de contratos con sus clientes y requiere que se reconozca el ingreso por un monto que refleje el pago que una entidad tiene derecho a recibir a cambio de transferir los bienes a un cliente. La adopción de la NIIF 15 no tuvo impacto material en los estados financieros, producto que las operaciones contratadas con los clientes están en el alcance de los requerimientos establecidos en la NIIF 9 sobre Instrumentos Financieros, incluyendo las comisiones que se derivan de las operaciones con instrumentos financieros.

4. Resumen de las principales políticas contables

4.1 Saldos y transacciones en moneda extranjera

La Compañía registra sus transacciones en moneda extranjera al tipo de cambio vigente a la fecha de cada transacción. Al cierre del ejercicio, para determinar su situación financiera y resultados operacionales, la Compañía valúa y ajusta sus activos y pasivos denominados en moneda extranjera a la tasa de cierre del ejercicio. Las diferencias cambiarias resultantes de la aplicación de la política anterior se incluyen en los resultados del año en la cuenta de ganancia en cambio de moneda extranjera, neta.

Las tasas de cambio utilizadas por la Compañía al 31 de diciembre de 2018, para convertir los saldos en dólares estadounidenses (USD), Euros (EUR) y guaraníes paraguayos (PYG) a pesos dominicanos fueron las siguientes:

	31 de diciembre de	
Moneda:	2018	2017
USD	50.2762	48.2926
EUR	59.9275	59.1464
PYG	<u>0.000840</u>	<u>0.008620</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4.2 Clasificación corriente - no corriente (continuación)

4.2 Clasificación corriente - no corriente

La Compañía presenta los activos y pasivos en el estado de situación financiera en base a la clasificación de corrientes o no corrientes. Un activo se clasifica como corriente cuando:

Un activo es clasificado como corriente cuando la Compañía espera realizar el activo o tiene la intención de venderlo o consumirlo en su ciclo normal de operaciones; mantiene el activo principalmente con fines de negociación; espera realizarlo dentro de los doce meses siguientes después del período sobre el que se informa; y el activo es efectivo o equivalente al efectivo a menos que éste se encuentre restringido y no pueda ser intercambiado ni utilizado para cancelar un pasivo por un período mínimo de doce meses después del cierre del período sobre el que se informa.

La Compañía clasifica el resto de sus activos como activos no corrientes.

Un pasivo es clasificado como corriente cuando la Compañía espera liquidar el pasivo en su ciclo normal de operaciones; mantiene el pasivo principalmente con fines de negociación; el pasivo debe ser liquidado dentro de los doce meses siguientes a la fecha de cierre del período sobre el que se informa; o cuando la Compañía no tiene un derecho incondicional para aplazar la cancelación del pasivo durante, al menos, los doce meses siguientes a la fecha de cierre del período sobre el que se informa.

La Compañía clasifica el resto de sus pasivos como no corrientes.

Los activos y pasivos por impuesto sobre la renta diferido son clasificados por la Compañía como activos y pasivos no circulantes, en todos los casos.

4.3 Cálculo del valor razonable

La Compañía valora los instrumentos financieros a su valor razonable a la fecha de cierre de los estados financieros.

El valor razonable es el precio que se recibiría para vender un activo o se pagaría para transferir un pasivo en una transacción ordenada entre participantes en el mercado en la fecha de la transacción. El valor razonable está basado en la presunción de que la transacción para vender el activo o para transferir el pasivo tiene lugar;

- En el mercado principal del activo o del pasivo, o
- En ausencia de un mercado principal, en el mercado más ventajoso para la transacción de esos activos o pasivos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.3 Cálculo del valor razonable (continuación)

El mercado principal o el más ventajoso ha de ser un mercado accesible para la Compañía.

El valor razonable de un activo o un pasivo se calcula utilizando las hipótesis que los participantes del mercado utilizarían a la hora de realizar una oferta por ese activo o pasivo, asumiendo que esos participantes de mercado actúan en su propio interés económico.

El cálculo del valor razonable de un activo no financiero toma en consideración la capacidad de los participantes del mercado para generar beneficios económicos derivados del mejor y mayor uso de dicho activo o mediante su venta a otro participante del mercado que pudiera hacer el mejor y mayor uso de dicho activo.

La Compañía utiliza las técnicas de valoración apropiadas en las circunstancias y con la suficiente información disponible para el cálculo del valor razonable, maximizando el uso de variables observables relevantes y minimizando el uso de variables no observables.

Todos los activos y pasivos para los que se realizan cálculos o desgloses de su valor razonable en los estados financieros están categorizados dentro de la jerarquía de valor razonable que se describe a continuación, en base a la menor variable que sea significativa para el cálculo del valor razonable en su conjunto:

- Nivel 1- Valores de cotización (no ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos.
- Nivel 2- Técnicas de valoración para las que la variable de menor nivel utilizada, que sea significativa para el cálculo, es directa o indirectamente observable.
- Nivel 3- Técnicas de valoración para las que la variable de menor nivel utilizada, que sea significativa para el cálculo, no es observable.

Para activos y pasivos que son registrados por su valor razonable en los estados financieros de forma recurrente, la Compañía determina si han existido traspasos entre los distintos niveles de jerarquía mediante una revisión de su categorización (basada en la variable de menor nivel que es significativa para el cálculo del valor razonable en su conjunto) al final de cada período.

La Administración de la Compañía determina las políticas y procedimientos tanto para los instrumentos financieros cotizados y no recurrentes a valor razonable.

A los efectos de los desgloses necesarios sobre el valor razonable, la Compañía ha determinado las distintas clases de activos y pasivos en función de su naturaleza, características, riesgos y niveles de jerarquía de valor razonable, tal y como se ha explicado anteriormente.

Los desgloses relacionados con el valor razonable de los instrumentos financieros y de los activos no financieros que se valoran al valor razonable o para los que se desglosa el valor razonable se incluyen en las notas a los estados financieros.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.4 Reconocimiento de ingresos

Los ingresos provenientes de contratos con los clientes son reconocidos cuando el control los bienes y servicios ha sido transferido al cliente por un importe que refleje la contraprestación a la que la entidad espera tener derecho a cambio de tales bienes o servicios.

Ingresos por intereses

Los ingresos por rendimiento sobre instrumentos financieros valorados a su costo amortizado se reconocen en proporción del tiempo transcurrido, calculados sobre los saldos promedios mensuales del principal invertido aplicando el método del tipo de interés efectivo y para los intereses devengados de activos financieros clasificados a su valor razonable. El tipo de interés efectivo es la tasa que descuenta exactamente los cobros en efectivo estimados durante la vida esperada del instrumento financiero, o un período más corto, cuando corresponda, al valor neto en libros del activo financiero. Los ingresos por intereses se registran como ingresos financieros en el estado de resultados integrales.

Ingresos por comisión

Los ingresos por comisión de servicios prestados son reconocidos cuando el importe de los ingresos ordinarios pueda medirse con fiabilidad, es probable que la Compañía reciba los beneficios económicos derivados de la transacción, el grado de terminación del servicio prestado en la fecha del estado de situación financiera, pueda ser medido con fiabilidad y que los costos ya incurridos, así como los que quedan por incurrir hasta completar la prestación del servicio, puedan ser medidos con fiabilidad.

Dividendos

El ingreso se reconoce cuando se establece el derecho de la Compañía a recibir el pago correspondiente, lo cual generalmente ocurre cuando los accionistas aprueban el dividendo.

4.5 Impuestos

Impuesto sobre la renta corriente

El impuesto sobre la renta corriente es determinado tomando como base lo establecido en la Ley 11-92, Código Tributario, sus reglamentos y sus modificaciones. El impuesto corriente correspondiente al presente período y a los anteriores, es reconocido por la Compañía como un pasivo en la medida en que no haya sido liquidado o no haya podido ser compensado con los anticipos.

Si la cantidad ya pagada, que corresponda al período anterior, excede el importe a pagar por esos períodos, el exceso es reconocido como un activo. La tasa de impuesto utilizada para determinar el impuesto sobre la renta al 31 de diciembre de 2018 y 2017 es de 27% de la renta neta imponible a esa fecha.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.5 Impuestos (continuación)

Impuesto sobre los activos

El impuesto sobre los activos corresponde al 1% de los activos tributables. Los activos tributables corresponden al total de activos de la Compañía, considerados como bienes en uso y otros activos diferidos. La Compañía está sujeta a liquidar el impuesto sobre la renta del período en base al importe mayor entre el 1% de los activos gravables o el determinado según la renta neta imponible determinado sobre la tasa vigente a cada fecha de los estados financieros.

Impuesto sobre la renta diferido

El impuesto sobre la renta diferido es determinado utilizando el método pasivo aplicado sobre todas las diferencias temporarias que existan entre la base fiscal de los activos, pasivos y patrimonio neto y las cifras registradas para propósitos financieros a la fecha del estado de situación financiera. El impuesto sobre la renta diferido es calculado considerando la tasa de impuesto que se espera aplicar en el período en que se estima que el activo se realizará o que el pasivo se pagará. Los activos por impuestos diferidos se reconocen solo cuando existe una probabilidad razonable de su realización.

El importe en libros de un activo por impuestos diferidos es sometido a revisión en la fecha de cada estado de situación financiera. La Compañía reduce el importe del saldo del activo por impuestos diferidos, en la medida que estime probable que no dispondrá de suficiente ganancia fiscal, en el futuro, como para permitir cargar contra la misma la totalidad o una parte, de los beneficios que conforman el activo por impuestos diferidos. Asimismo, a la fecha de cierre de cada año, la Compañía reconsidera los activos por impuestos diferidos que no haya reconocido anteriormente.

La Compañía compensa sus activos por impuestos corrientes y diferidos con sus pasivos por impuestos corrientes y diferidos, respectivamente, cuando le asiste el derecho exigible legal de compensar los importes reconocidos ante la misma Autoridad Fiscal y cuando tenga la intención de liquidarlos por el importe neto o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

Impuesto sobre la Transferencia de Bienes Industrializados y Servicios (ITBIS)

El Impuesto sobre la Transferencia de Bienes Industrializados y Servicios (ITBIS) no es recuperable para la Compañía de conformidad con el Código Tributario, debido a que la Compañía es prestadora de servicios exentos, por lo cual el ITBIS adelantado en la adquisición de bienes y servicios se reconoce como parte del costo. La tasa del ITBIS al 31 de diciembre de 2018 y 2017 es de 18%.

4.6 Dividendos en efectivo

La Compañía reconoce un pasivo por el pago de dividendos a los accionistas de la Compañía cuando la distribución está autorizada y ya no depende de la voluntad de la Compañía. Las regulaciones legales de la República Dominicana especifican que una distribución está autorizada cuando ha sido aprobada por la Asamblea de Accionistas.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.7 Mobiliario y equipos

El mobiliario y equipos se miden al costo de adquisición menos su depreciación acumulada y pérdidas por deterioro, si las hubiese. Estos costos incluyen el precio de adquisición y todos los costos directamente atribuibles a la ubicación del activo en el lugar y condiciones necesarias para operar de la forma prevista.

La depreciación se calcula bajo el método de línea recta con base en la vida útil estimada para cada tipo de activo. Si existe algún indicio de que se ha producido un cambio significativo en el valor residual de los activos depreciables, la vida útil estimada y la tasa de depreciación, se revisa la depreciación de ese activo de forma prospectiva para reflejar las nuevas expectativas.

El resumen de las tasas de depreciación por tipo de activo se presenta a continuación:

	<u>Vida Útil</u>
Equipo de oficina y cómputo	3 años
Mobiliario y equipo	5 años
Equipo de transporte	<u>5 años</u>

Un elemento de mobiliario y equipos es dado de baja cuando es desapropiado o cuando la Compañía no espera beneficios económicos futuros de su uso o disposición. Cualquier pérdida o ganancia proveniente de la baja del activo, es determinada como la diferencia entre el producto neto de la disposición, si lo hubiere, y el importe en libros del elemento, la cual es reconocida en el estado de resultados integrales del período en que el elemento sea dado de baja en cuenta.

4.8 Cargos diferidos

Los cargos diferidos corresponden principalmente a los costos incurridos en la adquisición de licencias de programas informáticos y mejoras a propiedad arrendada. Estas licencias de programas informáticos y mejoras a propiedad arrendada se amortizan sobre la base de la vida útil estimada que va desde uno (1) a cinco (5) años. Los costos asociados son el mantenimiento de los programas informáticos y mejoras a propiedad arrendada, se reconocen como gastos cuando son incurridos.

4.9 Instrumentos financieros

La valuación de los instrumentos financieros de la Compañía se determina por medio del valor razonable o el costo amortizado, según se define a continuación:

Valor razonable - El valor razonable de un instrumento financiero que es negociado en un mercado financiero organizado es determinado por referencia a precios cotizados en ese mercado financiero para negociaciones realizadas a la fecha del estado de situación financiera. Para aquellos instrumentos financieros para los que no existe un mercado financiero activo, el valor razonable es determinado utilizando técnicas de valuación. Tales técnicas incluyen transacciones de mercado recientes entre partes interesadas y debidamente informadas que actúen en condiciones de independencia mutua; referencias al valor razonable de otro instrumento financiero sustancialmente semejante; y el descuento de flujos de efectivo u otros modelos de valuación.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.9 Instrumentos financieros (continuación)

Costo amortizado - El costo amortizado es calculado utilizando el método de la tasa de interés efectiva menos cualquier estimación por deterioro. El cálculo toma en consideración cualquier prima o descuento en la adquisición e incluye costos de la transacción, y honorarios que son parte integral de la tasa de interés efectiva.

4.10 Activos financieros

Reconocimiento inicial y valoración

Los activos financieros se clasifican, en su reconocimiento inicial, como valorados posteriormente al costo amortizado, al valor razonable con cambios en otro resultado integral y al valor razonable con cambios en resultados.

La clasificación de los activos financieros en el momento del reconocimiento inicial depende de las características de los activos financieros desde el punto de vista de los flujos de efectivo contractuales y del modelo de negocio de la Compañía para la gestión de los activos financieros. La Compañía valora inicialmente los activos financieros a su valor razonable más, en el caso de los activos financieros que no se valoran a su valor razonable con cambios en resultados, los costos de transacción.

El modelo de negocio de la Compañía para la gestión de los activos financieros se refiere a cómo administra sus activos financieros para generar flujos de efectivo. El modelo de negocio determina si los flujos de efectivo se obtendrán del cobro de los flujos de efectivo contractuales, de la venta de los activos financieros o de ambos.

Medición subsecuente

Los activos financieros de la Compañía incluyen efectivo y equivalentes de efectivo, certificados financieros, instrumentos financieros a valor razonable y derivados con cambios en resultados, instrumentos financieros a costo amortizado, cuentas por cobrar e inversiones en instrumentos patrimoniales.

La medición subsecuente de los activos financieros depende de su clasificación como se describe a continuación:

Activos financieros a valor razonable con cambios en resultados

Esta categoría incluye los activos financieros mantenidos para negociar y los activos financieros designados en su reconocimiento inicial a valor razonable con cambios en resultados. Los activos financieros se clasifican como mantenidos para negociar si se adquieren con el propósito de ser vendidos o recomprados en un futuro cercano.

Los derivados, incluidos los derivados implícitos que se han separado, también se clasifican como mantenidos para negociar. Los activos financieros a valor razonable con cambios en resultados se registran en el estado de situación financiera a su valor razonable y los cambios netos en el valor razonable se presentan como gastos (variaciones netas negativas en el valor razonable) o ingresos (variaciones netas positivas en el valor razonable) en el rubro de resultado por instrumentos financieros en el estado de resultados integrales.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

Los derivados implícitos se contabilizan como derivados separados y se registran al valor razonable si sus características y riesgos no están relacionados con los de los contratos principales y los contratos principales no se mantienen para negociar o están designados como activos financieros a valor razonable con cambios en resultados. Estos derivados implícitos se valoran a valor razonable y los cambios en el valor razonable se reconocen en el estado de resultados integrales. La revaluación solo se produce si hay un cambio en las condiciones del contrato que modifique significativamente los flujos de efectivo que, de lo contrario, se requerirían o si existe una reclasificación que implica una salida de la categoría de valor razonable con cambios en resultados.

Activos financieros a costo amortizado

La Compañía valora los activos financieros al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes:

- El activo financiero se mantiene en el marco de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los activos financieros para obtener flujos de efectivo contractuales, y
- Las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que son únicamente pagos de principal e intereses sobre el importe de principal pendiente.

Los activos financieros a costo amortizado se valoran posteriormente utilizando el método de interés efectivo y están sujetos a deterioro. Las ganancias y pérdidas se reconocen en resultados cuando el activo se da de baja, modifica o deteriora.

Partidas a cobrar

Las cuentas por cobrar son activos financieros no derivados con pagos de cuantía determinada o determinable que no se negocian en un mercado activo. Después de la valoración inicial, estos activos financieros se valoran al costo amortizado usando el método del tipo de interés efectivo, menos su deterioro. El costo amortizado se calcula teniendo en cuenta cualquier descuento o prima de adquisición y las cuotas o costos que son parte integral del interés efectivo. Los intereses devengados de acuerdo con dicho tipo de interés efectivo se incluyen como ingresos financieros en el estado de resultados integrales. Las pérdidas derivadas del deterioro se reconocen en los resultados del período.

Inversiones en instrumentos patrimoniales

Las inversiones en instrumentos de patrimonio, disponibles o no para la venta, que no tengan un precio de mercado cotizado de un mercado activo, cuyo valor razonable no pueda ser medido con fiabilidad y en las que la Compañía carece de influencia significativa, son medidas al costo después de su reconocimiento inicial.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

Deterioro de activos financieros

La Compañía reconoce una corrección de valor por pérdidas crediticias esperadas para todos los instrumentos de deuda que no se valoran a valor razonable con cambios en resultados. Las pérdidas crediticias esperadas se basan en la diferencia entre los flujos de efectivo contractuales a recibir de acuerdo con el contrato y todos los flujos de efectivo que la Compañía espera recibir, descontados a una tasa de interés efectiva aproximada a la original. Los flujos de efectivo esperados incluirán los procedentes de la venta de garantías reales recibidas u otras mejoras crediticias que formen parte de las condiciones contractuales.

Las pérdidas crediticias esperadas se reconocen en dos etapas. Para las exposiciones crediticias para las que no ha habido un aumento significativo en el riesgo crediticio desde el reconocimiento inicial, la corrección de valor se dota para las pérdidas crediticias esperadas en los siguientes doce meses. Para aquellas exposiciones crediticias para las cuales ha habido un aumento significativo en el riesgo crediticio desde el reconocimiento inicial, la corrección de valor se realiza para las pérdidas crediticias esperadas durante la vida restante del activo, independientemente del momento del incumplimiento.

Para las cuentas a cobrar, la Compañía aplica un enfoque simplificado en el cálculo de las pérdidas crediticias esperadas, por tanto, la Compañía no hace un seguimiento de los cambios en el riesgo de crédito, sino que reconoce en cada fecha de cierre una corrección de valor por las pérdidas crediticias esperadas durante toda la vida del activo. La Compañía ha establecido una matriz de estimaciones que se basa en su historial de pérdidas crediticias, ajustada por factores prospectivos específicos para los deudores y el entorno económico. La Compañía considera que un activo financiero está en situación de impago cuando los pagos contractuales están vencidos desde hace 90 días. Sin embargo, en ciertos casos, la Compañía también puede considerar que un activo financiero está en situación de impago cuando la información interna o externa indica que es poco probable que la Compañía reciba las cantidades contractuales pendientes en su totalidad antes de tener en cuenta cualquier mejora crediticia que tenga la Compañía. Un activo financiero se da de baja cuando no hay expectativa razonable de recuperar los flujos de efectivo contractuales.

4.11 Pasivos financieros

Reconocimiento inicial y valoración

La Compañía reconoce todos sus pasivos financieros inicialmente al valor razonable a la fecha de la aceptación o contratación del pasivo, más los costos directamente atribuibles a la transacción en el caso de obligaciones con bancos e instituciones financieras.

Los pasivos financieros de la Compañía incluyen instrumentos financieros a valor razonable, instrumentos derivados, obligaciones con bancos, otras cuentas por pagar, cuentas por pagar a relacionadas, acumulaciones y otras obligaciones por pagar y obligaciones por instrumentos emitidos a largo y corto plazo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.11 Pasivos financieros (continuación)

Reconocimiento inicial y valoración (continuación)

La medición subsecuente de los pasivos financieros depende de su clasificación como se describe a continuación:

Instrumentos financieros a valor razonable e instrumentos derivados

Los pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados incluyen los pasivos financieros mantenidos para negociar y los pasivos financieros designados en su reconocimiento inicial a valor razonable con cambios en resultados.

En esta categoría se incluyen los instrumentos financieros derivados contratados por la Compañía que no han sido designados como instrumentos de cobertura en las relaciones de cobertura. Las pérdidas o ganancias de los pasivos mantenidos para negociar se reconocen en el estado de resultados integrales.

Obligaciones con bancos, otras cuentas por pagar, cuentas por pagar a relacionadas, acumulaciones y otras obligaciones por pagar y obligaciones por instrumentos emitidos a largo plazo.

Después del reconocimiento inicial, estos pasivos financieros son medidos al costo amortizado utilizando el método de la tasa de interés efectiva. Las ganancias y pérdidas son reconocidas en el resultado del período cuando al pasivo financiero se da de baja, así como a través del proceso de amortización. El costo amortizado es calculado tomando en consideración cualquier prima o descuento en la adquisición, así como las comisiones o costos que son parte integral de la tasa de interés efectiva. La amortización a tasa de interés efectiva se incluye como parte del renglón de gastos por intereses en los estados de resultados.

Baja de pasivos financieros

Los pasivos financieros son dados de baja por la Compañía cuando la obligación ha sido pagada o cancelada o bien su exigencia haya expirado. Cuando un pasivo financiero es reemplazado por otro pasivo financiero, la Compañía cancela el original y reconoce un nuevo pasivo financiero. Las diferencias que se pudieran producir de tales reemplazos de pasivos financieros son reconocidas en los resultados del año en que ocurran.

4.12 Deterioro de activos no financieros

La Compañía efectúa una revisión al cierre de cada ejercicio contable sobre los valores en libros de sus activos no financieros, con el objeto de identificar disminuciones de valor cuando hechos o circunstancias indican que los valores registrados podrían no ser recuperables. Si dicha indicación existiese y el valor en libros excede el importe recuperable, la Compañía valúa los activos o las unidades generadoras de efectivo a su importe recuperable, definido este como la cifra mayor entre su valor razonable menos los costos de venta y su valor en uso. Los ajustes que se generen por este concepto se registran en los resultados del año en que se determinan, excepto cuando la pérdida por deterioro corresponde a un activo revaluado que se reconoce, entonces, en otro resultado integral.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.13 Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo y equivalentes de efectivo en el estado de situación financiera incluye el efectivo en bancos y las inversiones a corto plazo con un vencimiento de tres meses o menos desde su fecha de adquisición.

A efectos del estado de flujos de efectivo, el efectivo y equivalentes de efectivo incluyen las partidas descritas en el párrafo anterior, netas de los sobregiros bancarios, si los hubiese.

4.14 Inversiones en acciones

Las inversiones en acciones donde no se posee control ni influencia significativa y que están en entidades prestadoras de servicios al mercado de valores de la República Dominicana y que poseen restricciones sustanciales que limitan la determinación de su valor razonable.

4.15 Beneficios al personal

Prestaciones laborales

La Compañía paga preaviso y cesantía a los empleados que despide sin causa justificada. En caso de renuncia del trabajador, la Compañía no tiene el compromiso de otorgarle indemnización por despido, por lo que no existe un pasivo por dicho concepto.

Debido a que la Compañía carece de un plan o política de indemnización a empleados despedidos, cuando se paga indemnización por despido a algún empleado, los mismos son cargados al gasto del período en que ocurre.

Beneficios post-empleo

Según establece la Ley 87-01, la Compañía reconoce mensualmente los aportes efectuados al Sistema de Seguridad Social, al igual que los aportes de los empleados, como una acumulación, hasta el momento que son depositados en las entidades financieras autorizadas por la Superintendencia de Pensiones de la República Dominicana. Los aportes son efectuados por la Compañía y el empleado sobre los parámetros determinados en la referida Ley hasta que el empleado llegue a la edad de retiro.

Bonificación

La Compañía concede bonificaciones a sus funcionarios y empleados con base en acuerdos de trabajo y/o cumplimiento de metas y objetivos, contabilizándose el pasivo resultante con cargo a resultados del ejercicio en que se generan los mismos.

Otros beneficios laborales

La Compañía otorga otros beneficios a sus empleados, tales como vacaciones y regalía pascual de acuerdo a lo estipulado por las leyes laborales de la República Dominicana.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.16. Estimaciones e hipótesis contables significativas

La preparación de los estados financieros de la Compañía requiere que la Administración realice estimaciones e hipótesis contables significativas que afectan a los importes reconocidos de ingresos, gastos, activos y pasivos, a los desgloses correspondientes, y al desglose de los pasivos contingentes. Las incertidumbres sobre tales hipótesis y estimaciones pueden suponer que en ejercicios futuros se requiera algún ajuste significativo al valor en libros de los activos o pasivos afectados.

En el proceso de aplicación de las políticas contables de la Compañía, la Administración ha realizado los siguientes juicios, que han tenido unos efectos más significativos sobre los importes reconocidos en los estados financieros:

Clasificación de arrendamientos de inmueble - la Compañía como arrendador

La Compañía ha contratado el arrendamiento de sus oficinas y ha determinado, en base a una evaluación de los términos y condiciones de los acuerdos, tales como que el período de contratación no supone la mayor parte de la vida útil y que el valor actual de los pagos mínimos del arrendamiento no es similar al valor razonable del activo, que no retiene todos los riesgos y rendimientos significativos inherentes a la propiedad de estos inmuebles, por lo que contabiliza estos contratos como arrendamientos operativos.

Estimaciones e hipótesis

A continuación, se describen las hipótesis clave respecto al futuro, así como otras fuentes clave de incertidumbre en las estimaciones a la fecha de cierre, las cuales tienen un riesgo significativo de suponer ajustes materiales al valor en libros de los activos y pasivos durante el siguiente ejercicio. La Compañía basó sus hipótesis y estimaciones en los parámetros disponibles cuando se formularon los estados financieros. Sin embargo, las circunstancias e hipótesis existentes sobre hechos futuros pueden sufrir alteraciones debido a cambios en el mercado o a circunstancias que escapan del control de la Compañía. Dichos cambios se reflejan en las hipótesis cuando se producen.

Valor razonable de los instrumentos financieros

Cuando el valor razonable de los activos financieros y de los pasivos financieros registrados en el estado de situación financiera no se obtiene mediante precios de cotización en mercados activos, se determina utilizando técnicas de valoración que incluyen el modelo de descuento de flujos de efectivo. Los datos que se utilizan en estos modelos se toman de mercados observables cuando sea posible, pero cuando no lo sea, es necesario realizar algunos juicios de valor para establecer los valores razonables. Los juicios se efectúan sobre datos tales como el riesgo de liquidez, el riesgo de crédito y la volatilidad. Los cambios en las hipótesis relacionados con estos factores podrían afectar al valor razonable reportado de los instrumentos financieros.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.16. Estimaciones e hipótesis contables significativas (continuación)

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La Compañía utiliza un modelo histórico para establecer la estimación para pérdidas crediticias esperadas para las Inversiones en instrumentos financieros a costo amortizado y otras cuentas por cobrar. Las tasas de provisión se basan en los días vencidos para agrupaciones de diversos segmentos de clientes que tienen patrones de pérdida similares (es decir, por geografía, tipo de producto, tipo y calificación del cliente, y cobertura por cartas de crédito y otras formas de seguro de crédito).

Deterioro de valor de activos no financieros

La Compañía estima que no existen indicadores de deterioro para ninguno de sus activos no financieros a la fecha de los estados financieros. Sobre una base anual, y cuando se detecta la existencia de algún indicio de deterioro. Otros activos no financieros también son evaluados por deterioro cuando existen indicios de que los valores registrados no serán recuperables.

Activos por impuesto sobre la renta diferido

Los activos por impuesto sobre la renta diferido han sido reconocidos considerando que existe una probabilidad razonable de su realización a través de su aplicación a ganancias fiscales futuras, conjuntamente con una planeación de estrategias fiscales diseñadas por la Administración de la Compañía.

5. Cambios futuros en normas contables

Las Normas Internacionales de Información Financiera o sus interpretaciones emitidas, pero que no han entrado en vigencia a la fecha de los estados financieros de la Compañía, se describen a continuación: Las normas o interpretaciones descritas son solo aquellas que, de acuerdo con el criterio de la Administración, pueden tener un efecto importante en las divulgaciones, posición o desempeño financiero de la Compañía cuando sean aplicadas en una fecha futura. La Compañía tiene la intención de adoptar estas normas o interpretaciones cuando entren en vigencia.

NIIF 16 Arrendamientos

La NIIF 16 se emitió en enero de 2016 y reemplaza la NIC 17 Arrendamientos, IFRIC 4 Determinación de si un Acuerdo Contiene un Arrendamiento, SIC-15 Arrendamientos Operativos - Incentivos y SIC-27 Evaluación de la Esencia de las Transacciones que Adoptan la Forma Legal de un Arrendamiento. La NIIF 16 establece los principios para el reconocimiento, medición, presentación y revelación de los arrendamientos y requiere que los arrendatarios contabilicen todos los arrendamientos bajo un único modelo en el estado de situación financiera, similar a la contabilización de arrendamientos financieros bajo la NIC 17.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Cambios futuros en normas contables (continuación)

NIIF 16 Arrendamientos (continuación)

La norma incluye dos exenciones de reconocimiento para arrendatarios - los arrendamientos de activos de "bajo valor" (por ej., computadoras personales) y los arrendamientos a corto plazo (es decir, arrendamientos con un plazo de 12 meses o menos). A la fecha de inicio de un arrendamiento, el arrendatario reconocerá un pasivo para hacer pagos de arrendamiento (es decir, el pasivo por el arrendamiento) y un activo representando el derecho de uso del activo subyacente durante el plazo del arrendamiento (es decir, el derecho de uso del activo). A los arrendatarios se les requerirá reconocer por separado los gastos de intereses del pasivo por el arrendamiento y el gasto de depreciación sobre el derecho de uso del activo.

También se les requerirá a los arrendatarios remedir el pasivo por arrendamiento cuando ocurran ciertos eventos (por ej., un cambio en el plazo de un arrendamiento, un cambio en pagos futuros de arrendamiento que resultan de un cambio en la tasa o índice utilizado para determinar esos pagos). Por lo general el arrendatario reconocerá el monto de la remediación del pasivo por arrendamiento como un ajuste al derecho de uso del activo.

La contabilidad de los arrendadores bajo la NIIF 16 permanece sustancialmente sin cambios sobre la contabilidad actual bajo la NIC 17. Los arrendadores continuarán clasificando todos los arrendamientos usando el mismo principio de clasificación según la NIC 17 y distinguirán entre dos tipos de arrendamientos: operativos y financieros.

La NIIF 16 también requiere que los arrendatarios y arrendadores realicen revelaciones más extensas que las indicadas bajo la NIC 17.

La NIIF 16 es efectiva para períodos anuales que empiezan el o después del 1ro. de enero de 2019. La Compañía está evaluando el impacto en los estados financieros.

Modificaciones a la NIIF 9: Características de cancelación anticipada con compensación negativa

De acuerdo con la NIIF 9, un instrumento de deuda puede valorarse a costo amortizado o a valor razonable con cambios en otro resultado integral, siempre que los flujos de efectivo contractuales sean "solo pagos de principal y de intereses sobre la cantidad pendiente de pago" (la prueba SPPI) y el instrumento se mantenga dentro del modelo de negocio apropiado para esa clasificación. Las modificaciones a la NIIF 9 aclaran que un activo financiero pasa la prueba SPPI independientemente del evento o circunstancia que cause la rescisión anticipada del contrato e independientemente de qué parte pague o reciba una compensación razonable por la rescisión anticipada del contrato.

Las enmiendas deben aplicarse de forma retrospectiva y son efectivas a partir del 1 de enero de 2019, permitiéndose la aplicación anticipada.

Modificaciones a la NIC 28 - Inversiones en entidades asociadas y en negocios conjuntos

Estas modificaciones aclaran que una entidad debe aplicar la NIIF 9 Instrumentos financieros a las inversiones a largo plazo en entidades asociadas o en negocios conjuntos a los que no se aplique el método de la participación, pero que en sustancia formen parte de la inversión neta en la entidad asociada o en el negocio conjunto. Esta aclaración es relevante, pues implica que hay que aplicar el modelo de la pérdida de crédito esperada de la NIIF 9 a dichas inversiones.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

Modificaciones a la NIC 28 - Inversiones en entidades asociadas y en negocios conjuntos (continuación)

También se aclara que, al aplicar la NIIF 9, la entidad no tendrá en cuenta cualquier pérdida de la entidad asociada o del negocio conjunto o cualquier pérdida por deterioro de la inversión neta que se haya registrado como ajuste a la inversión neta en la entidad asociada o en el negocio conjunto por aplicación de la NIC 28 Inversiones en entidades asociadas y negocios conjuntos.

Las modificaciones aclaran que las consecuencias fiscales de los dividendos dependen más de las transacciones o sucesos pasados que generaron ese beneficio distribuible que de la distribución a los propietarios. Por tanto, una entidad reconoce las consecuencias fiscales de un dividendo en resultados, en otro resultado integral o en patrimonio neto dependiendo de cómo registró la entidad esas transacciones o sucesos pasados.

Estas modificaciones se aplicarán a los ejercicios que comiencen el 1ro. de enero de 2019 o posteriormente, permitiéndose su aplicación anticipada. Cuando una entidad aplique por primera vez estas modificaciones, lo hará desde la fecha de inicio del ejercicio comparativo más antiguo, la Compañía se encuentra en el proceso de revisión y evaluación del posible impacto sobre los estados financieros.

Interpretación CINIIF 23 La Incertidumbre Frente a los Tratamientos del Impuesto a las Ganancias

La interpretación aborda la contabilidad del impuesto sobre la renta cuando los tratamientos tributarios implican una incertidumbre que afecta la aplicación de la NIC 12 y no se aplica a impuestos o gravámenes fuera del alcance de la NIC 12, ni incluye específicamente los requisitos relacionados con intereses y sanciones asociados con tratamientos fiscales inciertos.

La interpretación aborda específicamente lo siguiente:

- Si una entidad considera tratamientos fiscales inciertos por separado.
- Los supuestos que realiza una entidad sobre el análisis de los tratamientos impositivos por parte de las autoridades fiscales.
- Cómo una entidad determina la utilidad/pérdida fiscal, las bases impositivas, las pérdidas tributarias no utilizadas, los créditos fiscales no utilizados y las tasas impositivas.
- Cómo una entidad considera cambios en hechos y circunstancias.

Una entidad debe determinar si considera cada tratamiento fiscal incierto por separado o conjuntamente con uno o más tratamientos fiscales inciertos. Se debe seguir el enfoque que mejor prediga la resolución de la incertidumbre. La interpretación es efectiva para los períodos anuales que comienzan a partir del 1 de enero de 2019, pero existen ciertas facilidades de transición disponibles. La Compañía está evaluando el impacto en los estados financieros.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Saldos en moneda extranjera

A continuación, se presenta un resumen de los activos y pasivos financieros denominados en moneda extranjera expresados en dólares estadounidenses (USD) Euros (EUR) y guaraníes (PYG) incluidos a su equivalente en pesos dominicanos en los distintos rubros de los estados de situación financiera que se acompañan.

Activos:	31 de diciembre de	
	2018	2017
	USD	USD
Efectivo y equivalente de efectivo	21,105,217	36,735,702
Inversiones en instrumentos financieros:		
A valor razonable con cambios en resultados	30,228,497	27,783,291
A valor razonable instrumentos financieros derivados	239,625	107,225
A costo amortizado	24,607,045	-
Otras cuentas por cobrar	126,809	96,961
Otros activos	-	20,165
	<u>76,307,193</u>	<u>64,743,344</u>
Pasivos:		
Pasivos financieros a su valor razonable	(1,393,541)	(32,440)
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(1,198,964)	(509,375)
Otras cuentas por pagar	(556,003)	(78,887)
	<u>(3,148,508)</u>	<u>(620,702)</u>
Posición monetaria neta activa	<u>73,158,685</u>	<u>64,122,642</u>

Activos:	31 de diciembre de	
	2018	2017
	EUR	EUR
Efectivo y equivalente de efectivo	<u>122,895</u>	<u>1,198</u>
Posición monetaria neta activa	<u>122,895</u>	<u>1,198</u>

Activos:	31 de diciembre de	
	2018	2017
	PYG	PYG
Efectivo y equivalente de efectivo	<u>146,710</u>	<u>-</u>
Posición monetaria neta activa	<u>146,710</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Saldos en moneda extranjera (continuación)

El detalle de los ajustes en revaluación de moneda extranjera durante el 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2018</u> <u>PYG</u>	<u>CAD</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	44,395,149	101,231	8,694	-	44,505,074
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	76,122,897	600,557	-	-	76,723,454
A valor razonable instrumentos financieros derivados	(27,164,469)	-	-	-	(27,164,469)
A costo amortizado	27,950,159	-	-	-	27,950,159
Otros activos	(56,351)	-	-	-	(56,351)
Pasivos financieros:					
A costo amortizado	(6,727,228)	-	-	-	(6,727,228)
A valor razonable	(15,089,495)	-	-	-	(15,089,495)
	<u>99,430,662</u>	<u>701,788</u>	<u>8,694</u>	<u>-</u>	<u>100,141,144</u>

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2017</u> <u>PYG</u>	<u>CAD</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	7,578,653	1,672,153	-	-	9,250,806
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	37,722,316	-	12,479,244	1,264,826	51,466,386
A valor razonable instrumentos financieros derivados	(15,747,636)	-	-	-	(15,747,636)
A costo amortizado	24,532,525	-	-	-	24,532,525
Otras cuentas por cobrar	821,429	-	-	-	821,429
Otros activos	21,122	-	-	-	21,122
Pasivos financieros:					
A costo amortizado	(8,881,219)	-	-	-	(8,881,219)
A valor razonable	(5,990,626)	-	-	-	(5,990,626)
	<u>40,056,564</u>	<u>1,672,153</u>	<u>12,479,244</u>	<u>1,264,826</u>	<u>55,472,787</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

7. Efectivo y equivalentes de efectivo

El detalle de efectivo y equivalentes de efectivo es como sigue:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Efectivo en caja	30,000	20,000
Efectivo en bancos (a)		
Cuentas de ahorros:		
Denominadas en monedas extranjeras	1,067,101,130	562,119,370
Cuentas corrientes:		
Denominadas en pesos dominicanos	351,790,544	276,689,382
Denominadas en monedas extranjeras	1,354,985	2,651,164
Equivalentes de efectivo:		
Denominadas en pesos dominicanos (b)	929,782,082	1,090,678,043
Denominadas en monedas extranjeras (c)	-	1,209,372,801
	<u>2,350,058,741</u>	<u>3,141,530,760</u>

(a) Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, el efectivo depositado en cuentas de ahorros y corrientes devenga un interés basado en las tasas diarias determinadas por los bancos correspondientes. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP42,670,373 (2017: DOP25,523,277), los cuales se incluyen como parte de los otros ingresos en los estados de resultados integrales que se acompañan.

(b) Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, corresponden a certificados de depósitos en pesos dominicanos los cuales devengan tasas de interés anual que oscilan entre 4.4% y 10.75% (2017: 3%).

(c) Al 31 de diciembre de 2017, corresponden a certificados de depósitos en dólares estadounidenses los cuales devengan tasas de interés anual de 4%.

El vencimiento de los certificados en dólares estadounidenses y pesos dominicanos son iguales o inferiores a tres meses a la fecha de adquisición. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP52,823,357 (2017: DOP13,479,645), los cuales se incluyen como parte de los otros ingresos en los estados de resultados integrales que se acompañan.

Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, no existían restricciones de uso sobre los saldos de efectivo y equivalentes de efectivo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados

El detalle de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, es como sigue:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Títulos / valores de deuda (a):		
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	1,742,871,855	3,275,003,871
Banco Central de República Dominicana	932,723,271	410,917,292
Asociación La Nacional de Ahorros y Préstamos	-	52,662,400
Banco de Reservas de la República Dominicana	35,282,582	32,795,761
Banco de Ahorro y Crédito Confisa, S. A.	100,690	-
Consorcio Energético Punta Cana Macao, S. A.	48,452,320	53,938,812
Consorcio Remix, S. A.	4,581,432	30,712,922
Consorcio Minero Dominicano, S. A.	147,835,256	-
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	233,953,388	479,754,581
EDENORTE Dominicana S. A.	-	187,318,127
EDESUR Dominicana, S. A.	-	151,769,078
Empresa Generadora de Electricidad Haina S. A.	20,045,290	76,457,617
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	-	1,002,977
Fideicomiso RD Vial	51,796,904	-
Petroleum Company of Trinidad and Tobago Limited	130,539,358	-
Bonos Soberanos de Costa Rica	85,205,271	-
	<u>3,433,387,617</u>	<u>4,752,333,438</u>
Aportes en fondos de inversión (b):		
Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 Días Dólar	1,576,497	1,487,256
Fondo De Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	-	2,527,630
AFI Universal - Fondo Abierto Depósito Financiero Flexible	3,813,460	15,872,453
BHD Liquidez - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	494,097	122,498,717
Fondo Mutuo Renta Fija BHD Plazo 30 Días	441,907	422,460
Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	195,981	18,013
Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	5,936,270	5,827,257
JMMB Fondo de Inversión Cerrado Inmobiliario	6,720,877	7,617,240
JMMB Fondo de Inversión Money Market	21,424	-
JMMB Fondo Mutuo Plazo 90 días	33,989	-
PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	20,444,934	17,876,810
PIONEER-UNITED Fondo Cerrado Nacional Renta Fija	972,160	-
PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	-	1,157,821
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Liquidez	256,718	-
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual dólar	53,211,673	-
GAM - Fondo Cerrado GAM Energía	-	-
GAM - Fondo de Inversión Cerrado de Renta Fija	143,011,733	190,712,654
	<u>237,131,720</u>	<u>366,018,311</u>
Inversiones en acciones(c):		
Banco Continental	-	215,795,207
ProShares SQQQ	631,972	25,709,652
Globant	-	6,728,125
	<u>631,972</u>	<u>248,232,984</u>
	<u>3,671,151,309</u>	<u>5,366,584,733</u>

- (a) Corresponden a inversiones de títulos / valores de renta fija emitidos por entidades estatales y privadas, que generan intereses a tasas anuales que oscilan entre 9.25% y 18.5% en pesos dominicanos y para los dólares estadounidenses oscilan entre 5.5% y 10% anual, el rango de vencimiento de estos títulos / valores oscila entre el año 2019 y 2048. Estas inversiones de títulos / valores se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados (continuación)

Al 31 de diciembre de 2018, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP96,035,333 (2017: DOP134,742,353), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados en los estados de situación financiera que se acompañan.

- (b) Corresponden a las inversiones realizadas por la Compañía mediante aportes en fondos de inversión en la Republica Dominicana que invierten su capital en búsqueda de rentabilidad, los recursos aportados a los fondos de inversión en la Republica Dominicana se encuentran en distintas clases de activos (monedas, instrumentos de renta fija, acciones, entre otros). El valor total de un fondo de inversión dependerá del valor de mercado de cada uno de los activos que conforma el mismo, los cuales pueden ser transados en el mercado al momento de la emisión del fondo, o cuando la cuota se traspasa de un inversionista a otro. El valor de mercado de cada fondo es publicado diariamente por la Bolsa de Valores de la República Dominicana.
- (c) Corresponden a inversiones en acciones mantenidas para negociar en entidades en exterior, las cuales se registran a su valor razonable mediante los precios cotizados en el mercado y técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado.

A continuación, se presentan los rangos de la calificación riesgo de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados según los informes de las calificadoras de riesgos del año 2018, publicados por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
A- hasta A+	3,335,617,319	4,597,104,875
BBB- hasta BBB+	31,847,933	39,333,139
Menor que BBB-	165,821,940	-
Calificaciones de riesgo no disponible a la fecha	137,864,117	730,146,719
	<u>3,671,151,309</u>	<u>5,366,584,733</u>

Las Normas Internacionales de Información Financiera requiere que se revele información sobre el valor razonable de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados para los cuales sea práctico estimar su valor, aunque estos instrumentos financieros estén o no reconocidos en el estado de situación financiera. Igualmente, estas normas requieren la utilización de una jerarquía de tres niveles para la clasificación de cada instrumento financiero del estado de situación financiera. Por consiguiente, la Compañía utilizó la siguiente jerarquía para determinar y revelar el valor razonable de los instrumentos financieros por técnica de valuación:

- Nivel 1- Valores de cotización (no ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos.
- Nivel 2- Técnicas de valoración para las que la variable de menor nivel utilizada, que sea significativa para el cálculo, es directa o indirectamente observable.
- Nivel 3- Técnicas de valoración para las que la variable de menor nivel utilizada, que sea significativa para el cálculo, no es observable.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados (continuación)

Las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados clasificados por nivel de técnica de medición son presentadas a continuación:

	2018			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	3,433,387,617	-	3,433,387,617	-
Aportes en fondos de inversión	237,131,720	237,131,720	-	-
Inversiones en acciones	631,972	631,972	-	-
	<u>3,671,151,309</u>	<u>237,763,692</u>	<u>3,433,387,617</u>	<u>-</u>
	2017			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	4,752,333,438	-	4,752,333,438	-
Aportes en fondos de inversión	366,018,311	366,018,311	-	-
Inversiones en acciones	248,232,984	32,437,777	215,795,207	-
	<u>5,366,584,733</u>	<u>398,456,088</u>	<u>4,968,128,645</u>	<u>-</u>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, la Compañía producto de las ventas, rendimientos y valoraciones de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, produjo ganancias netas por un importe ascendente a DOP2,117,017,868 (2017: DOP2,236,825,109), las cuales se incluyen dentro de los resultados por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados integrales que se acompañan.

9. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados

El detalle de los activos y pasivos a valor razonable - instrumentos financieros derivados, es como sigue:

	Al 31 de diciembre	
	2018	2017
Activo:		
A valor razonable - instrumentos financieros derivados (a)	<u>60,219,789</u>	<u>60,106,379</u>
Pasivo:		
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados (b)	<u>(141,111,748)</u>	<u>(823,544,771)</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

9. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados (continuación)

- (a) A continuación, se presenta el detalle de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados, correspondientes al valor de mercado de los contratos de compra / venta a plazo o forward pactados relacionados con los títulos valores de deuda pendientes de liquidar, cuyo valor de mercado excedió el precio de recompra pactado:

	Al 31 de diciembre	
	2018	2017
Personas físicas	24,110,039	16,713,148
Personas jurídicas	16,264,004	5,618,550
Intermediarios de valores	9,642,920	4,848,822
Inversionista institucional	1,762,667	6,590,567
Partes relacionadas	547,159	13,043,130
Instituciones financieras	7,893,000	13,292,162
	<u>60,219,789</u>	<u>60,106,379</u>

Las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado, las clasificaciones por nivel de técnica de medición son presentadas a continuación:

	2018			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	47,495,211	-	47,495,211	-
Banco Central de República Dominicana	164,445	-	164,445	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	7,893,000	-	7,893,000	-
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	636,339	-	636,339	-
Consorcio Minero Dominicano, S.A.	11,212	-	11,212	-
Interactive Brokers LLC	4,019,582	-	4,019,582	-
	<u>60,219,789</u>	<u>-</u>	<u>60,219,789</u>	<u>-</u>
	2017			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	44,016,609	-	44,016,609	-
Banco Central de República Dominicana	4,940,409	-	4,940,409	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	7,142,423	-	7,142,423	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	4,006,938	-	4,006,938	-
	<u>60,106,379</u>	<u>-</u>	<u>60,106,379</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

9. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados (continuación)

- (b) A continuación, se presenta el detalle del pasivo a su valor razonable - instrumentos financieros derivados, correspondientes al valor de mercado de los contratos de compra / venta a plazo o forward pactados relacionados con los títulos valores de deuda pendientes de liquidar, cuyo valor de mercado es inferior al precio de recompra pactado:

	Al 31 de diciembre	
	2018	2017
Personas físicas	(38,511,964)	(151,184,434)
Personas jurídicas	(45,779,591)	(135,430,277)
Intermediarios de valores	(7,844,727)	(37,971,059)
Inversionista institucional	(21,052,580)	(242,378,557)
Partes relacionadas	(15,637,590)	(28,685,082)
Instituciones financieras	(12,285,296)	(227,895,362)
	(141,111,748)	(823,544,771)

Los pasivos a su valor razonable - instrumentos financieros derivados se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado, las clasificaciones por nivel de técnica de medición son presentadas a continuación:

	2018			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(110,049,173)	-	(110,049,173)	-
Banco Central de República Dominicana	(17,253,558)	-	(17,253,558)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(9,584,982)	-	(9,584,982)	-
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	(204,453)	-	(204,453)	-
Interactive Brokers LLC	(4,019,582)	-	(4,019,582)	-
	(141,111,748)	-	(141,111,748)	-
	2017			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(815,610,793)	-	(815,610,793)	-
Banco Central de República Dominicana	(2,935,380)	-	(2,935,380)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(2,431,577)	-	(2,431,577)	-
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	(2,567,021)	-	(2,567,021)	-
	(823,544,771)	-	(823,544,771)	-

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, la Compañía producto de las valoraciones de los instrumentos financieros a su valor razonable derivados, se produjo pérdidas netas por un importe ascendente a DOP2,084,642,727 (2017: DOP1,428,745,242), las cuales se presentan como resultados por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

9. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados (continuación)

Los contratos de compraventa a plazo de títulos valores de deuda que circulan en el mercado donde la Compañía es siempre contraparte del cliente. Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la Compañía mantiene las siguientes transacciones de contratos de títulos valores la cantidad en forwards de títulos de valores:

Al 31 de diciembre del 2018													
Tipo de Contrato	No. de Operaciones	Nacional				Instrumentos Financieros Derivados a Valor Razonable						Total Activos a Valor Razonable	Total Pasivos a Valor Razonable
		Compra de Cartera		Ventas de Cartera		Posición Activa			Posición Pasiva				
		Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año		
			DOP		DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP
FWD													
Títulos DOP	1,239	6,014,360,000	(37,234,442)	343,465,586	4,574,425	-	47,211,282	961,083	-	(79,557,673)	(1,274,708)	48,172,365	(80,832,381)
Títulos USD	107	1,758,698,479	(39,697,835)	173,995,873	1,357,154	-	10,450,197	-	-	(45,997,454)	(119,987)	10,450,197	(46,117,441)
FWD Divisas													
Títulos DOP	279	13,900,000	20,665	1,705,060,000	(12,585,362)	-	1,597,227	-	-	(13,314,087)	(847,839)	1,597,227	(14,161,926)
Total	1.625	7.786.958.479	(76.911.612)	2.222.521.459	(6.653.783)	-	59.258.706	961.083	-	(138.869.214)	(2.242.534)	60.219.789	(141.111.748)

Al 31 de diciembre del 2017													
Tipo de Contrato	No. de Operaciones	Nacional				Instrumentos Financieros Derivados a Valor Razonable						Total Activos a Valor Razonable	Total Pasivos a Valor Razonable
		Compra de Cartera		Ventas de Cartera		Posición Activa			Posición Pasiva				
		Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año		
			DOP		DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP
FWD													
Títulos DOP	1,183	10,879,500,000	(771,385,725)	366,220,000	20,222,196	-	45,538,142	2,244,048	-	(785,288,798)	(13,656,921)	47,782,190	(798,945,719)
Títulos USD	16	289,968,039	(809,129)	198,530,879	(2,867,580)	-	4,472,834	-	(2,867,581)	(5,281,963)	-	4,472,834	(8,149,544)
FWD Divisas													
Títulos DOP	303	234,750,000	(883,272)	1,963,740,000	(14,860,880)	-	7,851,355	-	-	(15,919,638)	(529,870)	7,851,355	(16,449,508)
Total	1,502	11,404,218,039	(773,078,126)	2,528,490,879	2,493,736	-	57,862,331	2,244,048	(2,867,581)	(806,490,399)	(14,186,791)	60,106,379	(823,544,771)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

9. Instrumentos financieros a su valor razonable (continuación)

Los contratos derivados financieros emitidos por la entidad, fueron:

	2018		2017	
	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP
Forward	<u>(80,891,957)</u>	<u>(80,891,957)</u>	<u>(763,438,391)</u>	<u>(763,438,391)</u>

Los tipos de monedas en que las transacciones fueron realizadas, son:

	2018		2017	
	USD	DOP	USD	DOP
Forward	<u>(48,231,942)</u>	<u>(32,660,015)</u>	<u>(3,676,709)</u>	<u>(759,761,682)</u>

Las contratantes que fueron utilizados para realizar estos contratos, fueron:

	2018			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	<u>7,893,000</u>	<u>(13,362,360)</u>	<u>(31,558,951)</u>	<u>(43,863,646)</u>

	2017			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	<u>(214,603,199)</u>	<u>(51,514,385)</u>	<u>(236,207,491)</u>	<u>(261,113,316)</u>

Las condiciones pactadas para estos contratos, son como sigue:

	2018				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	<u>(14,755,909)</u>	<u>(41,316,850)</u>	<u>(24,819,198)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

	2017				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	<u>(123,074,630)</u>	<u>(352,781,944)</u>	<u>(275,639,074)</u>	<u>(11,942,743)</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

9. Instrumentos financieros a su valor razonable (continuación)

La información de vencimiento para estos contratos, es como sigue:

	2018				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	(25,490,528)	(37,300,914)	(18,100,515)	-	-
	2017				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	(356,003,802)	(252,127,095)	(155,307,494)	-	-

10. Inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado

La composición de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado, es como sigue:

	Al 31 de diciembre	
	2018	2017
En fecha 27 de julio de 2018, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual la empresa generadora de electricidad Dominican Power Partners, LDC (DPP) (en lo adelante "DPP") le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud de del contrato de suministro de Energía y Potencia entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE) y DPP No. 135/14. Por medio de este contrato DPP transfiere la totalidad del crédito por un importe original de US\$16,914,217 equivalente a DOP850,382,575, este contrato devenga interés de 8% anual, con vencimiento en marzo de 2019, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2018, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$574,620 equivalente a DOP28,889,710.	879,272,285	-
En fecha 13 de septiembre de 2018, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual la empresa generadora de electricidad Dominican Power Partners, LDC (DPP) (en lo adelante "DPP") le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud de del contrato de suministro de Energía y Potencia entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE) y DPP No. 135/14. Por medio de este contrato DPP transfiere la totalidad del crédito por un importe original de US\$6,928,389 equivalente a DOP348,333,052, este contrato devenga interés de 8% anual, con vencimiento en marzo de 2019, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2018, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$189,819 equivalente a DOP9,543,371.	357,876,423	-
En fecha 16 de febrero de 2016, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual el Banco del Reservas de la Republica Dominicana le transfiere a la Compañía la deuda emitida por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana., por un importe original de DOP200,000,000, este contrato devengaba interés de 16% anual, pagadero en 60 cuotas iguales y consecutivas de DOP33,333,333, más intereses y estaba garantizado por el Estado Dominicano. Este crédito fue cobrado en su totalidad durante el año 2018.	-	401,066,667
	<u>1,237,148,708</u>	<u>401,066,667</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

10. Inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado (continuación)

A continuación, presentamos el vencimiento de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado:

	<u>31 de diciembre de</u>	
	<u>2018</u>	<u>2017</u>
2018	-	401,066,667
2019	<u>1,237,148,708</u>	<u>-</u>
	<u>1,237,148,708</u>	<u>401,066,667</u>

Al 31 de diciembre de 2018, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a US\$764,439 equivalente a DOP38,433,081 (2017: DOP1,066,667), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado en los estados de situación financiera que se acompañan.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, la Compañía reconoció ingresos por intereses por concepto de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado por un importe aproximado de DOP86.4 millones (2017: DOP138.0 millones), los cuales se presentan como resultado por instrumentos financieros - a costo amortizado en los estados de resultados integrales que se acompañan.

11. Otras cuentas por cobrar

La composición de las otras cuentas por cobrar, es como sigue:

	<u>Al 31 de diciembre</u>	
	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Interés por cobrar (a)	29,365,091	142,868,089
Cuentas por cobrar empleados	603,981	1,388,237
Anticipos a proveedores	871,836	115,687
Cuentas por cobrar a parte relacionada	1,032	-
Otras	<u>120,424</u>	<u>205,099</u>
	<u>30,962,364</u>	<u>144,577,112</u>

(a) Corresponde principalmente, a cobro de cupones cedidos por los clientes a la Compañía para ser pagados a una fecha futura por el intermediario de valores.

El resumen de las otras cuentas por cobrar de acuerdo con su vencimiento al 31 de diciembre, se presenta a continuación.

<u>Con Atrasos sin Deterioro</u>					
<u>Año</u>	<u>Sin atraso ni deterioro</u>	<u>De 1 día y menos de 45 días</u>	<u>De 45 días y menos de 60 días</u>	<u>Más de 60 días</u>	<u>Total</u>
<u>2018</u>	<u>29,404,591</u>	<u>1,555,773</u>	<u>-</u>	<u>2,000</u>	<u>30,962,364</u>
<u>2017</u>	<u>142,868,089</u>	<u>364,638</u>	<u>370,463</u>	<u>973,922</u>	<u>144,577,112</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

12. Inversiones en acciones

Un detalle de las inversiones en acciones de la Compañía al 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>Al 31 de diciembre</u> <u>2018</u>	<u>2017</u>	<u>Porcentaje</u> <u>2018</u>	<u>Porcentaje</u> <u>2017</u>
CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A.				
(a)	89,895,157	1,200	3.4471%	0.00003%
Bolsa de Valores de la República Dominicana (b)	<u>28,384,353</u>	<u>28,384,353</u>	<u>9.9999%</u>	<u>9.9999%</u>
	<u>118,279,510</u>	<u>28,385,553</u>		

- (a) CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A., es una empresa constituida el 23 de septiembre de 2003, bajo las leyes de la República Dominicana, como resultado de la promulgación de la Ley No. 19-00 de Mercado de Valores y su reglamento.

Inició sus operaciones el 13 de octubre de 2003, y tiene como objeto principal transferir, compensar, registrar y liquidar los valores que se negocien en el mercado de valores, así como cualquier otra actividad autorizada por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana, de conformidad con las Resoluciones No. 01 y 04, emitidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana en fechas 3 de mayo de 2004 y 26 de enero de 2005, y se rige por la Ley 19-00 del Mercado de Valores y el reglamento de aplicación de la Ley.

El movimiento de las inversiones en acciones, durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Saldo al inicio del año	1,200	1,200
Adiciones (i)	<u>89,893,957</u>	<u>-</u>
Saldo al final del año	<u>89,895,157</u>	<u>1,200</u>

- (i) Corresponde a adquisición de 18,179 acciones dentro del capital suscrito y pagado de la sociedad Cevaldom a razón de US\$100.94 por cada una, mediante la suscripción de un Acuerdo de Compraventa definitivo en fecha 23 de febrero de 2018 con la sociedad Cavali, S. A, anterior propietaria de las inversiones, con efectividad al 1ro de marzo de 2018.
- (b) Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. fue constituida el 15 de mayo de 2001, bajo la razón social Bolsa Nacional de Valores. Posteriormente, en fecha 8 de abril de 2002, cambió formalmente su nombre a Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. Su objetivo principal es prestar todos los servicios necesarios para la efectiva realización de transacciones con valores, así como toda actividad que contribuya al desarrollo del mercado de valores. La Bolsa de Valores es a su vez propietaria del 34% de CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, los ingresos generados por estas inversiones ascienden a DOP7,794,184 (2017: DOP561), los cuales se presentan en el renglón de resultado de inversiones en sociedades en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

13. Mobiliario y equipos

El movimiento de mobiliario y equipos, durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	Mobiliarios y Equipos	Equipos de Transporte	Total
Costo de adquisición:			
Al 1ro. de enero de 2017	12,068,513	2,329,412	14,397,925
Adiciones	1,833,077	2,044,995	3,878,072
Retiros	(5,024,405)	(1,110,450)	(6,134,855)
Reclasificación (nota 14)	1,388,426	-	1,388,426
Al 31 de diciembre de 2017	10,265,611	3,263,957	13,529,568
Adiciones	1,754,667	-	1,754,667
Retiros	(1,665,976)	(1,083,062)	(2,749,038)
Al 31 de diciembre de 2018	10,354,302	2,180,895	12,535,197
Depreciación acumulada:			
Al 1ro. de enero de 2017	(6,528,194)	(1,144,532)	(7,672,726)
Gasto de depreciación	(3,623,587)	(148,276)	(3,771,863)
Retiros	4,055,490	473,386	4,528,876
Al 31 de diciembre de 2017	(6,096,291)	(819,422)	(6,915,713)
Gasto de depreciación	(2,751,265)	(610,953)	(3,362,218)
Retiros	1,665,976	1,083,062	2,749,038
Al 31 de diciembre de 2018	(7,181,580)	(347,313)	(7,528,893)
Valor en libros:			
Al 31 de diciembre de 2018	3,172,722	1,833,582	5,006,304
Al 31 de diciembre de 2017	4,169,320	2,444,535	6,613,855

Al 31 de diciembre 2018, la Compañía mantiene activos en uso totalmente depreciados con un costo de adquisición aproximado de DOP6,503,000 (2017: DOP3,600,000).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

14. Cargos diferidos

El movimiento de los cargos diferidos durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	Mejoras en Propiedades Arrendadas	Licencias	Total
Costo de adquisición:			
Al 1ro. de enero de 2017	12,124,704	7,974,593	20,099,297
Adiciones	370,331	1,116,400	1,486,731
Reclasificación	(1,388,426)	-	(1,388,426)
Al 31 de diciembre de 2017	11,106,609	9,090,993	20,197,602
Adiciones	-	2,320,027	2,320,027
Retiro	(112,124)	(1,199,025)	(1,311,149)
Reclasificación	379,213	-	379,213
Al 31 de diciembre de 2018	11,373,698	10,211,995	21,585,693
Amortización acumulada:			
Al 1ro. de enero de 2017	(4,679,617)	(4,112,441)	(8,792,058)
Gasto de amortización	(1,449,762)	(2,077,440)	(3,527,202)
Al 31 de diciembre de 2017	(6,129,379)	(6,189,881)	(12,319,260)
Gasto de amortización	(2,274,740)	(1,901,395)	(4,176,135)
Retiro	-	772,249	772,249
Reclasificación	(379,213)	-	(379,213)
Al 31 de diciembre de 2018	(8,783,332)	(7,319,027)	(16,102,359)
Valor en libros:			
Al 31 de diciembre de 2018	2,590,366	2,892,967	5,483,334
Al 31 de diciembre de 2017	4,977,230	2,901,112	7,878,342

Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía mantiene programas de cómputo en uso totalmente amortizados con un costo de adquisición de aproximadamente DOP570,000 (2017: DOP560,000).

15. Pasivos financieros a su valor razonable

Corresponden a las obligaciones por contratos mediante el cual la Compañía recibe en préstamo títulos valores con la obligación de entregar al vencimiento del contrato, el equivalente a los títulos valores del mismo emisor, así como los intereses generados durante el plazo de vencimiento. Estas obligaciones se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado. El detalle de los pasivos financieros a su valor razonable, es como sigue:

	2018			
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Valor razonable
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	34,777,285	-	34,777,285
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	4,040,944,031	-	4,040,944,031
Dominican Power Partners	-	67,553,917	-	67,553,917
	-	4,143,275,233	-	4,143,275,233

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

15. Pasivos financieros a su valor razonable (continuación)

	2017			
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Valor razonable
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	878,544,291	-	878,544,291
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	2,746,300,320	-	2,746,300,320
	<u>-</u>	<u>3,624,844,611</u>	<u>-</u>	<u>3,624,844,611</u>

A continuación, se resume un perfil de vencimiento de los pasivos financieros:

	2018				Totales
	Hasta 1 mes	1 a 3 meses	3 meses a 1 año	1 a 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable:					
Indexados a Títulos					
Valores	2,167,428,405	376,378,566	1,599,468,262	-	4,143,275,233
	<u>2,167,428,405</u>	<u>376,378,566</u>	<u>1,599,468,262</u>	<u>-</u>	<u>4,143,275,233</u>

	2017				Totales
	Hasta 1 mes	1 a 3 meses	3 meses a 1 año	1 a 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable:					
Indexados a Títulos					
Valores	2,017,587,380	1,083,058,484	524,198,747	-	3,624,844,611
	<u>2,017,587,380</u>	<u>1,083,058,484</u>	<u>524,198,747</u>	<u>-</u>	<u>3,624,844,611</u>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, la Compañía producto los rendimientos y valoraciones de los pasivos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, se reconoció pérdidas netas por un importe ascendente a DOP577,823,865 (2017: DOP40,575,846), las cuales se incluyen dentro resultados integrales por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

16. Obligaciones con bancos

El detalle de los préstamos bancarios a corto plazo es como sigue:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
<u>Banco Popular Dominicano, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 5 de febrero de 2014, por un importe original de DOP885,444, el cual causaba una tasa de interés de 12.00% anual. Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	200,139
Préstamo adquirido en fecha 15 de abril de 2016, por un importe original de DOP903,120, el cual causaba una tasa de interés de 12.50% anual. Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	239,446
Préstamo adquirido en fecha 17 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP900,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de octubre del año 2018. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8). Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	903,337,778
Préstamo adquirido en fecha 17 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP60,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de marzo del año 2018. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8). Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	60,078,889
<u>Préstamo con la Asociación Cibao de Ahorros y préstamos, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 30 de noviembre de 2017, por un importe original de DOP400,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 7.1% anual, con vencimiento en el mes de septiembre del año 2018. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8). Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	400,000,000
<u>Banco BHD León, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 18 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP500,000,000, el cual causa una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2018. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8). Este préstamo fue pagado en su totalidad durante el año 2018.	-	501,263,889
	-	<u>1,865,120,141</u>

Al 31 de diciembre de 2017, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP4,878,889, los cuales se incluyen como parte de este rubro de las obligaciones con bancos en los estados de situación financiera que se acompañan.

Al 31 diciembre de 2017, la Compañía posee obligaciones con bancos por un importe aproximado de DOP1,865,000,000, las cuales están garantizadas con inversiones de títulos / valores de renta fija emitidas por el Ministerio de Hacienda de República Dominicana y el Banco Central de la República Dominicana (nota 8).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

16. Obligaciones con bancos (continuación)

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, la Compañía reconoció gastos de intereses por concepto de obligaciones con bancos por DOP22,663,555 (2017 DOP56,838,290), los cuales se incluyen dentro de los gastos por financiamiento en los estados de resultados integrales que se acompañan.

17. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos

Las obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto y largo plazo consisten en:

	31 de diciembre de	
	2018	2017
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo		
Bonos locales	675,000,000	-
Intereses por pagar sobre bonos locales	13,420,342	12,782,740
	<u>688,420,342</u>	<u>12,782,740</u>
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo		
Bonos locales	1,288,420,342	887,782,740
Menos: porción corriente de bonos locales	(688,420,342)	(12,782,740)
	<u>600,000,000</u>	<u>875,000,000</u>
	<u><u>1,288,420,342</u></u>	<u><u>887,782,740</u></u>

Bonos locales

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Segunda Resolución de fecha 11 de abril de 2018, el Programa de Emisiones de Bonos Corporativos por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-119 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1806-BC0075. Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía mantiene colocado de esta emisión un importe de DOP400,000,000. Los títulos devengan una tasa de interés 9% y 9.5% anual, pagaderos de manera trimestral y semestral con vencimiento 2021 y 2023.

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Tercera Resolución de fecha 25 de abril de 2016, el Programa de Emisiones de Bonos Corporativos por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-098 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1604-BC062. Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la Compañía mantiene colocado un importe de DOP875,000,000. Los títulos devengan una tasa de interés 9.5% hasta 10% anual, pagaderos de manera trimestral y semestral con vencimiento en mayo de 2019 y abril de 2020.

El programa de emisión de títulos estaba conformado por cinco (5) tramos con un plazo de colocación de doce meses a partir de la fecha de aprobación del programa de emisión por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana. Cada tramo era por un importe de DOP200,000,000 para un total de DOP1,000,000,000.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

17. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (continuación)

Bonos locales (continuación)

2018					
Tramos	Monto	Tasa Anual	Fecha de Emisión	Vencimiento	Calendario de Repago
1	75,000,000	9.5%	09/05/2016	09/05/2019	Pago al vencimiento
2 al 4	600,000,000	9.6%	09/05/2016	09/05/2019	Pago al vencimiento
5	200,000,000	10%	27/04/2017	27/04/2020	Pago al vencimiento
1	200,000,000	9.0%	28/06/2018	28/06/2021	Pago al vencimiento
1	200,000,000	9.5%	28/06/2018	28/06/2023	Pago al vencimiento
	1,275,000,000				

2017					
Tramos	Monto	Tasa Anual	Fecha de Emisión	Vencimiento	Calendario de Repago
1	75,000,000	9.5%	09/05/2016	09/05/2019	Pago al vencimiento
2 al 4	600,000,000	9.6%	09/05/2016	09/05/2019	Pago al vencimiento
5	200,000,000	10%	27/04/2017	27/04/2020	Pago al vencimiento
	875,000,000				

Al 31 de diciembre de 2018, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP13,420,342 (2017: DOP12,782,740), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo en los estados de situación financiera que se acompañan.

El movimiento anual de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto y largo plazo excluyendo los intereses pendientes de pago se presenta a continuación:

	31 de diciembre de	
	2018	2017
Saldo al inicio del año	875,000,000	675,000,000
Bonos locales emitidos en el año	400,000,000	200,000,000
Saldo al final del año	1,275,000,000	875,000,000

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, la Compañía reconoció gastos de intereses por obligaciones por instrumentos financieros emitidos DOP101,786,074 (2017: DOP77,857,968), los cuales se incluyen dentro de los gastos por de financiamiento en los estados de resultados integrales que se acompañan.

18. Saldos y transacciones con partes relacionadas

La Compañía realiza transacciones y mantiene saldos importantes con sus relacionadas, principalmente con Mercado Electrónico Dominicano, S. A y Alpha Securities, Inc., así como con otras partes relacionadas. Las transacciones con sus relacionadas consisten principalmente en que la Compañía, presta servicios de administración de inversiones y gestiones administrativas, así como efectúa pagos a cuenta de la Compañía.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

Los saldos mantenidos y transacciones importantes realizadas con sus partes relacionadas, son como siguen:

		Al 31 de diciembre	
		2018	2017
Saldos:	Vínculo		
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	-	1,002,977
GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	Relacionada	143,011,733	190,712,654
		<u>143,011,733</u>	<u>191,715,631</u>
Pasivos financieros a su valor razonable:			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>(53,974,891)</u>	<u>(112,374,795)</u>
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>547,159</u>	<u>13,043,130</u>
Pasivos a su valor razonable instrumentos financieros derivados:			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>(15,637,590)</u>	<u>(28,685,082)</u>
Cuentas por pagar a relacionadas:			
Mercado Electrónico Dominicano, S. A.	Relacionada	(1,437,835)	(2,224,156)
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>(177,259)</u>	<u>-</u>
		<u>(1,615,094)</u>	<u>(2,224,156)</u>
Transacciones:			
Resultado por instrumentos financieros			
A valor razonable (Operaciones de ventas)	Relacionadas	503,943,337	189,776,235
A costo amortizado	Relacionada	-	(120,210)
		<u>503,943,337</u>	<u>189,656,025</u>
Gastos de administración y comercialización:			
Arrendamientos (nota 24)	Relacionada	(6,862,555)	(4,463,015)
Servicios generales, planeamiento, estrategia y soporte de tecnología (nota 24)	Relacionada	<u>(26,965,045)</u>	<u>(25,402,647)</u>
		<u>(33,827,600)</u>	<u>(29,865,662)</u>
Dividendos (nota 21):			
Dividendos pagados	Accionistas	450,000,000	225,000,000
Retenciones		50,000,000	25,000,000
Total		<u>500,000,000</u>	<u>250,000,000</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

Términos y condiciones

Las cuentas por pagar a partes relacionadas no tienen garantías y no causan intereses. Estos saldos son pagaderos en efectivo y en la moneda funcional de la Compañía. Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018 y 2017, no se ha reconocido ningún deterioro relacionado con estos saldos.

Compensaciones al personal clave

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, las compensaciones al personal clave ascienden a aproximadamente DOP66.4 millones (2017: DOP54 millones). Este importe se incluye como parte de los gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

19. Acumulaciones y otras obligaciones por pagar

El resumen de las acumulaciones y otras obligaciones al 31 de diciembre, es como sigue:

	Al 31 de diciembre	
	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Retenciones por pagar	3,588,551	3,356,958
Bonificación por pagar	12,315,782	9,907,048
Incentivo al personal por pagar	56,733,671	37,348,882
AFP Por pagar	162,684	-
SFS Por pagar	152,618	-
Anticipo de impuestos por pagar	120,088	-
	<u>73,073,394</u>	<u>50,612,888</u>

20. Impuesto sobre la renta

El impuesto corriente es determinado tomando como base lo establecido en la Ley 11-92, Código Tributario de la República Dominicana, sus reglamentos y sus modificaciones. La tasa del impuesto sobre la renta para los años 2018 y 2017 es de 27%. Existen diferencias entre el resultado antes de impuesto sobre la renta, según muestra el estado de resultados integrales y la renta neta imponible determinada de conformidad con el Código Tributario de la República Dominicana. Estas diferencias son reconocidas como diferencias permanentes o temporales según sea el caso.

La Compañía está sujeta al impuesto sobre los activos corresponde al 1% de los activos tributables. Los activos tributables corresponden al total de activos de la Compañía, considerados como bienes en uso y otros activos diferidos. La Compañía debe liquidar el impuesto sobre la renta del período en base al importe mayor entre el 1% de los activos gravables o según la renta neta imponible determinado sobre la tasa vigente a cada fecha de los estados financieros.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Impuesto sobre la renta (continuación)

Gasto de impuesto sobre la renta:

La composición del impuesto sobre la renta en los estados financieros para los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	31 de diciembre	
	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Impuesto sobre la renta:		
Activo	50,063	-
Corriente	-	43,285,161
Diferido	(10,379,670)	(13,040,104)
	<u>(10,329,607)</u>	<u>30,245,057</u>

El impuesto sobre la renta del año terminado el 31 de diciembre de 2018 se determinó sobre la base del 1% de los activos gravables como resultado que dicho importe fue mayor al determinado sobre la base de la renta neta imponible (2017: se determinó sobre la base de la renta neta imponible como resultado de que dicho importe fue mayor al determinado sobre la base del 1% sobre los activos gravables).

Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2018 y 2017, la determinación del impuesto sobre el 1% de los activos se detalla a continuación:

	Al 31 de diciembre de	
	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Total activos	7,581,084,610	9,247,536,907
Activos no gravables	(7,576,078,306)	(9,240,923,052)
Total activos gravables	5,006,304	6,613,855
Tasa de impuesto sobre los activos	1%	1%
Impuesto sobre los activos	<u>50,063</u>	<u>66,139</u>

A continuación, se presenta una conciliación de la utilidad antes de impuesto:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Utilidad antes de impuesto sobre la renta	405,645,009	611,194,208
Diferencias permanentes (a)	(480,185,364)	(465,437,145)
Diferencias temporales (b)	8,609,258	14,558,349
Utilidad (pérdida) fiscal	(65,931,097)	160,315,412
	27%	27%
Impuesto sobre la renta corriente	<u>-</u>	<u>43,285,161</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Impuesto sobre la renta (continuación)

(a) Corresponden principalmente a los ingresos generados por las ventas de bonos exentos emitidos por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, los cuales según la Ley 19-00 se consideran exentos del pago de impuestos.

(b) Corresponde principalmente a pérdidas no realizadas en años anteriores.

La composición del activo por impuesto sobre la renta diferido al 31 de diciembre 2018 y 2017, así como el movimiento del mismo durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>Estado de Situación Financiera</u>		<u>Estado de Resultados</u>	
	<u>31 de diciembre de</u>		<u>2018</u>	<u>2017</u>
	<u>2018</u>	<u>2017</u>		
Impuesto sobre la renta diferido:				
Diferencia cambiaria	(1,530,497)	(1,844,996)	314,499	(1,541,807)
Otras provisiones	(245,348)	5,952,995	(6,198,343)	5,806,032
Pérdidas trasladables	29,115,986	15,121,835	13,994,151	(4,388,880)
Pérdida no realizada	8,648,402	6,379,039	2,269,363	13,164,759
Total	35,988,543	25,608,873	10,379,670	13,040,104

A continuación, se presenta la conciliación entre la tasa de impuesto efectiva y la tasa de impuesto oficial al 31 de diciembre de 2018 y 2017:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Tasa oficial	27%	27.00%
Ingresos exentos Ministerio de Hacienda	(31.96%)	(21.08%)
Ganancia/pérdida no realizada	2.13%	1.11%
Otras partidas	5.38%	(2.08%)
Tasa impuesto-efectiva	2.55%	4.95%

El movimiento de los anticipos de impuesto sobre la renta para el año terminado al 31 de diciembre de 2018 y 2017, es como sigue:

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Saldo a favor:		
Anticipos de impuesto sobre la renta al inicio del período	63,921,030	93,919,813
Anticipos de impuesto sobre la renta pagados durante el período	1,821,629	13,286,378
Gasto de impuesto sobre la renta corriente compensado del período	(50,063)	(43,285,161)
Anticipos de impuesto sobre la renta al final de período	65,692,596	63,921,030

Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía dispone de pérdidas trasladables las cuales pueden ser compensadas como sigue:

<u>Años a</u>	<u>Importe</u>
<u>Compensar</u>	
2019	30,322,217
2020	30,322,217
2021	20,820,112
2022	13,186,220
2023	13,186,220
	107,836,986

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

21. Patrimonio

Capital social suscrito y pagado

Al 31 de diciembre de 2018 y 2017 el capital social suscrito se encuentra conformado por 9,000,000 acciones comunes con valor nominal de DOP100 cada una, emitidas y en circulación. Al 31 de diciembre de 2018 y 2017 el capital social suscrito y pagado asciende a DOP900,000,000, constituido por 9,000,000 acciones comunes con un valor nominal de DOP100 cada una.

En fecha 4 de mayo de 2017, mediante acta de la Asamblea General Extraordinaria se aprobó el aumento del capital autorizado de la Compañía de DOP650,000,000 a DOP900,000,000. Adicionalmente, se incrementó el capital suscrito y pagado a DOP900,000,000, mediante la capitalización de los resultados acumulados - distribuibles por un importe de DOP300,000,000, equivalentes a 2,500,000 acciones. Durante esta acta de la Asamblea General Extraordinaria se aprobó la repartición de dividendos en efectivo por un importe de DOP250,000,000.

El movimiento de las acciones en cantidad y valores durante los años terminados al 31 de diciembre es como sigue:

Cantidad de acciones:	2018	2017
<u>Capital social suscrito:</u>		
Número de acciones al inicio	9,000,000	6,500,000
Acciones emitidas durante el año	-	2,500,000
Número de acciones al final	9,000,000	9,000,000
<u>Capital social suscrito y pagado:</u>	2018	2017
Número de acciones al inicio	9,000,000	6,500,000
Acciones emitidas durante el año	-	2,500,000
Número de acciones al final	9,000,000	9,000,000
<u>Valores:</u>	2018	2017
<u>Capital social suscrito:</u>		
Saldo inicial	900,000,000	650,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	250,000,000
Saldo final	900,000,000	900,000,000
<u>Capital social suscrito y pagado:</u>		
Saldo inicial	900,000,000	650,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	250,000,000
Saldo final	900,000,000	900,000,000

Al 31 de diciembre de 2018 y 2017 el capital social suscrito y pagado esta poseído de la siguiente manera:

	Acciones Emitidas	Valor Nominal En DOP	Participación
Milenio Acquisition Inc.	3	300	0.00003%
Servicios Corporativos, Dominicanos, S. A.	8,999,997	899,999,700	99.99997%
Total	9,000,000	900,000,000	100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

21. Patrimonio (continuación)

Reserva de capital

El Artículo 46 de la Ley de Mercado de Valores 19-00, establece que las sociedades que realizan transacciones bursátiles deberán efectuar una reserva que corresponde al 20% del total capital pagado de la Compañía. Esta reserva no está disponible para ser distribuida como dividendos, excepto en el caso de disolución de la Compañía. Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la reserva de capital es equivalente a dicho porcentaje.

En fecha 4 de mayo de 2017, mediante acta de la Asamblea General Extraordinaria la Compañía aprobó el aumento de la reserva de capital, mediante la transferencia de los resultados acumulados - distribuíbles por un importe de DOP50,000,000.

Dividendos pagados

En fecha 26 de julio de 2018, mediante acta de Asamblea General Ordinaria se aprobó la repartición de dividendos por un importe de DOP500,000,000.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, la Compañía declaró dividendos a sus accionistas por un importe de DOP250,000,000.

Índices de riesgo de capital

La Compañía debe mantener niveles mínimos de capitalización determinados con base en las proporciones de activos, pasivos y ciertas operaciones contingentes con riesgo fuera de balance con respecto al patrimonio de la Compañía (Índice de Patrimonio y Garantías de Riesgo). Los elementos para la determinación de los índices de capitalización están sujetos a clasificaciones, ponderaciones de acuerdo a los niveles de riesgo y otros factores establecidos en el Manual de Contabilidad y Plan de Cuentas para los Intermediarios de Valores emitido por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana (SIV) y en la Resolución CNV2005-10-IV "Norma para los Intermediarios de Valores que establece las disposiciones para su funcionamiento". De acuerdo con los índices mantenidos, la Compañía queda clasificada y autorizada para realizar determinadas operaciones bursátiles y financieras.

Al 31 de diciembre de 2018, la utilidad por acción de la Compañía asciende a DOP90 (2017: DOP101) por cada acción.

Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la Compañía calificaba dentro de la tipología de Actividades Universales de Intermediación, Corretaje y por Cuenta Propia, de acuerdo a las características de su capital social suscrito y pagado, de su patrimonio líquido y de su patrimonio y garantías de riesgo primario (Nivel 1).

Los índices mantenidos y requeridos, calculados con base en las cifras presentadas en los estados financieros de la Compañía, se indican a continuación:

	31 de diciembre de			
	2018		2017	
	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>
Índice de patrimonio y garantías de riesgo	0.4883	0.155	0.8180	0.103
Índice de patrimonio y garantías de riesgo (Nivel 1)	0.4846	0.103	0.8180	0.103

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

22. Información por segmento / resultados por líneas de negocios

Los segmentos operativos son componentes que involucran actividades de negocio que pueden obtener ingresos o incurrir en gastos, cuyos resultados operativos son revisados en forma regular por la Administración de la Compañía, la información por segmento revisada para los años reportados es la siguiente

Tipo de Contrato	Al 31 de diciembre de 2018									
	Comisiones		Valor Razonable						A Costo Amortizado	
			Ajuste a Valor Razonable		Ventas de Cartera Propia		Otros		Intereses	
	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razonable	-	-	2,044,333,283	(3,401,028,312)	4,342,478,160	(282,171,937)	377,290,375	(435,892,521)	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	1,371,245,016	(3,455,887,743)	-	-	-	-	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	86,394,548	-
Ingresos por Custodia de Valores	-	(10,846,715)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ingresos (gastos) por Servicios	2,031,998	(6,975,965)	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(4,372,818)	-	-	-	-	-	-	-	-
Total	2,031,998	(22,195,498)	3,415,578,299	(6,856,916,055)	4,342,478,160	(282,171,937)	377,290,375	(435,892,521)	86,394,548	-

Tipo de Contrato	Al 31 de diciembre de 2017									
	Comisiones		Valor Razonable						A Costo Amortizado	
			Ajuste a Valor Razonable		Ventas de Cartera Propia		Otros		Intereses	
	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razonable	-	-	1,172,912,427	(3,213,543,864)	4,337,615,143	(136,709,466)	339,561,720	(303,586,697)	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	1,366,288,889	(2,795,034,131)	-	-	-	-	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	137,973,388	-
Gastos por Custodia de Valores	-	(10,407,851)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ingresos (gastos) por Servicios	2,445,188	(3,389,923)	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(5,931,560)	-	-	-	-	-	-	-	-
Total	2,445,188	(19,729,334)	2,539,201,316	(6,008,577,995)	4,337,615,143	(136,709,466)	339,561,720	(303,586,697)	137,973,388	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Gastos de administración y comercialización

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la composición de los gastos de administración y comercialización, es como sigue:

	Al 31 de diciembre de	
	2018	2017
<i>Compensación al personal:</i>		
Sueldos al personal	63,452,268	51,942,197
Beneficio al personal	99,776,234	72,994,685
Aportes al plan de pensiones	4,482,018	3,692,736
Otras compensaciones al personal	8,445,466	7,610,623
	<u>176,155,986</u>	<u>136,240,241</u>
<i>Gastos operativos:</i>		
Viajes	1,403,125	1,002,181
Promoción y publicidad	40,601,986	29,698,554
Otros gastos operativos	3,556,678	2,194,190
	<u>45,561,789</u>	<u>32,894,925</u>
<i>Otros gastos de administración:</i>		
Servicios de relacionadas (nota 18)	26,965,045	25,402,647
Servicios de proveedores locales	16,586,464	9,795,399
Arrendamientos (nota 24)	6,862,555	4,463,015
Asesoría legal	2,963,372	2,574,150
Gastos de depreciación	3,362,218	3,771,863
Gastos de amortización	4,176,135	3,527,202
Cuotas comisiones y pagadas	6,358,505	8,339,426
Gastos de comunicaciones	36,797	203,074
Seguro	116,505	108,765
Mantenimiento y reparaciones	356,735	211,607
Otros gastos de administración	10,997,323	12,025,389
	<u>78,781,654</u>	<u>70,422,537</u>
	<u><u>300,499,429</u></u>	<u><u>239,557,703</u></u>

24. Contingencias y compromisos

Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, la Compañía tiene contingencias por derechos y obligaciones referentes a contratos de compraventa spot y forward de títulos valores de deuda según se presenta a continuación:

	Al 31 de diciembre de	
	2018	2017
Contingentes		
Derechos por Contratos de Compra Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD)	8,232,515,996	12,880,011,474
Derechos por Contratos de Venta de Divisas Implícito	1,775,088,969	2,204,069,760
Derechos por Contratos de Compra de Divisas Implícitos	14,997,648	274,460,481
Derechos por Contratos de Compra Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	-	414,993,651
Derechos por Contratos de Venta Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	-	428,758,113
Derechos por Contratos de Venta Spot de Acciones - Portafolio de Acciones "T"	-	499,303
Derechos por Contratos de Compra Forward de TVD con un tenor al vencimiento mayor a 365 días	569,917,410	662,869,313
Derechos por Contratos de Compra Futuros de TVD	91,967,739	-
Derechos por Contratos de Venta Futuros de TVD	286,570,569	-
	<u><u>10,971,058,331</u></u>	<u><u>16,865,662,095</u></u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

24. Contingencias y compromisos (continuación)

Encargos de confianza

Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía refleja a valor nominal, un saldo de DOP18,021,128,900 (2017: DOP21,557,619,615) por títulos valores pertenecientes a terceros objetos de encargos de confianza por contratos de mandato para apertura y manejo de servicio de custodia de valores ante CEVALDOM.

La Compañía dispone de nueve líneas de crédito aprobadas por DOP3,918,143,000 (2017: DOP3,955,852,000) en bancos del país. Estas líneas están garantizadas con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana. Al 31 de diciembre de 2018, la compañía no posee balance de inversiones restringidas puestas en garantías (2017: DOP1,646,874,730). Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía no está utilizando estas líneas de crédito (2017: DOP1,860,000,000) y posee un balance disponible de DOP3,918,143,000 (2017: DOP2,095,852,000).

Contrato de alquiler

La Compañía mantiene un contrato de arrendamiento operativo con la relacionada Mercado Electrónico Dominicano, S. A., como arrendatario, sobre propiedad que utiliza para sus oficinas administrativas, el cual es a largo plazo. El plazo de arrendamiento se extiende hasta el 28 de junio de 2020 con renovación a vencimiento, previo acuerdo entre las partes interesadas. Al 31 de diciembre de 2018, la renta mensual es de DOP729,891 (2017: DOP350,664). Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, el gasto por este concepto ascendió a DOP6,862,555 (2017: DOP4,463,015) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

El total de pagos futuros mínimos por concepto de arrendamiento, derivados del contrato de arrendamiento operativo no cancelable vigentes al 31 de diciembre de 2018, durante los próximos dos (4) años es como sigue:

<u>Año</u>	<u>Importe</u>
	<u>DOP</u>
2019	9,196,627
2020	9,656,458
2020	20,785,526
	<u>39,638,611</u>

Otros compromisos

La Compañía es miembro de la Bolsa de Valores de la República Dominicana, S. A., por lo que tiene la obligación, según lo establece la Ley 19-00, de pagar mensualmente el importe de DOP95,000.00, por concepto de mantenimiento y acceso al Sistema Integrado Bursátil Electrónico (SIBE), adicional a esto tiene el compromiso de pagar un monto mensual de DOP30,000.00 equivalentes al 0.003% de la emisión vigentes. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, los gastos por este concepto ascendieron a DOP1,548,010 (2017: DOP1,500,000), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

24. Contingencias y compromisos (continuación)

Otros compromisos (continuación)

La Compañía es miembro de la Asociación de Puestos de Bolsa de la República Dominicana, S. A., por lo que tiene la obligación, según lo establece la Ley 19-00, de pagar mensualmente el importe de DOP62,000 (2017: DOP62,000) por concepto de cuota de membresía. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2018 y 2017 los gastos por este concepto ascendieron a DOP744,000 los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados que se acompañan.

La Compañía tiene un acuerdo con CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A., por custodia, transferencia, compensación y liquidación de valores, adicional a esto tiene el compromiso de pagarle de manera mensual DOP5,000.00 por cada emisión vigente. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2018, los gastos por este concepto ascendieron a DOP10,846,715 (2017: DOP10,467,851), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

La Compañía tiene el compromiso de pagar a la Superintendencia de Valores de la República Dominicana una tarifa por servicio de mantenimiento en el Registro del Mercado de Valores, según lo establece la Resolución R-CNV-2016-41-MV, la cual requiere un aporte anual de DOP4,907,000.00, pagadero en cuatro cuotas trimestrales. Este gasto se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

La Compañía mantiene diversos contratos con una relacionada, la cual realiza facturaciones de manera mensual por concepto de servicios generales, planeamiento, estrategia y soporte de tecnología. Al 31 de diciembre de 2018, el importe a pagar mensual es de DOP1,997,482 (2017: DOP1,927,705). Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2018, el gasto por este concepto ascendió a DOP26,965,045 (2017: DOP25,402,647) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

25. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros

Los principales instrumentos financieros de la Compañía corresponden a los instrumentos financieros a valor razonable y costo amortizado, obligaciones con bancos e instituciones financieras, cuentas por pagar, y cuentas por pagar a relacionadas, acumulaciones y otras obligaciones. El principal propósito de estos pasivos financieros es financiar las operaciones de la Compañía y proporcionar garantías para soportar sus operaciones. Los principales activos financieros de la Compañía incluyen efectivo y equivalentes de efectivo, certificado financiero y otras cuentas por cobrar, que surgen directamente de sus operaciones.

Los principales riesgos que pueden tener un efecto de importancia relativa sobre éstos instrumentos financieros son el riesgo de mercado, el riesgo de liquidez, y el riesgo de crédito. La Administración de la Compañía con el soporte gerencial y de Consejo de Administración monitorea y administra estos riesgos.

Riesgo crédito

El riesgo de crédito es el riesgo de que una de las contrapartes no cumpla con las obligaciones derivadas de un instrumento financiero o contrato de compra y esto se traduzca en una pérdida financiera.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

25. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros (continuación)

Riesgo credito (continuación)

La Compañía negocia únicamente con terceras partes con historiales de crédito reconocido. Es política de la Compañía que todos los clientes que deseen negociar términos de crédito sean sujetos a procedimientos de verificación de crédito. Respecto a los riesgos de crédito de otros activos financieros, el cual comprende efectivo y equivalentes de efectivo y certificado financiero, la máxima exposición de la Compañía a raíz de fallos de la contraparte sería el valor registrado de estos activos. La Compañía solo negocia con entidades financieras de reconocida solvencia económica.

Al 31 de diciembre de 2018, la Compañía mantiene inversiones en instrumentos financieros, invertidos en títulos y valores de deuda, fondos de inversión, acciones, entre otros, los cuales son adquiridos en el mercado o directamente de la entidad emisora. La Compañía para manejar el riesgo de crédito, invierte en valores representativos de deuda del Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, Banco Central de la República Dominicana y fondos de inversión de calificación de riesgo igual o superior a BBB, que significa una buena calidad crediticia y la existencia de una baja expectativa de riesgo crediticio.

Riesgo de tipo de cambio

El riesgo de tipo de cambio representa el riesgo de que el valor razonable de los flujos de efectivo futuros de instrumentos financieros fluctúe como consecuencia de variaciones en los tipos de cambios de monedas extranjeras. La exposición de la Compañía al riesgo de tipo de cambio se relaciona principalmente con sus actividades operativas, es decir, cuando sus ingresos o gastos están denominados en una moneda extranjera. La siguiente tabla presenta un análisis de sensibilidad del efecto en los estados financieros de la Compañía, derivado de una razonable variación en el tipo de cambio del dólar estadounidense, euros, dólares canadienses y guaraníes:

	Variación en el Tipo de Cambio USD	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2018	+5%	183,907,034
	-5%	(183,907,034)
31 de diciembre de 2017	+5%	154,832,456
	-5%	(154,832,456)
	Variación en el Tipo de Cambio EUR	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2018	+5%	368,239
	-5%	(368,239)
31 de diciembre de 2017	+5%	3,543
	-5%	(3,543)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

25. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros (continuación)

Riesgo de tipo de cambio (continuación)

	Variación en el Tipo de Cambio PYG	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2018	+5%	62
	-5%	(62)
31 de diciembre de 2017	+5%	10,170,910
	-5%	(10,170,910)

Riesgo de liquidez

El riesgo de liquidez es el riesgo de que una entidad encuentre dificultad para cumplir con las obligaciones asociadas con pasivos financieros que se liquiden mediante la entrega de efectivo u otro activo financiero. La Compañía da seguimiento diario a su posición de liquidez, manteniendo activos líquidos mayores que los pasivos líquidos, considerando el vencimiento de sus activos financieros y efectúa periódicamente proyecciones de flujos de efectivo con el objetivo de detectar oportunamente los potenciales faltantes o excesos de efectivo para soportar sus operaciones.

Riesgo de liquidez (continuación)

La Compañía mantiene líneas de crédito abiertas con varios bancos y cuando lo requiere, negocia préstamos a largo plazo para minimizar el riesgo de liquidez. El siguiente cuadro resume los vencimientos de los pasivos financieros de la Compañía con base en los compromisos de pago, incluyendo los costos financieros:

	2018					
	A la demanda	Menos de 3 meses	De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	Total
Pasivos financieros a su valor razonable	-	2,167,428,405	1,975,846,828	-	-	4,143,275,233
Instrumentos financieros : su valor razonable derivados	-	50,451,354	90,660,394	-	-	141,111,748
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	30,014,384	723,370,890	698,427,397	-	1,451,812,671
Otras cuentas por pagar	-	31,572,619	-	-	-	31,572,619
Cuentas por pagar a relacionadas	1,615,094	-	-	-	-	1,615,094
Acumulaciones y otras obligaciones	-	73,073,394	-	-	-	73,073,394
	<u>1,615,094</u>	<u>2,352,540,156</u>	<u>2,789,878,112</u>	<u>698,427,397</u>	<u>-</u>	<u>5,842,460,759</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

25. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros (continuación)

	2017					Total
	A la demanda	Menos de 3 meses	De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable	-	3,100,645,864	524,198,747	-	-	3,624,844,611
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	815,473,481	8,071,290	-	-	823,544,771
Obligaciones con bancos	-	37,178,889	1,933,357,919	-	-	1,970,536,808
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	20,750,687	62,252,060	985,670,330	-	1,068,673,077
Otras cuentas por pagar	-	7,366,036	-	-	-	7,366,036
Cuentas por pagar a relacionadas	2,224,156	-	-	-	-	2,224,156
Acumulaciones y otras obligaciones	-	50,612,888	-	-	-	50,612,888
	<u>2,224,156</u>	<u>4,032,027,845</u>	<u>2,527,880,016</u>	<u>985,670,330</u>	<u>-</u>	<u>7,547,802,347</u>

Riesgo de tasa de interés

La Compañía presenta niveles de deuda aceptables sujetos a tasas de interés, sin embargo, no existe una exposición significativa a riesgo de cambio a la tasa de interés, ya que las mismas son tasas de interés fija. Adicionalmente, los ingresos y los flujos de caja operativos de la Compañía son sustancialmente independientes de los cambios en las tasas de interés del mercado.

El riesgo de tasa de interés es el riesgo de que el valor razonable o flujos de cajas futuros de un instrumento financiero puedan fluctuar como consecuencia de las variaciones en las tasas de interés del mercado. La exposición de la Compañía a dicho riesgo se refiere básicamente a obligaciones con bancos e instrumentos financieros a corto y largo plazo, los cuales no están sujetos a variaciones en las tasas de interés importantes, producto que están pactadas a tasas de interés fijas.

La Compañía administra este riesgo evaluando constantemente la evolución de las tasas de interés de mercado nacional e internacional con el fin de determinar con un buen grado de certeza los riesgos asociados al costo financiero de los pasivos y hasta donde las circunstancias se lo permitan, minimizar los efectos de este riesgo.

La siguiente tabla presenta un análisis de sensibilidad del efecto en los resultados integrales de la Compañía antes de impuesto sobre la renta, derivado de una variación razonable en las tasas de interés a las que están sujetas sus obligaciones financieras, basado el cambio en puntos básicos:

Variación de la Tasa de Interés en Puntos Básicos	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta	
	2018	2017
+0.12	(14,933,956)	(16,163,551)
-0.12	<u>14,933,956</u>	<u>16,163,551</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

26. Gestión de capital

El principal objetivo de la gestión de capital de la Compañía es asegurar que mantiene una razón de crédito sólida y razones financieras de capital saludables para soportar sus negocios y maximizar sus utilidades.

La Compañía administra su estructura de capital y solicita oportunamente a sus accionistas cualquier ajuste a ese capital considerando el entorno económico en el que se desarrolla la Compañía. Para mantener o ajustar su estructura de capital puede amortizar o suscribir nuevos préstamos. Estas políticas no tuvieron cambios significativos durante los años financieros 2018 y 2017.

La Compañía monitorea su capital utilizando como razón financiera preponderante la razón resultante de dividir el pasivo neto (Pasivos financieros a valor razonable, Instrumentos financieros derivados, acumulaciones y otras obligaciones por pagar, obligaciones con bancos y instrumentos financieros emitidos y el efectivo y equivalentes de efectivo) entre la sumatoria del pasivo neto y el patrimonio.

	31 de diciembre de	
	2018	2017
Pasivos financieros a valor razonable	4,143,275,233	3,624,844,611
Instrumentos financieros derivados	141,111,748	823,544,771
Obligaciones con bancos y obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	2,752,902,881
Otras cuentas por pagar	31,572,619	7,366,036
Cuentas por pagar a relacionadas	1,615,094	2,224,156
Acumulaciones y otras obligaciones	73,073,394	50,612,888
Menos - Efectivo en caja y bancos	1,501,082,632	(2,050,852,717)
Pasivo neto	5,891,730,720	5,210,642,626
Patrimonio	1,902,016,180	1,986,041,564
Capital neto	7,793,746,900	7,196,684,190
	0.76	0.72

27. Valores razonables

A continuación, se presenta una comparación del valor en libros y los valores razonables de los instrumentos financieros de la Compañía, excepto aquellos que están presentados a valor razonable y los que el valor en libros es aproximadamente similar al valor razonable:

	31 de diciembre de 2018		31 de diciembre de 2017	
	Valor en libros	Valor razonable	Valor en Libros	Valor razonable
Pasivos financieros				
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	(1,288,420,342)	(1,299,397,444)	(887,782,740)	(899,202,208)
	<u>(1,288,420,342)</u>	<u>(1,299,397,444)</u>	<u>(887,782,740)</u>	<u>(899,202,208)</u>

La Administración de la Compañía estima que el efectivo y equivalentes de efectivo, certificado financiero, inversiones en instrumentos financieros a costo amortizado, otras cuentas por cobrar y pagar, cuentas por pagar relacionadas, obligaciones con bancos y otras obligaciones, tienen un valor razonable muy próximo a su valor contable debido en gran parte a los vencimientos a corto plazo de los mismos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

27. Valores razonables (continuación)

El valor razonable de los activos financieros y de los pasivos financieros se determina con base en el importe al que el instrumento podría ser intercambiado en una transacción entre partes interesadas, distinta a una venta forzada o por liquidación. Para estimar el valor razonable de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos se utilizó el siguiente método:

- El valor razonable de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos se determinó utilizando el precio cotizado en el mercado activo al cierre de año, en el cual fueron transados.

28. Cambios en pasivos provenientes de actividades de financiamiento

2018					
	1ro. de enero de 2018	Flujo de efectivo		Movimiento en moneda extranjera	31 de diciembre de 2018
		Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados		
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (a)	875,000,000	400,000,000	-	-	1,275,000,000
Obligaciones con bancos (b)	1,860,241,252	2,097,331,000	(3,964,299,480)	6,727,228	-
	<u>2,735,241,252</u>	<u>2,497,331,000</u>	<u>(3,964,299,480)</u>	<u>6,727,228</u>	<u>1,275,000,000</u>
2017					
	1ro. de enero de 2017	Flujo de efectivo		Movimiento en moneda extranjera	31 de diciembre de 2017
		Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados		
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (a)	675,000,000	200,000,000	-	-	875,000,000
Obligaciones con bancos (b)	1,733,203,202	4,933,277,593	(4,815,120,762)	8,881,219	1,860,241,252
	<u>2,408,203,202</u>	<u>5,133,277,593</u>	<u>(4,815,120,762)</u>	<u>8,881,219</u>	<u>2,735,241,252</u>

(a) Al 31 de diciembre de 2018 y 2017, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos ascendentes a DOP13,420,342 (2017: DOP12,782,740).

(b) Al 31 de diciembre de 2017, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones con bancos ascendentes a DOP4,878,889.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 0 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

A continuación presentamos la composición detallada de los estados de cartera de inversión al 31 de diciembre de 2018 y 2017:

1 Equivalentes de efectivo DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participacion
N/A	Banco Multiple Bellbank	20,000,000	20,000,000	20,000,000	-	DOP	25.00%
N/A	Banco Multiple Lafise	50,000,000	50,000,000	50,000,000	-	DOP	62.50%
N/A	Banco Multiple Motor Credito	10,000,000	10,000,000	10,000,000	-	DOP	12.50%
Total		80,000,000	80,000,000	80,000,000	-		

Equivalentes de efectivo USD

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	USD	N/A
Total		-	-	-	-		

1 Certificado financiero DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
N/A	Banco Santa Cruz	848,976,109	848,976,109	848,976,109	-	DOP	100.00%
Total		848,976,109	848,976,109	848,976,109	-		

2 Acciones

Acciones euro (EU)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	EU	N/A	N/A
Total								

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
US74348A1604	Proshares UltraPro SQQQ	750	19,794.67	12,570.00	(7,224.67)	USD	N/A	1%
DO9014000119	Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	118.00	126,491.21	118,073.16	(8,418.05)	USD	N/A	9%
N/A	Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 días	2,977.45	30,813.04	31,356.77	543.73	USD	N/A	2%
N/A	Universal - Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	1,011.01	1,051,811.82	1,058,386.94	6,575.12	USD	N/A	78%
DO8013900121	JMMB Fondo de Inversion Cerrado	128.00	131,949.65	133,679.10	1,729.45	USD	N/A	10%
Total		4,984.46	1,360,860.39	1,354,065.97	(6,794.42)			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 1 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2018

2 Acciones (continuación)

Acciones en pesos dominicanos (DOP)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones (Cuotas)	Valor de adquisición	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	UNIVERSAL - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	291.82	3,599,017.38	3,813,459.99	214,442.61	DOP	N/A	0%
N/A	BHD LIQUIDEZ - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	387.46	473,186.68	494,097.13	20,910.45	DOP	N/A	0%
N/A	BHD- Fondo Mutuo Renta Fija Plazo 30 días	366.29	418,870.88	441,907.27	23,036.39	DOP	N/A	0%
N/A	RESERVAS - Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	173.61	193,721.94	195,980.86	2,258.92	DOP	N/A	0%
N/A	JMMB - Fondo Abierto Money Market	17.20	20,902.86	21,424.18	521.32	DOP	N/A	0%
N/A	UNIVERSAL - Fondo Abierto Liquidez	243.28	250,135.89	256,718.06	6,582.17	DOP	N/A	0%
N/A	JMM - Fondo Mutuo Plazo 90 días	32.16	33,523.71	33,988.52	464.81	DOP	N/A	0%
DO8013400122	PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	16,217.00	16,286,294.82	20,444,934.07	4,158,639.25	DOP	N/A	15%
DO8012152021	PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	905.00	1,100,154.20	972,160.05	(127,994.15)	DOP	N/A	1%
DO8013300124	GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	91,688.00	137,471,282.55	143,011,733.32	5,540,450.77	DOP	N/A	83%
Total		110,321.82	159,847,090.91	169,686,403.45	9,839,312.54			

3. Títulos valores de deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002243124	BCRD 15.5% 15-MAR-19	2,670,000.00	-	2,696,395.62	N/A	DOP	OTC	0.14%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	5,370,000.00	-	5,493,026.70	N/A	DOP	OTC	0.29%
DO1002260524	BCRD 12% 22-FEB-19	1,970,000.00	-	1,974,824.53	N/A	DOP	OTC	0.10%
DO1002249022	BCRD 14% 18-OCT-19	17,290,000.00	-	17,770,904.06	N/A	DOP	OTC	0.92%
DO1002251523	BCRD 13% 20-MAR-20	360,000.00	-	370,717.56	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002240229	BCRD 15.5% 11-ENE-19	400,000.00	-	400,599.60	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002243223	BCRD 15.5% 19-ABR-19	1,030,000.00	-	1,045,268.72	N/A	DOP	OTC	0.05%
DO1002213325	BCRD 12% 07-ENE-22	290,000.00	-	300,289.49	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002253727	BCRD 13% 07-AGO-20	20,000.00	-	20,751.92	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO1002213424	BCRD 10.5% 10-ENE-20	40,000.00	-	40,086.20	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO1002249923	BCRD 13% 03-ENE-20	5,000,000.00	-	5,127,735.00	N/A	DOP	OTC	0.27%
DO1002216112	BCRD 11% 03-FEB-23	21,250,000.00	-	21,392,885.00	N/A	DOP	OTC	1.13%
DO1002218720	BCRD 10.50% 14-FEB-2025	81,000,000.00	-	78,468,588.00	N/A	DOP	OTC	4.31%
DO1002217425	BCRD 10.50% 04-OCT-2024	2,260,000.00	-	2,199,233.12	N/A	DOP	OTC	0.12%
DO1002213721	BCRD 10.5% 17-ENE-20	6,880,000.00	-	6,894,695.68	N/A	DOP	OTC	0.37%
DO1002213820	BCRD 12% 20-ENE-22	260,000.00	-	269,261.72	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1002257728	BCRD 14% 08-ENE-21	320,000.00	-	340,323.52	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	35,140,000.00	-	35,131,952.94	N/A	DOP	OTC	1.87%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 2 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2018

3. Títulos valores de deuda (continuación)

En DOP (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion	Porcentaje de participación
DO1002215825	BCRD 11% 14-OCT-22	1,740,000.00	-	1,754,245.38	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO1002215726	BCRD 11% 30-SEPT-22	100,000.00	-	100,846.30	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1002214521	BCRD 11% 15-JUL-22	230,000.00	-	231,966.27	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1002260722	BCRD 12% 05-ABR-19	470,000.00	-	471,983.40	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002216625	BCRD 11% 15-SEPT-2023	2,040,000.00	-	2,045,542.68	N/A	DOP	OTC	0.11%
DO1002218621	NOTAS BCRD 10.50% 17-ENE-2025	10,000,000.00	-	9,698,450.00	N/A	DOP	OTC	0.53%
DO1002216427	BCRD 11% 23-JUN-23	2,470,000.00	-	2,481,310.13	N/A	DOP	OTC	0.13%
DO1002218423	NOTAS BCRD 9.50% 15 - ENE- 202	150,020,000.00	-	147,492,763.08	N/A	DOP	OTC	7.98%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	478,620,000.00	-	466,712,891.6400	N/A	DOP	OTC	25.45%
DO1002216526	BCRD 10% 10-SEPT-2021	80,010,000.00	-	78,997,393.44	N/A	DOP	OTC	4.25%
DO1002216724	BCRD 11% 05-ENE-2024	2,900,000.00	-	2,902,154.70	N/A	DOP	OTC	0.15%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	64,200,000.00	-	65,259,107.40	N/A	DOP	OTC	3.41%
DO1005205013	MHRD 10.38% 06-MAR-26	2,100,000.00	-	2,100,772.80	N/A	DOP	OTC	0.11%
DO1005205310	MHRD 11% 06-NOV-26	10,500,000.00	-	10,791,511.50	N/A	DOP	OTC	0.56%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	4,000,000.00	-	4,109,500.00	N/A	DOP	OTC	0.21%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	20,900,000.00	-	21,317,143.10	N/A	DOP	OTC	1.11%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	100,400,000.00	-	106,217,577.60	N/A	DOP	OTC	5.34%
DO1005241125	MHRD 16.95% 04-FEB-22	73,000,000.00	-	86,774,078.00	N/A	DOP	OTC	3.88%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	25,800,000.00	-	26,419,741.80	N/A	DOP	OTC	1.37%
DO1005234625	MHRD 15.95% 04-JUN-21	5,100,000.00	-	5,782,390.20	N/A	DOP	OTC	0.27%
DO1005204115	MHRD 10.4% 10-MAY-19	95,800,000.00	-	96,099,470.80	N/A	DOP	OTC	5.09%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	17,400,000.00	-	17,370,176.40	N/A	DOP	OTC	0.93%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	65,800,000.00	-	68,405,877.40	N/A	DOP	OTC	3.50%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	19,200,000.00	-	20,099,980.80	N/A	DOP	OTC	1.02%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	137,200,000.00	-	140,793,405.20	N/A	DOP	OTC	7.29%
DO1005224329	MHRD 16% 10-JUL-20	14,700,000.00	-	16,023,029.40	N/A	DOP	OTC	0.78%
DO2013000529	CONSORCIO REMIX 12% 27-ABR-19	2,072,430.00	-	2,072,473.52	N/A	DOP	OTC	0.11%
DO2009308019	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E1	3,101,748.00	-	3,153,457.24	N/A	DOP	OTC	0.16%
DO2009308613	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	150,000.00	-	150,418.50	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO2015200127	COMIRDOM 12.00% 28-AGOS-2028 [	140,000,000.00	-	139,984,614.00	N/A	DOP	OTC	7.44%
DO2009305114	EGE HAINA 12% 27-JUN-26 [E1]	29,600.00	-	30,265.62	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO2009308811	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	15,500,000.00	-	15,543,245.00	N/A	DOP	OTC	0.82%
DO2009308415	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E1	200,000.00	-	203,334.20	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO2015200226	COMIRDOM 12.00% 18-SEP-2028	6,061,464.00	-	6,061,328.83	N/A	DOP	OTC	0.32%
DO1014200211	RD VIAL 28-AGO-2028 10.5S	50,000,000.00	-	49,984,575.00	N/A	DOP	OTC	2.66%
DO2015000113	BANCO CONFISA 9.25% 04-DIC-202	100,000.00	-	99,980.21	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1005251025	MHRD 18.5% 04-FEB-28	1,000,000.00	-	1,353,490.00	N/A	DOP	OTC	0.05%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	96,400,000.00	-	108,135,446.80	N/A	DOP	OTC	5.13%
Total		1,880,865,242.00		1,907,163,477.72				100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 3 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2018

3. Títulos valores de deuda

Deuda en USD

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion	Porcentaje de participación
USP3579EAG28	MH DOMREP 8.63% 20-ABR-27	82,000.00	-	94,031.04	N/A	USD	OTC	0.30%
USP3579EAT49	MHRD 6.6% 28-ENE-24	8,000.00	-	8,349.76	N/A	USD	OTC	0.03%
USP3579EAY34	MH DOMREP 7.45% 30-ABR-44 [REG	12,000.00	-	8,339.36	N/A	USD	OTC	0.03%
USP3579EBK21	MHRD 6.88% 29-ENE-26	137,000.00	-	144,044.54	N/A	USD	OTC	0.50%
DO1005205716	MHRD 6.00% 05-MAR-2027	901,000.00	-	965,187.24	N/A	USD	OTC	3.27%
USP3579EBY25	MH DOMREP 6.50% 15-FEB-2048	20,000.00	-	18,931.20	N/A	USD	OTC	0.07%
USP3579EBV85	MH DOMREP 5.95% 25-ENE-27	100,000.00	-	99,728.00	N/A	USD	OTC	0.36%
USP3579EAH01	MH DOMREP 7.5% 06-MAY-21	15,784,000.00	-	16,320,024.64	N/A	USD	OTC	57.21%
USP3579EBD87	MH DOMREP 5.5% 27-ENE-25	112,000.00	-	111,319.04	N/A	USD	OTC	0.41%
DO1005244525	MH CDEEE 7% 31-JUL-23	195,000.00	-	213,729.75	N/A	USD	OTC	0.71%
DO2014300910	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E9]	3,655.00	-	3,895.62	N/A	USD	OTC	0.01%
DO2009360416	EGE HAINA 6% 17-MAR-20 [E7]	2,000.00	-	1,347.40	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014303211	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E32]	147,008.00	-	157,064.52	N/A	USD	OTC	0.53%
DO2009303911	EGE HAINA 5.75% 27-MAY-20 [E9]	8,000.00	-	8,089.72	N/A	USD	OTC	0.03%
DO2014304110	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E41]	318,220.00	-	334,693.29	N/A	USD	OTC	1.15%
DO2014304813	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E48]	1,000.00	-	1,045.86	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014305216	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E52]	552,579.00	-	577,919.17	N/A	USD	OTC	2.00%
DO2014305117	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E51]	722,419.00	-	755,547.69	N/A	USD	OTC	2.62%
DO2009904510	CEPM 5.50% 20-NOV-2027	915,724.00	-	962,066.96	N/A	USD	OTC	3.32%
DO2014304318	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E43]	932,741.00	-	981,026.20	N/A	USD	OTC	3.38%
DO2014304615	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E46]	20,000.00	-	21,035.34	N/A	USD	OTC	0.07%
DO2014304516	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E45]	29,792.00	-	31,334.24	N/A	USD	OTC	0.11%
DO2014304219	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E42]	772,812.00	-	812,818.16	N/A	USD	OTC	2.80%
DO2013001022	CONSORCIO REMIX 6.55% 15-DIC-2	48,861.00	-	48,860.00	N/A	USD	OTC	0.18%
DO2014304714	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E47]	363,334.00	-	382,142.71	N/A	USD	OTC	1.32%
DO2014301017	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E10]	38,711.00	-	41,259.42	N/A	USD	OTC	0.14%
DO2014300118	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E1]	26,072.00	-	27,788.37	N/A	USD	OTC	0.09%
DO2014300316	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E03]	63,000.00	-	67,147.42	N/A	USD	OTC	0.23%
DO2014303716	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E37]	2,307.00	-	2,464.82	N/A	USD	OTC	0.01%
DO2014302510	DPP 6.25% 09-MAY-2027 [E25]	68,436.00	-	73,042.63	N/A	USD	OTC	0.25%
DO2014303518	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E35]	5,700.00	-	6,089.93	N/A	USD	OTC	0.02%
DO2009304018	EGE HAINA 5.75% 27-MAY-20 [E10]	10,000.00	-	6,741.44	N/A	USD	OTC	0.02%
DO2014302015	DPP 6.25% 31-MAR-2027 [E20]	63,007.00	-	67,192.43	N/A	USD	OTC	0.23%
DO2014302411	DPP 6.25% 09-MAY-2027 [E24]	222,320.00	-	237,285.03	N/A	USD	OTC	0.81%
DO2014303310	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E33]	16,000.00	-	17,094.53	N/A	USD	OTC	0.06%
DO2014303419	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E34]	22,000.00	-	23,504.98	N/A	USD	OTC	0.08%
USP10475AA22	BANRESERVAS 7% 01-FEB-23	681,000.00	-	681,912.54	N/A	USD	OTC	2.47%
USP78954AC19	PETROTRIN 9.75% 14-AGOS-2019	2,615,000.00	-	2,499,417.00	N/A	USD	OTC	9.48%
USP3699PAA59	COSTAR 9.995% 01-AGOST-2020	1,573,000.00	-	1,629,234.75	N/A	USD	OTC	5.70%
Total		27,595,698.00	-	28,442,746.74	-			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 4 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2018

4 Contratos de compra spot:

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

b) Acciones DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

b) Acciones USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

d) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

e) Oro

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 5 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

5 Contratos de Venta spot:

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

b) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

c) Acciones DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

d) Acciones USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

d) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

e) Oro

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 6 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	47,100,000.00	47,853,808.24	48,305,559.52	451,751.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	15-Jan-19	61,100,000.00	62,225,724.91	62,630,133.98	404,409.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	7-Dec-18	7-Mar-19	60,200,000.00	60,875,596.69	61,180,701.79	305,105.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	38,000,000.00	38,709,704.49	38,952,449.83	242,745.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	8-Jan-19	19,300,000.00	19,560,727.47	19,795,737.22	235,009.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Sep-18	25-Mar-19	8,400,000.00	8,333,573.05	8,566,967.21	233,394.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Jan-19	23,600,000.00	23,976,323.29	24,206,186.44	229,863.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	27-Dec-19	5,600,000.00	5,427,351.83	5,608,031.93	180,680.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Dec-18	2-May-19	10,000,000.00	9,989,460.10	10,168,387.76	178,927.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	10-Oct-18	10-Jan-19	24,600,000.00	24,910,610.47	25,077,318.75	166,708.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	17-Jan-19	12,800,000.00	12,964,595.92	13,118,902.19	154,306.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	25-Nov-19	5,300,000.00	5,133,661.14	5,286,872.53	153,211.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	43,000,000.00	43,903,124.10	44,052,462.21	149,338.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Sep-18	25-Mar-19	4,300,000.00	4,251,296.09	4,400,455.75	149,159.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jan-19	37,300,000.00	38,080,209.42	38,228,397.58	148,188.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jan-19	37,300,000.00	38,080,209.42	38,228,397.58	148,188.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	6-Feb-19	11,800,000.00	11,941,396.46	12,088,295.05	146,898.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	13,000,000.00	13,184,457.12	13,331,238.94	146,781.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	4-Jan-19	5,000,000.00	4,986,830.67	5,129,692.24	142,861.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	7-May-19	4,900,000.00	4,839,260.50	4,981,535.22	142,274.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	26-Feb-19	64,900,000.00	66,305,767.10	66,439,803.53	134,036.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	5,300,000.00	5,278,681.19	5,409,176.78	130,495.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	11,300,000.00	11,455,148.64	11,581,864.67	126,716.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	2-May-19	4,000,000.00	3,945,994.85	4,068,065.74	122,070.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	8-Jan-19	4,800,000.00	4,804,179.75	4,923,234.63	119,054.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	18-Jan-19	9,800,000.00	9,925,261.92	10,042,920.62	117,658.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	6,000,000.00	6,030,117.91	6,146,876.21	116,758.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	8-Jan-19	6,500,000.00	6,552,697.33	6,666,958.13	114,260.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Sep-18	11-Mar-19	6,700,000.00	6,729,230.99	6,840,232.90	111,001.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	17,300,000.00	17,609,531.16	17,720,001.47	110,470.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	11,300,000.00	11,473,395.21	11,582,122.17	108,726.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	14,100,000.00	14,357,934.20	14,463,061.11	105,126.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-Dec-18	18-Jan-19	7,100,000.00	7,397,716.44	7,501,638.60	103,922.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-Mar-19	6,000,000.00	6,022,166.81	6,120,616.63	98,449.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-Dec-18	15-Jan-19	7,300,000.00	7,342,605.56	7,439,614.70	97,009.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	10,000,000.00	10,113,522.92	10,208,294.43	94,771.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	4-Jan-19	15,700,000.00	16,012,867.49	16,107,233.65	94,366.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	14,200,000.00	14,458,119.59	14,552,351.20	94,231.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	7,300,000.00	7,379,531.28	7,473,668.78	94,137.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	14,100,000.00	14,371,596.57	14,465,647.70	94,051.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	1-Nov-18	15-Jan-19	9,800,000.00	9,894,800.68	9,987,427.96	92,627.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 7 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	19-Oct-18	17-Jan-19	10,000,000.00	10,156,438.51	10,248,657.98	92,219.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Sep-18	25-Mar-19	4,100,000.00	4,104,623.81	4,194,785.00	90,161.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,400,000.00	9,540,295.98	9,630,073.13	89,777.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	25,700,000.00	26,241,223.55	26,330,642.33	89,418.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	9-Jan-19	3,700,000.00	3,705,603.51	3,794,754.15	89,150.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	2-Sep-19	4,500,000.00	4,431,830.06	4,520,313.48	88,483.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	5,200,000.00	5,244,311.87	5,329,163.39	84,851.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	10-Jan-19	4,900,000.00	4,944,410.72	5,025,241.86	80,831.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	16-Jan-19	2,800,000.00	2,791,586.62	2,869,970.19	78,383.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28-Dec-18	29-Jan-19	5,200,000.00	5,411,605.57	5,489,787.82	78,182.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	15-Jan-19	6,300,000.00	6,380,031.30	6,457,637.03	77,605.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	1-Apr-19	1,600,000.00	1,554,078.34	1,630,960.47	76,882.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	3,000,000.00	2,995,849.03	3,072,068.74	76,219.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Sep-18	23-Jan-19	4,100,000.00	4,124,263.88	4,200,300.28	76,036.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	5,900,000.00	5,950,231.24	6,025,263.73	75,032.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	9,400,000.00	9,565,663.88	9,640,599.99	74,936.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	16,400,000.00	16,750,997.08	16,825,390.56	74,393.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	2,400,000.00	2,385,904.13	2,460,052.20	74,148.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	15-Jan-19	4,800,000.00	4,846,095.10	4,920,206.93	74,111.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Oct-18	8-Jan-19	5,700,000.00	5,772,843.33	5,846,409.44	73,566.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	4,900,000.00	4,952,405.03	5,025,743.29	73,338.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	7,800,000.00	7,919,287.67	7,990,911.75	71,624.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Feb-19	6,500,000.00	6,584,571.26	6,655,093.99	70,522.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Jan-19	6,600,000.00	6,699,799.46	6,769,874.30	70,074.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	3-Jan-19	2,200,000.00	2,189,090.27	2,257,620.20	68,529.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	12-Feb-19	4,600,000.00	4,642,281.25	4,710,505.40	68,224.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	15-Jan-19	3,800,000.00	3,827,070.59	3,895,163.82	68,093.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	9,400,000.00	9,572,650.18	9,640,599.99	67,949.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	2,900,000.00	2,907,542.86	2,974,079.27	66,536.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Oct-18	26-Feb-19	5,800,000.00	5,870,254.02	5,936,182.07	65,928.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	19-Mar-19	4,400,000.00	4,437,911.37	4,502,689.93	64,778.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	1,100,000.00	1,063,608.72	1,128,099.03	64,490.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	22-Jan-19	2,700,000.00	2,703,769.90	2,766,084.84	62,314.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	19-Feb-19	2,500,000.00	2,497,533.38	2,559,532.51	61,999.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	10-Jan-19	13,200,000.00	13,475,124.35	13,536,990.56	61,866.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	8-Jan-19	3,100,000.00	3,117,838.02	3,179,626.19	61,788.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	13-Jun-19	1,000,000.00	958,020.54	1,019,673.30	61,652.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	22-Jan-19	3,900,000.00	3,933,934.12	3,995,455.87	61,521.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	14-May-19	1,000,000.00	959,479.45	1,020,872.76	61,393.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	29-Jan-19	4,100,000.00	4,136,772.58	4,198,112.31	61,339.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	3,700,000.00	3,734,948.26	3,795,927.95	60,979.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 8 de 163

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	16-Oct-18	12-Apr-19	1,000,000.00	961,386.30	1,022,148.64	60,762.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	4-Feb-19	2,500,000.00	2,500,568.16	2,561,317.37	60,749.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	16-Apr-19	800,000.00	757,154.55	817,591.48	60,436.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	10-Apr-19	1,000,000.00	962,212.34	1,022,228.26	60,015.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	15-Jan-19	1,000,000.00	965,044.51	1,025,021.75	59,977.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	3,100,000.00	3,113,788.23	3,173,259.79	59,471.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	4,100,000.00	4,097,427.82	4,156,791.52	59,363.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	4-Jan-19	3,700,000.00	3,737,192.54	3,796,038.72	58,846.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	15-Jan-19	1,000,000.00	966,321.22	1,025,021.75	58,700.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	12-Apr-19	1,500,000.00	1,468,662.19	1,527,339.83	58,677.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	13-Feb-19	1,000,000.00	964,513.69	1,022,759.25	58,245.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	29-Jan-19	3,800,000.00	3,832,810.50	3,890,933.36	58,122.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	18-Jan-19	1,000,000.00	966,887.67	1,024,839.11	57,951.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	30-Oct-18	3-Jan-19	7,300,000.00	7,388,111.99	7,445,700.70	57,588.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	15-Mar-19	1,000,000.00	962,849.31	1,020,416.04	57,566.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Sep-18	25-Mar-19	7,100,000.00	7,182,329.68	7,239,403.90	57,074.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	800,000.00	764,369.86	820,952.80	56,582.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,700,000.00	1,685,895.27	1,742,182.89	56,287.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	28-May-19	200,000.00	148,029.78	204,062.68	56,032.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-May-19	300,000.00	250,709.74	306,213.63	55,503.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Oct-18	8-Jan-19	4,100,000.00	4,150,246.33	4,205,312.05	55,065.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	28-Feb-19	11,500,000.00	11,713,094.62	11,767,944.00	54,849.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	12-Jul-19	1,000,000.00	956,332.19	1,011,094.24	54,762.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	15-Apr-19	700,000.00	660,904.03	715,634.53	54,730.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	31-May-19	500,000.00	455,521.27	510,207.90	54,686.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	1,300,000.00	1,276,653.33	1,331,018.80	54,365.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	9,400,000.00	9,591,919.86	9,646,195.40	54,275.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Sep-18	25-Mar-19	6,700,000.00	6,777,597.95	6,831,550.16	53,952.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Jan-19	900,000.00	869,593.11	923,333.83	53,740.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Aug-18	5-Feb-19	400,000.00	356,053.13	409,791.75	53,738.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jun-19	2,500,000.00	2,479,472.74	2,532,640.45	53,167.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	4,800,000.00	4,866,690.50	4,919,839.51	53,149.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Sep-18	10-Jan-19	1,000,000.00	972,835.63	1,025,529.59	52,693.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	30-Apr-19	400,000.00	356,742.18	408,642.72	51,900.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Feb-19	1,800,000.00	1,790,798.38	1,842,695.79	51,897.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Sep-18	20-Mar-19	600,000.00	560,290.46	612,015.14	51,724.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	28-May-19	300,000.00	254,602.07	306,159.35	51,557.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,100,000.00	1,076,955.58	1,128,155.32	51,199.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	12-Aug-19	1,000,000.00	954,938.36	1,006,062.30	51,123.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-Jan-19	29,500,000.00	30,155,088.94	30,205,930.00	50,841.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	10,300,000.00	10,501,925.69	10,552,747.70	50,822.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 9 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	22-Oct-18	18-Jan-19	700,000.00	666,644.19	717,369.43	50,725.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	972,779.20	1,023,486.62	50,707.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	972,779.20	1,023,486.62	50,707.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	972,779.20	1,023,486.62	50,707.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	26-Feb-19	600,000.00	562,990.17	613,144.78	50,154.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	11-Sep-19	1,000,000.00	953,232.88	1,003,355.50	50,122.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	3,200,000.00	3,231,475.77	3,281,535.74	50,059.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-Dec-18	18-Jan-19	7,100,000.00	7,451,738.52	7,501,638.60	49,900.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Apr-19	300,000.00	256,788.03	306,601.03	49,812.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	31-May-19	500,000.00	460,321.10	510,096.73	49,775.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Nov-18	21-May-19	300,000.00	256,846.31	306,177.95	49,331.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	6,500,000.00	6,606,450.98	6,655,593.89	49,142.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Oct-19	1,000,000.00	951,243.15	1,000,194.29	48,951.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	7,500,000.00	7,634,783.47	7,683,568.99	48,785.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	9-Jan-19	5,400,000.00	5,489,964.34	5,538,289.84	48,325.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	10-Oct-19	1,000,000.00	952,811.65	1,000,736.46	47,924.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	500,000.00	465,470.18	512,919.00	47,448.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	7-Mar-19	1,300,000.00	1,283,785.84	1,331,036.35	47,250.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	18-Feb-19	1,000,000.00	975,384.04	1,022,368.91	46,984.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	19-Feb-19	800,000.00	770,954.77	817,832.66	46,877.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	7-Jun-19	600,000.00	565,168.15	611,948.07	46,779.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Jan-19	2,400,000.00	2,411,824.71	2,458,367.69	46,542.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Aug-18	6-Feb-19	2,400,000.00	2,412,198.64	2,458,636.28	46,437.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	9,400,000.00	9,548,520.55	9,594,849.05	46,328.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	4,700,000.00	4,770,434.25	4,816,623.28	46,189.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Aug-18	4-Feb-19	600,000.00	568,014.42	614,107.04	46,092.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	5-Feb-19	4,100,000.00	4,153,928.56	4,199,942.79	46,014.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-Nov-18	1-Mar-19	200,000.00	162,906.56	208,675.30	45,768.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Sep-18	4-Mar-19	900,000.00	873,471.57	919,147.98	45,676.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Mar-19	2,000,000.00	2,002,289.38	2,047,777.74	45,488.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	12-Feb-19	1,600,000.00	1,593,066.29	1,638,436.66	45,370.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Aug-18	15-Feb-19	600,000.00	568,276.97	613,640.99	45,364.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	1,700,000.00	1,698,380.42	1,743,625.22	45,244.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	15-Jan-19	1,200,000.00	1,184,994.74	1,230,026.10	45,031.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	600,000.00	569,937.53	614,685.52	44,747.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	6,400,000.00	6,489,474.34	6,533,953.81	44,479.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	500,000.00	467,556.00	511,917.21	44,361.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	1,900,000.00	1,901,198.98	1,945,545.37	44,346.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	1-Feb-19	3,000,000.00	3,029,402.71	3,073,734.43	44,331.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	700,000.00	673,565.31	717,870.71	44,305.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	7-Dec-18	7-Mar-19	14,000,000.00	14,696,386.44	14,740,623.28	44,236.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 10 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	12-Dec-18	12-Mar-19	1,200,000.00	1,184,534.69	1,228,560.80	44,026.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Apr-18	3-Apr-19	3,100,000.00	3,115,639.47	3,159,519.31	43,879.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	12-Feb-19	400,000.00	366,005.82	409,658.49	43,652.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Aug-18	6-Feb-19	2,600,000.00	2,619,938.32	2,663,522.64	43,584.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Aug-18	7-Feb-19	1,800,000.00	1,800,429.37	1,843,891.56	43,462.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24-Oct-18	22-Jan-19	700,000.00	673,764.39	717,133.11	43,368.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	263,640.94	306,844.13	43,203.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	5-Jul-19	300,000.00	261,666.06	304,588.25	42,922.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	300,000.00	263,283.00	306,189.94	42,906.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	10-Jan-19	500,000.00	470,288.93	512,859.88	42,570.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	28-Feb-19	1,000,000.00	979,073.26	1,021,587.99	42,514.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	1,900,000.00	1,904,241.46	1,946,127.33	41,885.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	9-Dec-19	700,000.00	655,317.49	697,063.01	41,745.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	30-Nov-18	3-May-19	1,000,000.00	982,431.04	1,024,076.03	41,644.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-May-19	3,700,000.00	3,715,110.68	3,756,617.90	41,507.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Sep-18	4-Mar-19	300,000.00	265,911.46	307,166.66	41,255.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	3,800,000.00	3,851,736.30	3,892,821.68	41,085.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Aug-18	26-Feb-19	200,000.00	163,703.33	204,663.13	40,959.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Sep-18	11-Mar-19	300,000.00	266,323.33	307,089.66	40,766.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	1,900,000.00	1,903,918.88	1,944,273.63	40,354.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	22-Jan-19	1,900,000.00	1,906,270.87	1,946,563.75	40,292.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	600,000.00	572,100.00	612,379.88	40,279.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	10-May-19	300,000.00	266,169.69	306,366.87	40,197.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Apr-19	500,000.00	470,733.15	510,918.50	40,185.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	3-Jan-19	700,000.00	678,454.87	718,333.70	39,878.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	1,900,000.00	1,908,755.95	1,948,411.85	39,655.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	15,000,000.00	15,353,210.32	15,392,865.00	39,654.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,900,000.00	1,906,915.08	1,946,504.14	39,589.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	4,100,000.00	4,161,006.53	4,200,479.67	39,473.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Aug-18	1-Feb-19	2,000,000.00	2,009,909.30	2,049,339.37	39,430.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	31-May-19	1,000,000.00	980,890.12	1,020,193.46	39,303.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	29-Nov-18	28-Feb-19	600,000.00	592,818.08	632,061.87	39,243.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Jan-19	9,100,000.00	9,296,782.99	9,335,930.91	39,147.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	28-Mar-19	500,000.00	472,372.26	511,504.04	39,131.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	1,900,000.00	1,908,350.02	1,947,393.17	39,043.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Sep-18	14-Mar-19	200,000.00	165,738.23	204,746.64	39,008.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,900,000.00	1,908,193.20	1,947,096.85	38,903.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	10-Oct-19	9,600,000.00	9,572,241.20	9,610,939.02	38,697.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Jan-19	1,000,000.00	986,344.44	1,024,943.78	38,599.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	500,000.00	474,135.27	512,346.52	38,211.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	500,000.00	474,146.23	512,226.59	38,080.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 11 de 163

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	9,800,000.00	10,007,239.72	10,045,213.15	37,973.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	4,500,000.00	4,570,987.95	4,608,658.06	37,670.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-Dec-18	19-Feb-19	4,700,000.00	4,923,587.71	4,961,194.13	37,606.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-Jan-19	300,000.00	270,051.33	307,587.74	37,536.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	475,032.19	512,556.34	37,524.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	8-Feb-19	1,100,000.00	1,089,323.11	1,126,647.35	37,324.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Oct-18	10-Jan-19	2,400,000.00	2,423,996.15	2,461,306.98	37,310.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	475,260.28	512,556.34	37,296.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	31-Jan-19	600,000.00	577,022.56	614,290.85	37,268.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Jan-19	5,500,000.00	5,603,891.91	5,641,140.43	37,248.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	1,900,000.00	1,910,439.38	1,947,541.33	37,101.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	475,662.00	512,646.24	36,984.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Sep-18	13-Sep-19	700,000.00	665,402.74	702,222.47	36,819.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	800,000.00	779,580.25	816,395.35	36,815.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,900,000.00	1,911,901.76	1,948,657.54	36,755.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	7-Jan-19	4,700,000.00	4,784,224.83	4,820,921.81	36,696.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	3,000,000.00	3,033,155.16	3,069,795.58	36,640.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	28-Feb-19	1,800,000.00	1,805,497.15	1,841,786.21	36,289.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Jan-19	4,700,000.00	4,783,524.41	4,819,755.62	36,231.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	9-Apr-19	1,200,000.00	1,186,399.39	1,222,497.82	36,098.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	27-Nov-18	29-Jan-19	1,000,000.00	982,475.06	1,018,347.18	35,872.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	7,500,000.00	7,655,636.98	7,691,471.91	35,834.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Jan-19	1,900,000.00	1,913,135.27	1,948,883.29	35,748.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Jan-19	4,000,000.00	4,067,273.94	4,102,912.18	35,638.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-Dec-18	18-Jan-19	1,900,000.00	1,971,845.36	2,007,480.75	35,635.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	3-Jan-19	700,000.00	682,739.64	718,333.70	35,594.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Jan-19	1,200,000.00	1,195,368.86	1,230,873.65	35,504.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	31-Jan-19	500,000.00	476,879.64	512,358.63	35,478.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	14-Feb-19	300,000.00	272,048.88	307,195.94	35,147.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	3-Jan-19	3,300,000.00	3,351,305.82	3,386,430.30	35,124.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	4,700,000.00	4,785,297.69	4,820,299.99	35,002.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	31-Jan-19	200,000.00	170,070.55	204,925.72	34,855.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	29-Nov-18	28-Feb-19	400,000.00	372,511.32	407,337.07	34,825.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Jun-19	800,000.00	781,220.56	815,770.67	34,550.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-May-19	1,100,000.00	1,083,528.24	1,118,015.68	34,487.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	500,000.00	477,366.43	511,723.37	34,356.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	1,000,000.00	987,723.36	1,022,067.08	34,343.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Jan-19	800,000.00	785,849.85	819,830.25	33,980.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	14-Jun-19	1,000,000.00	985,656.63	1,019,633.26	33,976.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	1-Feb-19	2,000,000.00	2,015,214.29	2,049,156.29	33,942.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	500,000.00	477,800.67	511,683.10	33,882.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 12 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	14-Nov-18	12-Feb-19	500,000.00	478,131.84	512,011.46	33,879.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-Dec-18	21-Mar-19	4,700,000.00	4,926,217.84	4,960,008.45	33,790.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	478,280.82	512,036.70	33,755.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	478,280.82	512,036.70	33,755.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	6-May-19	200,000.00	170,505.49	204,238.42	33,732.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	31-Jan-19	1,900,000.00	1,913,289.43	1,946,962.79	33,673.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	600,000.00	581,347.28	615,013.05	33,665.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Aug-18	19-Feb-19	500,000.00	478,250.62	511,906.50	33,655.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	18-Feb-19	500,000.00	478,383.74	511,930.31	33,546.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	2-Jan-19	1,200,000.00	1,198,110.28	1,231,429.20	33,318.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	19-Feb-19	3,700,000.00	3,754,976.46	3,788,108.11	33,131.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	5-Mar-19	1,600,000.00	1,605,200.16	1,638,311.22	33,111.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Sep-18	25-Jan-19	2,400,000.00	2,425,315.53	2,458,351.72	33,036.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Aug-18	2-Aug-19	1,200,000.00	1,176,179.36	1,209,078.48	32,899.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Feb-19	1,000,000.00	989,479.50	1,022,368.91	32,889.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Feb-19	1,000,000.00	989,479.50	1,022,368.91	32,889.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	30-Jan-19	2,800,000.00	2,834,166.82	2,866,905.06	32,738.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	9,800,000.00	10,004,845.95	10,037,570.31	32,724.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	7-Feb-19	500,000.00	479,493.15	512,137.67	32,644.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Jan-19	1,900,000.00	1,916,617.13	1,949,260.30	32,643.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	23-Jan-19	1,600,000.00	1,606,444.03	1,639,036.59	32,592.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	1,700,000.00	1,708,819.05	1,741,211.18	32,392.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	1,000,000.00	988,324.66	1,020,599.39	32,274.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	25-Jan-19	600,000.00	582,387.76	614,566.52	32,178.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	900,000.00	888,483.69	920,553.58	32,069.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	600,000.00	581,751.59	613,821.40	32,069.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	10-Jan-19	1,400,000.00	1,403,878.08	1,435,741.42	31,863.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	4-Jan-19	400,000.00	378,722.67	410,401.02	31,678.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	1,000,000.00	988,471.43	1,019,947.06	31,475.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	30-Nov-18	3-Jan-19	400,000.00	378,161.16	409,608.40	31,447.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-Jan-19	1,000,000.00	992,791.65	1,023,971.25	31,179.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	500,000.00	480,838.51	511,937.06	31,098.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,100,000.00	1,095,845.49	1,126,923.45	31,077.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	8,500,000.00	8,687,303.13	8,718,227.99	30,924.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	4-Jan-19	1,000,000.00	995,135.18	1,025,926.47	30,791.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	7-Jan-19	500,000.00	482,356.45	512,930.58	30,574.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Aug-18	30-Jan-19	500,000.00	481,739.57	512,239.48	30,499.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	2,200,000.00	2,226,258.21	2,256,624.77	30,366.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	12-Feb-19	1,300,000.00	1,301,042.57	1,331,390.11	30,347.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	1,400,000.00	1,394,612.40	1,424,859.90	30,247.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	7-Mar-19	2,400,000.00	2,427,384.23	2,457,526.48	30,142.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 13 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	2-Nov-18	1-Mar-19	400,000.00	387,417.19	417,350.61	29,933.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	5,100,000.00	5,176,827.41	5,206,744.44	29,917.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	10-Sep-19	600,000.00	572,381.51	602,067.46	29,685.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-Nov-18	7-Jan-19	400,000.00	388,953.46	418,558.05	29,604.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	12-Feb-19	3,800,000.00	3,861,730.49	3,891,287.07	29,556.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	9,100,000.00	9,288,328.62	9,317,761.46	29,432.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	5-Mar-19	2,600,000.00	2,632,590.49	2,662,015.75	29,425.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Jan-19	9,400,000.00	9,610,129.75	9,639,356.23	29,226.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	11-Jan-19	1,200,000.00	1,201,360.25	1,230,556.11	29,195.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Sep-18	1-Mar-19	3,800,000.00	3,858,831.91	3,888,023.24	29,191.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	3-May-19	500,000.00	481,796.48	510,835.81	29,039.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	4-Dec-18	4-Mar-19	1,600,000.00	1,601,694.38	1,630,606.76	28,912.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Nov-18	23-Jan-19	1,600,000.00	1,610,132.93	1,639,036.59	28,903.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	15-Apr-19	400,000.00	380,094.91	408,811.67	28,716.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	4-Jan-19	1,200,000.00	1,202,611.46	1,231,111.77	28,500.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	8-Jan-19	500,000.00	484,488.50	512,907.02	28,418.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-Jan-19	500,000.00	484,120.54	512,436.45	28,315.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Sep-18	13-Mar-19	400,000.00	381,201.36	409,506.77	28,305.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	200,000.00	176,553.88	204,689.35	28,135.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-Oct-18	17-Jan-19	6,360,000.00	6,245,683.45	6,273,578.60	27,895.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	500,000.00	483,771.86	511,584.76	27,812.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	28-Jun-19	500,000.00	482,039.64	509,801.56	27,761.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	1,200,000.00	1,202,417.27	1,230,026.10	27,608.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	2-Apr-19	2,300,000.00	2,316,170.18	2,343,720.21	27,550.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	11,200,000.00	11,443,972.67	11,471,508.93	27,536.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	19-Feb-19	1,200,000.00	1,200,950.84	1,228,403.24	27,452.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	22-Aug-19	600,000.00	576,078.08	603,096.19	27,018.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Sep-18	12-Sep-19	500,000.00	477,502.92	504,364.68	26,861.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	5,400,000.00	5,505,523.55	5,532,169.67	26,646.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	29-Jan-19	1,100,000.00	1,099,731.41	1,126,322.81	26,591.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	22-Jan-19	800,000.00	793,232.10	819,580.69	26,348.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	10-Jun-19	900,000.00	891,792.90	918,027.91	26,235.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	26-Feb-19	1,500,000.00	1,508,833.88	1,534,973.48	26,139.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	4-Jan-19	500,000.00	486,970.68	513,007.26	26,036.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	28-Feb-19	500,000.00	485,690.09	511,649.74	25,959.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	400,000.00	383,832.87	409,750.52	25,917.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	1-Jul-19	4,500,000.00	4,530,369.35	4,556,224.03	25,854.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	1,900,000.00	1,923,939.19	1,949,762.90	25,823.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Sep-18	23-Jan-19	2,300,000.00	2,330,470.93	2,356,115.10	25,644.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	15-Feb-19	1,900,000.00	1,919,915.07	1,945,481.10	25,566.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-May-19	300,000.00	280,868.02	306,368.68	25,500.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 14 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	500,000.00	487,484.40	512,930.58	25,446.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	400,000.00	385,079.07	410,401.02	25,321.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20-Dec-18	18-Jan-19	600,000.00	590,685.37	615,909.42	25,224.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Jun-19	1,900,000.00	1,900,812.35	1,925,700.85	24,888.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Jul-18	11-Jan-19	1,200,000.00	1,205,690.60	1,230,556.11	24,865.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Jan-19	400,000.00	385,309.58	410,045.07	24,735.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	18-Feb-19	3,000,000.00	3,046,599.66	3,071,159.65	24,559.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Sep-18	16-Sep-19	4,400,000.00	4,389,971.03	4,414,393.34	24,422.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	600,000.00	591,034.04	614,993.61	23,959.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	29-Jan-19	7,200,000.00	7,348,803.83	7,372,592.97	23,789.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	181,115.09	204,814.68	23,699.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15-Nov-18	13-Feb-19	700,000.00	693,786.54	717,299.82	23,513.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	30-Apr-19	4,500,000.00	4,552,256.07	4,575,679.96	23,423.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	22-Apr-19	1,100,000.00	1,096,036.85	1,119,367.40	23,330.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	3-Jun-19	3,500,000.00	3,526,349.34	3,549,539.12	23,189.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Jan-19	1,700,000.00	1,720,157.88	1,743,287.83	23,129.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	3-Dec-18	3-Jan-19	600,000.00	588,887.83	611,975.40	23,087.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-Oct-18	23-Jan-19	500,000.00	500,106.96	522,650.26	22,543.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	29-Apr-19	500,000.00	488,217.10	510,735.64	22,518.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	30-Jan-19	200,000.00	182,381.69	204,878.64	22,496.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Jan-19	4,200,000.00	4,279,762.78	4,302,115.51	22,352.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	4,700,000.00	4,798,503.52	4,820,667.24	22,163.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Jan-19	2,800,000.00	2,849,330.68	2,871,297.60	21,966.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	300,000.00	286,259.61	307,747.81	21,488.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Dec-19	1,400,000.00	1,374,092.59	1,395,553.13	21,460.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	7-Nov-18	5-Feb-19	1,300,000.00	1,312,895.42	1,334,167.86	21,272.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	488,482.03	509,645.29	21,163.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	492,297.40	513,423.85	21,126.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-Oct-18	18-Feb-19	400,000.00	396,550.53	417,607.09	21,056.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	1,000,000.00	998,773.16	1,019,726.56	20,953.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	600,000.00	593,392.15	614,061.08	20,668.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-Oct-18	22-Jan-19	400,000.00	397,495.00	418,147.57	20,652.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	10-Jan-19	3,800,000.00	3,876,589.12	3,897,069.39	20,480.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Jan-19	7,500,000.00	7,674,030.95	7,694,448.55	20,417.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	28-Mar-19	1,200,000.00	1,207,248.59	1,227,609.70	20,361.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	15-Jan-19	5,600,000.00	5,719,965.03	5,740,241.41	20,276.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	9-Jan-19	3,600,000.00	3,672,195.64	3,692,241.78	20,046.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	7-Dec-18	7-Jan-19	500,000.00	489,825.13	509,849.53	20,024.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-Dec-18	4-Jan-19	4,700,000.00	4,950,993.17	4,970,900.50	19,907.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Jan-19	3,800,000.00	3,875,159.53	3,894,872.94	19,713.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Mar-18	20-Mar-19	1,000,000.00	1,000,623.68	1,020,253.25	19,629.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 15 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	15-Oct-18	11-Jan-19	7,100,000.00	7,261,768.16	7,281,375.77	19,607.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	492,482.30	512,066.81	19,584.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,800,000.00	10,020,394.53	10,039,863.48	19,468.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	16-Jan-19	2,500,000.00	2,543,056.76	2,562,359.44	19,302.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	492,507.77	511,765.32	19,257.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Jan-19	700,000.00	698,925.16	718,148.53	19,223.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	5,600,000.00	5,716,594.63	5,735,754.46	19,159.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	493,036.25	512,096.92	19,060.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	30-Jan-19	300,000.00	288,293.83	307,317.96	19,024.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	492,967.88	511,650.95	18,683.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	186,441.79	205,022.54	18,580.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	8-Jan-19	300,000.00	289,271.99	307,744.21	18,472.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Feb-19	500,000.00	493,686.21	511,859.94	18,173.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	8-Feb-19	700,000.00	698,113.80	716,282.81	18,169.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	8-Mar-19	1,300,000.00	1,312,840.97	1,330,990.59	18,149.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	288,639.04	306,763.98	18,124.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Aug-18	30-Jan-19	4,000,000.00	4,077,829.90	4,095,750.08	17,920.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	5,200,000.00	5,312,520.82	5,330,224.17	17,703.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	700,000.00	699,933.17	717,515.23	17,582.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	11-Jan-19	2,500,000.00	2,546,087.20	2,563,658.57	17,571.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	4,700,000.00	4,795,593.26	4,813,145.01	17,551.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-Dec-18	11-Jan-19	1,700,000.00	1,779,737.02	1,797,076.14	17,339.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Mar-19	1,000,000.00	1,003,964.26	1,021,275.53	17,311.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-Oct-18	6-Feb-19	400,000.00	400,666.34	417,886.89	17,220.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	800,000.00	803,565.59	820,529.52	16,963.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-Jan-19	500,000.00	495,495.15	512,436.45	16,941.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	22-Jan-19	17,700,000.00	18,116,410.86	18,133,222.82	16,811.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	17-Dec-18	16-Jan-19	400,000.00	393,988.71	410,779.76	16,791.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	5,600,000.00	5,720,416.43	5,737,064.85	16,648.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	15-Jan-19	1,600,000.00	1,623,585.55	1,640,103.15	16,517.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	700,000.00	702,397.96	718,016.97	15,619.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Jan-19	1,000,000.00	1,010,244.05	1,025,463.43	15,219.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Aug-18	14-Feb-19	600,000.00	598,407.95	613,608.71	15,200.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	200,000.00	189,987.95	204,974.58	14,986.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	26-Apr-19	700,000.00	700,143.78	715,113.63	14,969.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	200,000.00	190,256.16	205,046.51	14,790.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Oct-18	17-Apr-19	3,300,000.00	3,344,679.30	3,359,369.02	14,689.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	7-Dec-18	5-Apr-19	300,000.00	301,757.73	316,358.27	14,600.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	5-Mar-19	200,000.00	190,371.24	204,770.44	14,399.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	24-Jan-19	400,000.00	395,547.87	409,914.90	14,367.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	8-Jan-19	200,000.00	190,912.05	205,162.81	14,250.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 16 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	13-Nov-18	10-May-19	200,000.00	190,121.10	204,244.58	14,123.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	3,200,000.00	3,268,054.81	3,281,906.38	13,851.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	27-Dec-18	25-Jan-19	3,100,000.00	3,487,056.75	3,500,649.55	13,592.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	18,600,000.00	19,047,521.62	19,061,053.41	13,531.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Jan-19	200,000.00	191,719.86	205,134.52	13,414.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	28-Nov-18	26-Feb-19	900,000.00	901,812.07	915,111.85	13,299.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-Feb-19	400,000.00	396,422.97	409,548.57	13,125.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	30-Nov-18	2-Jan-19	4,200,000.00	4,303,616.04	4,316,604.60	12,988.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	8-Jan-19	3,500,000.00	3,576,885.00	3,589,816.64	12,931.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	2,900,000.00	2,958,963.02	2,971,884.67	12,921.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	15-Apr-19	300,000.00	293,809.15	306,608.75	12,799.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	1,600,000.00	1,628,751.81	1,641,482.36	12,730.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	16-Jan-19	300,000.00	294,840.42	307,569.76	12,729.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Aug-18	25-Feb-19	900,000.00	906,931.72	919,640.07	12,708.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	16-Jan-19	1,000,000.00	1,012,662.73	1,024,989.35	12,326.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-Sep-18	4-Mar-19	400,000.00	405,432.35	417,653.16	12,220.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	400,000.00	396,565.72	408,763.88	12,198.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	29-Jan-19	2,700,000.00	2,752,742.20	2,764,722.36	11,980.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	3-Jan-19	500,000.00	501,243.27	513,095.50	11,852.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	22-Jan-19	500,000.00	500,790.35	512,452.14	11,661.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	7-Jan-19	4,800,000.00	4,911,840.04	4,923,494.62	11,654.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Oct-18	3-Apr-19	300,000.00	295,309.40	306,954.72	11,645.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	7-Dec-18	2-Jan-19	700,000.00	707,853.49	719,434.10	11,580.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	2,800,000.00	2,855,815.06	2,867,119.49	11,304.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,500,000.00	1,526,139.30	1,537,258.67	11,119.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	3,000,000.00	3,066,198.77	3,077,184.14	10,985.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	5,600,000.00	5,726,202.73	5,737,064.85	10,862.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-Dec-18	31-May-19	400,000.00	409,281.55	420,110.35	10,828.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	5,600,000.00	5,726,655.73	5,737,416.23	10,760.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	700,000.00	707,365.46	717,824.40	10,458.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	900,000.00	908,677.09	919,022.53	10,345.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	2,800,000.00	2,857,582.24	2,867,877.23	10,294.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	5,600,000.00	5,729,605.48	5,739,685.15	10,079.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	8-Feb-19	200,000.00	195,056.04	204,856.15	9,800.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-Nov-18	27-May-19	500,000.00	515,626.14	525,239.50	9,613.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	1,500,000.00	1,528,752.56	1,537,532.63	8,780.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	1,300,000.00	1,322,083.43	1,330,853.28	8,769.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	5,600,000.00	5,731,084.94	5,739,812.76	8,727.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jul-18	18-Jan-19	200,000.00	196,398.61	205,022.54	8,623.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Mar-19	4,700,000.00	4,803,420.32	4,812,042.90	8,622.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Jan-19	4,400,000.00	4,505,484.25	4,514,076.48	8,592.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 17 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	8-Aug-18	4-Feb-19	300,000.00	298,885.27	307,343.06	8,457.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jul-18	18-Jan-19	1,700,000.00	1,733,743.25	1,742,139.29	8,396.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	1-Nov-19	500,000.00	493,990.27	502,206.67	8,216.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	2,200,000.00	2,248,121.29	2,256,310.64	8,189.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	14-Jun-19	3,100,000.00	3,133,104.65	3,141,203.60	8,098.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-Dec-18	4-Mar-19	200,000.00	203,113.39	211,175.67	8,062.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	7-Dec-18	7-Mar-19	200,000.00	195,800.40	203,817.94	8,017.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	10-Jan-19	200,000.00	197,138.67	205,143.95	8,005.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	1,000,000.00	1,016,826.51	1,024,475.87	7,649.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-Jul-18	9-Jan-19	200,000.00	201,598.44	209,238.06	7,639.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	2,800,000.00	2,861,872.63	2,869,405.89	7,533.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	9,400,000.00	9,632,573.98	9,639,978.13	7,404.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	197,857.65	205,027.67	7,170.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	26-Feb-19	5,700,000.00	5,825,747.19	5,832,899.22	7,152.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	300,000.00	300,006.81	307,058.19	7,051.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	2,800,000.00	2,861,523.29	2,868,532.42	7,009.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	7-Dec-18	4-Mar-19	14,100,000.00	14,842,154.79	14,849,145.12	6,990.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Oct-18	17-Apr-19	500,000.00	504,159.05	511,130.68	6,971.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	12-Jun-19	1,200,000.00	1,209,189.74	1,216,138.01	6,948.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	15-Feb-19	3,300,000.00	3,372,299.11	3,379,211.33	6,912.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	28-Dec-18	29-Jan-19	4,800,000.00	4,881,163.46	4,888,066.48	6,903.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	2,800,000.00	2,862,517.81	2,869,405.89	6,888.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Jan-19	400,000.00	403,556.97	410,330.41	6,773.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	8-Feb-19	1,000,000.00	1,016,618.13	1,023,205.33	6,587.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	16-Apr-19	1,200,000.00	1,215,149.87	1,221,496.29	6,346.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-Dec-18	18-Feb-19	260,000.00	250,179.58	256,396.49	6,216.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	800,000.00	815,117.44	820,952.80	5,835.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-Dec-18	14-Jan-19	4,900,000.00	4,881,597.94	4,887,257.65	5,659.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jan-19	5,600,000.00	5,733,854.80	5,739,384.09	5,529.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	23-Jan-19	300,000.00	302,085.76	307,443.89	5,358.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	7-Nov-18	3-May-19	4,900,000.00	4,988,926.36	4,994,274.80	5,348.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	3-Jan-19	4,000,000.00	4,099,693.85	4,104,764.00	5,070.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Jun-19	380,000.00	377,516.28	382,423.74	4,907.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	1,200,000.00	1,223,753.68	1,228,648.94	4,895.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jan-19	510,000.00	498,163.84	503,042.00	4,878.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Aug-18	22-Aug-19	1,200,000.00	1,201,720.55	1,206,588.42	4,867.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	8,100,000.00	8,293,248.71	8,297,865.39	4,616.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	10-Apr-19	570,000.00	574,691.36	579,293.16	4,601.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	12-Dec-18	4-Feb-19	160,000.00	156,552.33	161,062.05	4,509.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-Dec-18	13-Mar-19	180,000.00	179,116.71	183,536.42	4,419.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jan-19	540,000.00	528,316.09	532,632.71	4,316.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 18 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	1,500,000.00	1,534,650.55	1,538,898.69	4,248.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-18	12-Mar-19	300,000.00	291,450.69	295,672.44	4,221.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	10-Dec-18	8-Feb-19	150,000.00	146,757.54	150,969.11	4,211.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	10-Jan-19	200,000.00	200,945.21	205,143.95	4,198.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	28-Nov-18	29-Jan-19	200,000.00	201,257.62	205,257.67	4,000.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-Oct-18	17-Jan-19	130,000.00	122,611.53	126,382.73	3,771.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-Oct-18	17-Jan-19	130,000.00	122,611.53	126,382.73	3,771.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	17-Dec-18	16-Jan-19	700,000.00	714,878.35	718,576.49	3,698.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Apr-19	400,000.00	405,006.29	408,668.25	3,661.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	14-Jan-19	100,000.00	98,969.92	102,588.82	3,618.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	8-Feb-19	2,000,000.00	2,044,893.37	2,048,449.73	3,556.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	3-Oct-19	400,000.00	399,538.39	402,914.33	3,375.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	2,800,000.00	2,867,950.69	2,871,297.60	3,346.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	201,699.58	205,022.54	3,322.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	1,400,000.00	1,429,506.17	1,432,725.46	3,219.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	18-Feb-19	200,000.00	194,009.63	197,200.04	3,190.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	23-Jan-19	200,000.00	194,297.05	197,299.19	3,002.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Oct-18	15-Feb-19	100,000.00	99,466.23	102,193.68	2,727.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	20-Feb-19	700,000.00	712,903.95	715,548.92	2,644.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,400,000.00	1,431,682.19	1,434,310.13	2,627.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Nov-18	15-Feb-19	100,000.00	99,600.72	102,193.68	2,592.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	17-Dec-18	16-Jan-19	3,700,000.00	3,840,096.96	3,842,561.19	2,464.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	15-Feb-19	1,400,000.00	1,431,106.85	1,433,512.39	2,405.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-Dec-18	14-Jan-19	310,000.00	303,550.47	305,916.68	2,366.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	15-Jan-19	1,900,000.00	1,945,211.32	1,947,541.33	2,330.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-Dec-18	3-Jan-19	100,000.00	100,497.68	102,781.40	2,283.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	19-Dec-18	19-Mar-19	500,000.00	499,343.50	501,570.35	2,226.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-Dec-18	12-Feb-19	130,000.00	126,019.34	128,241.40	2,222.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	19-Jun-19	240,000.00	239,004.38	241,193.04	2,188.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	21-Jun-19	240,000.00	238,947.67	241,128.40	2,180.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-Dec-18	5-Feb-19	240,000.00	243,408.22	245,584.41	2,176.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	2-May-19	200,000.00	202,141.58	204,306.01	2,164.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-18	16-Apr-19	150,000.00	145,481.44	147,637.20	2,155.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	8-Mar-19	900,000.00	916,806.81	918,953.52	2,146.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-Dec-18	18-Jan-19	790,000.00	777,087.37	779,221.92	2,134.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Dec-18	12-Mar-19	330,000.00	334,420.00	336,520.92	2,100.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	1,000,000.00	1,022,481.12	1,024,475.87	1,994.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	22-Apr-19	240,000.00	241,092.86	243,066.18	1,973.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Dec-18	14-Mar-19	130,000.00	126,145.11	128,105.22	1,960.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jan-19	600,000.00	589,931.76	591,844.77	1,913.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-Dec-18	15-Feb-19	220,000.00	223,052.69	224,826.10	1,773.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 19 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH1126	30-Nov-18	28-Feb-19	500,000.00	511,027.88	512,668.69	1,640.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	1,400,000.00	1,433,326.02	1,434,953.19	1,627.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-Dec-18	10-Jan-19	120,000.00	116,823.74	118,437.06	1,613.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Feb-19	140,000.00	141,533.66	143,142.74	1,609.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Dec-18	10-Jun-19	600,000.00	610,509.41	612,018.60	1,509.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	20-Mar-19	90,000.00	87,293.03	88,673.96	1,380.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Nov-18	31-Jan-19	300,000.00	306,042.74	307,401.88	1,359.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Dec-18	18-Jan-19	1,100,000.00	1,125,949.86	1,127,266.60	1,316.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-Aug-18	13-Feb-19	400,000.00	416,417.00	417,723.67	1,306.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-Dec-18	31-Jan-19	100,000.00	97,448.08	98,671.56	1,223.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	20-Mar-19	330,000.00	335,057.99	336,221.07	1,163.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Dec-18	11-Jan-19	190,000.00	193,915.36	194,997.18	1,081.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Dec-18	22-Jan-19	3,900,000.00	3,994,427.17	3,995,455.87	1,028.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Dec-18	12-Jun-19	790,000.00	775,493.04	776,408.43	915.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Dec-18	9-Jan-19	2,800,000.00	2,870,765.75	2,871,668.08	902.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-Jul-18	22-Jan-19	200,000.00	204,120.86	204,974.58	853.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Oct-18	8-Jan-19	2,900,000.00	2,973,624.94	2,974,419.50	794.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	21-Dec-18	22-Jan-19	3,500,000.00	3,953,637.67	3,954,261.55	623.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	16-Dec-19	100,000.00	96,096.90	96,710.18	613.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	2-Aug-18	4-Jan-19	200,000.00	204,315.60	204,762.05	446.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Dec-18	11-Jan-19	210,000.00	215,100.66	215,523.20	422.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	20-Dec-18	20-Feb-19	960,000.00	964,396.72	964,818.37	421.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-Dec-18	17-Jan-19	100,000.00	98,275.80	98,676.56	400.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Sep-18	12-Mar-19	600,000.00	612,009.55	612,390.29	380.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Sep-18	8-Jan-19	800,000.00	820,204.07	820,548.69	344.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-Dec-18	5-Feb-19	100,000.00	98,302.34	98,640.88	338.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-Dec-18	5-Feb-19	150,000.00	153,174.64	153,482.27	307.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Oct-18	24-Jan-19	1,900,000.00	1,946,059.84	1,946,207.75	147.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	14-Dec-18	14-Jan-19	240,000.00	242,842.40	242,973.85	131.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Dec-18	11-Feb-19	110,000.00	112,349.35	112,469.30	119.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Aug-18	18-Feb-19	1,500,000.00	1,535,677.92	1,535,579.83	(98.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0419	17-Dec-18	18-Mar-19	600,000.00	598,115.70	597,946.61	(169.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	9-Nov-18	3-May-19	200,000.00	204,999.45	204,815.21	(184.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Mar-19	100,000.00	102,391.61	101,997.84	(393.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-18	7-Jun-19	290,000.00	285,452.33	285,051.46	(400.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	8-Feb-19	190,000.00	194,740.27	194,338.01	(402.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Dec-18	17-Jun-19	570,000.00	573,425.75	572,986.99	(438.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	21-Dec-18	21-Mar-19	480,000.00	481,873.31	481,363.74	(509.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	22-Oct-18	18-Apr-19	500,000.00	512,497.64	511,944.97	(552.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Dec-18	7-Mar-19	700,000.00	715,350.09	714,795.30	(554.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Dec-18	18-Feb-19	270,000.00	276,420.72	275,858.65	(562.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 20 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	5-Oct-18	4-Jan-19	500,000.00	513,595.09	513,007.26	(587.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-18	11-Mar-19	890,000.00	875,448.66	874,734.91	(713.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-Dec-18	18-Mar-19	310,000.00	316,738.44	315,950.15	(788.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	19-Feb-19	3,100,000.00	3,174,272.26	3,173,375.04	(897.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	17-Jan-19	110,000.00	109,583.96	108,541.56	(1,042.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-Jan-19	200,000.00	205,950.19	204,898.92	(1,051.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	205,904.10	204,826.72	(1,077.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	2,100,000.00	2,155,000.69	2,153,915.15	(1,085.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	23-Nov-18	22-May-19	100,000.00	97,729.76	96,640.12	(1,089.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	13-May-19	1,800,000.00	1,829,586.98	1,828,439.46	(1,147.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	14-Mar-19	130,000.00	133,730.90	132,539.32	(1,191.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	308,094.62	306,763.98	(1,330.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	14-Dec-18	14-Mar-19	260,000.00	262,342.28	261,011.30	(1,330.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Aug-18	15-Feb-19	90,000.00	93,386.82	91,974.31	(1,412.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	2,800,000.00	2,873,334.25	2,871,886.87	(1,447.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	2,500,000.00	2,567,036.84	2,565,477.50	(1,559.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Sep-18	27-Mar-19	700,000.00	715,412.73	713,808.59	(1,604.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,600,000.00	1,642,605.57	1,640,953.19	(1,652.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	8-Feb-19	90,000.00	93,863.63	92,060.05	(1,803.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Jan-19	5,100,000.00	5,232,689.14	5,230,875.67	(1,813.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-Dec-18	17-Jun-19	120,000.00	122,490.58	120,628.84	(1,861.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	19-Jun-19	1,200,000.00	1,217,977.08	1,216,079.04	(1,898.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	11-Mar-19	480,000.00	491,523.91	489,589.64	(1,934.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	19-Jun-19	400,000.00	404,077.16	402,085.47	(1,991.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Mar-19	400,000.00	410,027.84	408,033.17	(1,994.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-18	8-Feb-19	100,000.00	100,648.00	98,627.51	(2,020.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	15-Jan-19	200,000.00	207,116.63	205,058.49	(2,058.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Feb-19	930,000.00	917,822.67	915,728.67	(2,094.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Sep-18	20-Sep-19	1,900,000.00	1,906,941.10	1,904,831.61	(2,109.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0419	18-Dec-18	18-Feb-19	390,000.00	392,396.33	390,281.75	(2,114.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	15-Jan-19	200,000.00	207,299.40	205,058.49	(2,240.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	9-Nov-18	3-May-19	200,000.00	207,076.48	204,815.21	(2,261.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	10,200,000.00	10,451,944.25	10,449,653.83	(2,290.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Dec-18	12-Feb-19	90,000.00	91,097.93	88,765.92	(2,332.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Jan-19	3,200,000.00	3,283,929.85	3,281,482.97	(2,446.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	9-Jan-19	400,000.00	413,105.50	410,630.43	(2,475.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	15-Jan-19	80,000.00	81,442.64	78,943.29	(2,499.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Feb-19	520,000.00	533,242.74	530,481.70	(2,761.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Aug-18	25-Feb-19	800,000.00	820,561.61	817,586.52	(2,975.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Dec-18	25-Jan-19	120,000.00	121,362.67	118,370.65	(2,992.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	12-Dec-18	11-Jan-19	1,200,000.00	1,235,428.80	1,232,400.91	(3,027.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 21 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	480,000.00	493,792.22	490,713.76	(3,078.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jan-19	760,000.00	752,817.93	749,631.22	(3,186.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Dec-18	8-Jan-19	330,000.00	342,047.85	338,819.38	(3,228.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	600,000.00	615,726.71	612,359.64	(3,367.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Mar-19	250,000.00	258,484.30	254,968.48	(3,515.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Jan-19	430,000.00	444,469.94	440,906.68	(3,563.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	208,428.24	204,826.72	(3,601.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jun-19	100,000.00	101,889.08	98,286.36	(3,602.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	14-Dec-18	10-Oct-19	80,000.00	80,023.83	76,070.17	(3,953.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	30-Nov-18	3-Jan-19	200,000.00	208,768.27	204,804.20	(3,964.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	18-Mar-19	390,000.00	388,317.56	384,315.62	(4,001.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	3-Jan-19	2,800,000.00	2,877,373.98	2,873,334.80	(4,039.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	12-Mar-19	1,900,000.00	1,948,912.14	1,944,831.46	(4,080.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-Dec-18	29-Nov-19	80,000.00	81,550.16	77,447.34	(4,102.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	28-Feb-19	3,600,000.00	3,687,677.24	3,683,572.42	(4,104.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-Dec-18	20-Dec-19	120,000.00	120,076.16	115,965.71	(4,110.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	16-Apr-19	300,000.00	310,770.95	306,643.13	(4,127.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	22-Jan-19	700,000.00	721,312.91	717,177.03	(4,135.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	300,000.00	311,479.08	307,317.96	(4,161.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	1,300,000.00	1,335,595.25	1,331,390.11	(4,205.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,800,000.00	1,848,399.03	1,844,056.56	(4,342.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	330,000.00	341,750.75	337,365.71	(4,385.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Mar-19	400,000.00	412,443.15	407,991.36	(4,451.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	17-Jan-19	160,000.00	162,484.35	157,882.50	(4,601.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0121	18-Dec-18	17-Jun-19	90,000.00	98,716.57	94,083.30	(4,633.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Feb-19	6,000,000.00	6,146,979.16	6,142,319.30	(4,659.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0121	18-Dec-18	18-Mar-19	90,000.00	99,701.64	94,989.39	(4,712.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Feb-19	5,300,000.00	5,432,361.85	5,427,589.05	(4,772.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	1,300,000.00	1,337,549.68	1,332,528.28	(5,021.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	8-Feb-19	480,000.00	496,005.88	490,959.20	(5,046.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	517,158.62	512,096.92	(5,061.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	9-Jan-19	330,000.00	343,865.13	338,778.84	(5,086.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	2-Oct-18	30-Jan-19	100,000.00	104,821.57	99,671.94	(5,149.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-Dec-18	7-Jan-19	240,000.00	251,797.42	246,449.22	(5,348.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	8-Jan-19	4,700,000.00	4,826,191.99	4,820,723.57	(5,468.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Aug-18	21-Feb-19	1,900,000.00	1,950,403.44	1,944,921.78	(5,481.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-Dec-18	20-May-19	390,000.00	388,968.64	383,466.28	(5,502.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	518,208.99	512,667.60	(5,541.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	11-Feb-19	4,700,000.00	4,819,058.98	4,813,427.99	(5,630.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	2,800,000.00	2,871,113.73	2,865,425.34	(5,688.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Jan-19	520,000.00	538,860.05	533,014.90	(5,845.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 22 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1019	13-Dec-18	11-Jan-19	470,000.00	488,354.19	482,369.04	(5,985.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	11-Feb-19	700,000.00	722,211.90	716,124.96	(6,086.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	11-Oct-19	500,000.00	509,483.42	503,367.83	(6,115.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	6-Nov-18	4-Jan-19	90,000.00	98,608.63	92,453.75	(6,154.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	5-Oct-18	1-Mar-19	200,000.00	209,209.79	203,028.58	(6,181.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	26-Nov-18	25-Feb-19	200,000.00	209,871.73	203,684.97	(6,186.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	900,000.00	924,802.72	918,539.45	(6,263.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	1,500,000.00	1,544,605.85	1,538,195.14	(6,410.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Mar-19	900,000.00	925,600.45	919,147.98	(6,452.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	22-Jan-19	1,600,000.00	1,645,879.82	1,639,211.58	(6,668.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Nov-18	13-Feb-19	200,000.00	211,669.05	204,794.48	(6,874.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Jun-19	700,000.00	721,313.21	714,317.45	(6,995.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	9-Jan-19	240,000.00	253,379.64	246,378.26	(7,001.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	22-Jan-19	600,000.00	621,653.83	614,626.29	(7,027.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	2,600,000.00	2,642,546.01	2,635,387.81	(7,158.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	28-Nov-18	3-Jan-19	600,000.00	621,765.07	614,412.60	(7,352.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-Dec-18	18-Jan-19	6,230,000.00	6,152,374.94	6,145,003.25	(7,371.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	24-Jun-19	1,400,000.00	1,424,887.00	1,417,509.84	(7,377.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	19-Jun-19	480,000.00	490,026.07	482,619.10	(7,406.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	1,400,000.00	1,441,824.68	1,434,310.13	(7,514.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	1,400,000.00	1,441,824.68	1,434,310.13	(7,514.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Aug-18	5-Feb-19	500,000.00	520,104.30	512,188.15	(7,916.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	30-Nov-18	2-Jan-19	400,000.00	416,108.46	407,983.60	(8,124.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	13,900,000.00	14,248,367.67	14,240,214.53	(8,153.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Oct-18	8-Jan-19	300,000.00	315,899.15	307,744.21	(8,154.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	29-Oct-18	29-Jan-19	200,000.00	211,939.86	203,776.42	(8,163.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-Jan-19	1,100,000.00	1,134,585.41	1,126,368.37	(8,217.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	3,900,000.00	3,999,279.30	3,990,877.44	(8,401.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	4,300,000.00	4,413,609.24	4,405,035.06	(8,574.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	31-May-19	200,000.00	212,693.49	204,038.69	(8,654.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	18-Feb-19	300,000.00	315,823.90	307,115.97	(8,707.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	11-Oct-19	900,000.00	909,428.76	900,581.50	(8,847.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-Dec-18	18-Jan-19	1,100,000.00	1,158,773.10	1,149,827.31	(8,945.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-Dec-18	14-Jun-19	460,000.00	471,654.18	462,596.37	(9,057.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	10-Jan-19	610,000.00	635,127.81	626,013.71	(9,114.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	3-Jan-19	4,100,000.00	4,216,514.04	4,207,383.10	(9,130.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	11-Jan-19	300,000.00	317,140.73	307,706.73	(9,434.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	15-Feb-19	1,600,000.00	1,647,834.23	1,638,299.87	(9,534.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Nov-18	13-Feb-19	800,000.00	827,831.42	818,207.40	(9,624.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	5-Apr-19	400,000.00	419,247.70	408,970.90	(10,276.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	200,000.00	215,173.46	204,653.04	(10,520.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 23 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	6-Nov-18	5-Feb-19	700,000.00	741,167.04	730,604.77	(10,562.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0122	20-Dec-18	18-Feb-19	150,000.00	165,877.55	154,798.17	(11,079.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	23-Oct-18	18-Jan-19	1,000,000.00	1,033,737.97	1,022,500.02	(11,237.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	5-Jul-19	200,000.00	214,423.32	203,113.88	(11,309.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Jan-19	2,100,000.00	2,163,728.27	2,152,381.93	(11,346.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	19-Dec-18	18-Jan-19	10,500,000.00	11,881,797.94	11,870,445.82	(11,352.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	9-Jan-19	600,000.00	627,568.52	615,852.86	(11,715.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	13-Dec-19	900,000.00	908,083.52	896,354.27	(11,729.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	6-Mar-19	1,100,000.00	1,138,260.05	1,126,197.11	(12,062.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	26-Apr-19	1,800,000.00	1,842,963.98	1,830,835.65	(12,128.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	200,000.00	217,325.15	205,165.20	(12,159.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	8-Jan-19	200,000.00	217,355.14	205,162.81	(12,192.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	3-Jun-19	700,000.00	726,541.45	714,051.43	(12,490.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	2,500,000.00	2,572,262.42	2,559,736.66	(12,525.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-May-19	4,700,000.00	4,786,183.33	4,773,522.23	(12,661.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	10-Jan-19	1,400,000.00	1,448,447.56	1,435,741.42	(12,706.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	2-Apr-19	500,000.00	524,110.98	511,273.30	(12,837.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Sep-18	20-Mar-19	1,400,000.00	1,445,906.97	1,432,782.77	(13,124.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Jul-18	15-Jan-19	3,000,000.00	3,088,402.30	3,075,193.41	(13,208.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	9,300,000.00	9,543,826.03	9,530,526.71	(13,299.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	27-May-19	2,000,000.00	2,042,706.78	2,029,405.48	(13,301.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-Oct-18	4-Jan-19	1,400,000.00	1,478,609.08	1,465,133.15	(13,475.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0224	20-Dec-18	18-Jun-19	290,000.00	301,281.63	287,743.34	(13,538.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-Oct-18	22-Jan-19	500,000.00	536,293.12	522,684.47	(13,608.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	19-Dec-18	18-Mar-19	1,300,000.00	1,474,030.19	1,460,339.95	(13,690.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	500,000.00	526,488.38	512,639.07	(13,849.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Aug-18	31-Jan-19	300,000.00	321,301.11	307,415.18	(13,885.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	219,131.44	205,202.90	(13,928.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	18-Feb-19	3,500,000.00	3,597,116.58	3,583,019.59	(14,096.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,200,000.00	1,244,869.90	1,230,714.89	(14,155.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	4,900,000.00	5,032,724.19	5,018,549.78	(14,174.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	29-Mar-19	500,000.00	525,689.05	511,485.67	(14,203.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	18-Jan-19	700,000.00	732,162.26	717,351.47	(14,810.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,200,000.00	1,246,233.89	1,230,731.08	(15,502.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	19-Mar-19	1,300,000.00	1,346,232.79	1,330,340.21	(15,892.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	19-Dec-18	18-Jan-19	1,800,000.00	1,844,002.76	1,828,045.29	(15,957.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	10-Jan-19	6,700,000.00	6,887,152.68	6,871,048.24	(16,104.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	5,900,000.00	6,067,653.97	6,051,014.89	(16,639.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	29-Jan-19	1,000,000.00	1,040,818.09	1,023,929.83	(16,888.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	500,000.00	528,802.59	511,799.08	(17,003.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	2-Jan-19	1,200,000.00	1,248,539.04	1,231,429.20	(17,109.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 24 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,100,000.00	1,144,175.34	1,126,923.45	(17,251.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	11-Jan-19	100,000.00	120,449.66	102,567.26	(17,882.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	5-Mar-19	2,500,000.00	2,578,104.06	2,560,092.07	(18,011.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Dec-18	11-Jan-19	400,000.00	436,514.00	418,448.59	(18,065.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	18-Jan-19	9,300,000.00	9,548,593.15	9,530,526.71	(18,066.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	16-Jan-19	800,000.00	838,152.04	819,955.02	(18,197.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	12-Feb-19	3,900,000.00	4,012,578.92	3,994,170.32	(18,408.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	16-Jan-19	500,000.00	531,089.86	512,616.27	(18,473.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Aug-18	11-Feb-19	600,000.00	632,322.52	613,821.40	(18,501.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	3-Jan-19	400,000.00	429,064.96	410,476.40	(18,588.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	530,743.18	511,972.26	(18,770.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	2,800,000.00	2,890,192.33	2,871,297.60	(18,894.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Aug-18	7-Feb-19	2,000,000.00	2,067,684.58	2,048,768.40	(18,916.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	11-Jan-19	1,200,000.00	1,249,761.41	1,230,575.90	(19,185.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Oct-18	17-Apr-19	1,300,000.00	1,342,619.55	1,323,185.92	(19,433.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	5-Dec-18	5-Mar-19	300,000.00	336,214.26	316,753.67	(19,460.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	6-Feb-19	1,800,000.00	1,863,445.63	1,843,977.21	(19,468.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	30-Nov-18	1-Mar-19	5,000,000.00	5,146,182.19	5,126,481.39	(19,700.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-Dec-18	22-Jan-19	4,800,000.00	4,804,876.84	4,785,086.21	(19,790.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Oct-18	4-Jan-19	1,400,000.00	1,456,154.79	1,436,297.06	(19,857.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0623	28-Dec-18	29-Jan-19	2,960,000.00	2,986,810.19	2,966,893.14	(19,917.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	31-May-19	2,000,000.00	2,049,271.50	2,029,220.66	(20,050.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Sep-18	6-Mar-19	500,000.00	532,109.48	511,954.66	(20,154.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	3-Jan-19	500,000.00	533,352.22	513,095.50	(20,256.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	100,000.00	122,893.75	102,603.25	(20,290.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	4,400,000.00	4,525,689.09	4,505,046.12	(20,642.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	2,400,000.00	2,476,799.12	2,456,100.79	(20,698.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	4-Jan-19	2,400,000.00	2,483,053.10	2,462,223.54	(20,829.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	3,600,000.00	3,710,647.12	3,689,797.59	(20,849.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	10-Dec-18	8-Feb-19	500,000.00	519,331.86	498,455.75	(20,876.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	23-Jan-19	300,000.00	328,394.95	307,453.73	(20,941.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jul-18	18-Jan-19	1,500,000.00	1,558,198.25	1,537,220.20	(20,978.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	10-Jan-19	1,000,000.00	1,046,583.09	1,025,544.58	(21,038.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	19-Jun-19	400,000.00	429,008.23	407,773.21	(21,235.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	1,900,000.00	1,967,857.81	1,946,601.20	(21,256.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Jun-19	1,000,000.00	1,041,059.29	1,019,713.33	(21,345.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Aug-18	29-Jan-19	3,000,000.00	3,093,293.84	3,071,913.74	(21,380.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Aug-18	19-Feb-19	1,200,000.00	1,250,006.40	1,228,575.60	(21,430.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	3-Jan-19	1,400,000.00	1,458,273.29	1,436,667.40	(21,605.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jul-18	18-Jan-19	700,000.00	739,004.05	717,387.38	(21,616.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	1,100,000.00	1,149,866.11	1,128,155.32	(21,710.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 25 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	16-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	329,738.68	307,701.78	(22,036.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	600,000.00	636,212.62	614,107.04	(22,105.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Sep-18	9-Sep-19	100,000.00	123,046.68	100,821.86	(22,224.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	4-Jan-19	1,400,000.00	1,458,653.42	1,436,297.06	(22,356.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Jul-18	23-Jan-19	500,000.00	535,056.66	512,439.30	(22,617.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Oct-18	8-Jan-19	500,000.00	535,650.68	512,907.02	(22,743.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	28-Mar-19	1,900,000.00	1,966,672.16	1,943,715.35	(22,956.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-Nov-18	18-Feb-19	1,200,000.00	1,289,741.10	1,266,744.76	(22,996.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	9,300,000.00	9,553,866.97	9,530,765.22	(23,101.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Mar-18	26-Feb-19	1,200,000.00	1,251,469.33	1,227,978.78	(23,490.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	3,700,000.00	3,813,476.36	3,789,826.90	(23,649.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Sep-18	11-Mar-19	3,300,000.00	3,402,109.65	3,378,319.86	(23,789.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Jul-18	11-Jan-19	900,000.00	947,279.30	922,917.09	(24,362.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	9,300,000.00	9,556,532.39	9,531,977.12	(24,555.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	9,300,000.00	9,555,099.85	9,530,526.71	(24,573.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24-Jul-18	22-Jan-19	1,900,000.00	1,971,588.99	1,946,563.75	(25,025.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	16-May-19	1,900,000.00	1,955,570.95	1,930,327.52	(25,243.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	800,000.00	845,239.22	819,830.25	(25,408.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-Dec-18	22-Jan-19	700,000.00	764,845.21	739,384.25	(25,460.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Feb-19	2,900,000.00	2,994,490.03	2,968,787.66	(25,702.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Feb-19	1,900,000.00	1,970,792.37	1,945,067.78	(25,724.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-Jan-19	700,000.00	743,473.74	717,545.13	(25,928.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Jan-18	4-Jan-19	2,800,000.00	2,898,623.98	2,872,627.66	(25,996.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Aug-18	31-Jan-19	2,900,000.00	2,997,524.98	2,971,422.94	(26,102.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,000,000.00	1,050,654.25	1,024,475.87	(26,178.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	6,000,000.00	6,117,701.96	6,091,507.76	(26,194.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	22-Jan-19	1,900,000.00	1,972,827.80	1,946,504.14	(26,323.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00120	18-Dec-18	17-Jun-19	460,000.00	485,153.08	458,778.94	(26,374.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	2-Nov-18	31-Jan-19	2,400,000.00	2,472,311.51	2,445,863.39	(26,448.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	2,100,000.00	2,176,184.05	2,149,618.05	(26,566.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	7-Feb-19	3,200,000.00	3,304,408.27	3,277,681.10	(26,727.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	13-May-19	900,000.00	946,076.57	919,172.47	(26,904.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	3-Jan-19	700,000.00	745,294.05	718,333.70	(26,960.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	1,100,000.00	1,152,822.65	1,125,632.10	(27,190.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	7-Nov-18	3-May-19	700,000.00	744,048.82	716,853.22	(27,195.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	29-Jan-19	5,900,000.00	6,068,905.02	6,041,674.72	(27,230.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0122	25-Jul-18	22-Jan-19	430,000.00	472,199.49	444,491.28	(27,708.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	10-Apr-19	400,000.00	436,795.88	408,949.49	(27,846.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	15-Jan-19	3,700,000.00	3,821,130.43	3,792,580.48	(28,549.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-Dec-18	22-Jan-19	1,900,000.00	1,922,659.59	1,894,096.62	(28,562.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-May-19	800,000.00	844,886.09	816,218.75	(28,667.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 26 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	4-Jul-18	28-Jun-19	200,000.00	232,797.74	203,920.62	(28,877.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	2-Nov-18	18-Feb-19	200,000.00	232,888.01	203,723.33	(29,164.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Sep-18	18-Mar-19	400,000.00	438,608.86	409,439.26	(29,169.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	29-Jan-19	200,000.00	234,118.04	204,890.64	(29,227.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	21-Oct-19	400,000.00	431,317.81	402,081.54	(29,236.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Oct-18	4-Jan-19	1,600,000.00	1,671,106.57	1,641,491.94	(29,614.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	5,700,000.00	5,868,211.15	5,838,585.34	(29,625.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	11-Jan-19	3,400,000.00	3,516,453.99	3,486,575.66	(29,878.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	2,000,000.00	2,077,543.54	2,047,580.49	(29,963.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	24-May-19	200,000.00	234,288.36	204,094.66	(30,193.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	14-Jun-19	1,000,000.00	1,050,077.10	1,019,877.01	(30,200.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	25-Feb-19	300,000.00	337,390.96	307,009.86	(30,381.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	27-Dec-18	25-Feb-19	4,340,000.00	4,395,749.02	4,364,773.86	(30,975.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-Dec-18	12-Jun-19	400,000.00	427,888.16	396,821.69	(31,066.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	4-Jan-19	1,000,000.00	1,057,043.10	1,025,938.45	(31,104.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	2,200,000.00	2,282,576.41	2,251,425.73	(31,150.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	13-May-19	10,500,000.00	10,699,261.35	10,667,934.33	(31,327.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Aug-18	16-Jan-19	400,000.00	441,782.87	410,093.02	(31,689.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	13-May-19	2,900,000.00	2,977,575.19	2,945,819.13	(31,756.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,600,000.00	1,670,975.34	1,639,211.58	(31,763.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	339,654.07	307,711.68	(31,942.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24-Jul-18	22-Jan-19	400,000.00	441,979.97	409,949.16	(32,030.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	2,300,000.00	2,389,147.90	2,357,011.98	(32,135.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	900,000.00	954,285.96	921,817.68	(32,468.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	3-Dec-18	4-Jan-19	1,800,000.00	1,868,075.25	1,835,526.02	(32,549.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	5-Mar-19	2,700,000.00	2,797,347.26	2,764,650.18	(32,697.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Jul-18	7-Jan-19	200,000.00	238,016.44	205,172.23	(32,844.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	9-Jan-19	1,100,000.00	1,161,135.87	1,128,184.99	(32,950.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	900,000.00	954,616.09	921,536.85	(33,079.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Nov-18	21-May-19	200,000.00	237,249.14	204,118.63	(33,130.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Jul-18	9-Jan-19	200,000.00	238,410.94	205,153.38	(33,257.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	7-May-19	2,800,000.00	2,879,379.50	2,846,073.18	(33,306.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	955,747.94	922,028.28	(33,719.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	900,000.00	956,039.72	922,309.04	(33,730.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	3,700,000.00	3,828,479.12	3,794,704.25	(33,774.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	1,500,000.00	1,557,198.60	1,523,409.54	(33,789.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	23-Apr-19	3,400,000.00	3,492,989.23	3,459,043.54	(33,945.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Oct-18	16-Apr-19	500,000.00	544,998.73	510,994.68	(34,004.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	1,500,000.00	1,568,577.34	1,534,567.23	(34,010.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	956,405.48	922,028.28	(34,377.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	956,405.48	922,028.28	(34,377.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 27 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	22-Oct-18	22-Jan-19	1,000,000.00	1,079,409.82	1,044,947.23	(34,462.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	1-Mar-19	1,900,000.00	1,978,699.39	1,944,011.62	(34,687.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	900,000.00	957,820.89	922,917.09	(34,903.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	25-Jan-19	900,000.00	957,010.28	921,881.90	(35,128.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	900,000.00	957,668.83	922,519.58	(35,149.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Oct-18	23-Apr-19	1,700,000.00	1,764,721.81	1,729,521.77	(35,200.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	1-Apr-19	300,000.00	342,001.67	306,775.91	(35,225.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	957,385.41	921,881.90	(35,503.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-May-18	11-Jan-19	100,000.00	138,193.89	102,568.91	(35,624.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00122	26-Dec-18	24-Jun-19	550,000.00	599,345.72	563,687.50	(35,658.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	7-Jan-19	3,100,000.00	3,215,522.09	3,179,756.94	(35,765.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Jan-19	200,000.00	240,878.71	204,952.88	(35,925.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	400,000.00	446,439.81	410,269.05	(36,170.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	300,000.00	344,158.47	307,809.75	(36,348.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	958,258.51	921,881.90	(36,376.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	30-Jan-19	300,000.00	343,940.07	307,317.96	(36,622.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	5-Mar-19	200,000.00	241,480.83	204,770.44	(36,710.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	31-Oct-18	30-Jan-19	900,000.00	970,818.69	933,832.10	(36,986.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	242,298.65	204,814.68	(37,483.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	242,298.65	204,814.68	(37,483.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jun-19	900,000.00	955,373.45	917,778.03	(37,595.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jun-19	900,000.00	955,373.45	917,778.03	(37,595.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,300,000.00	1,370,272.82	1,332,257.50	(38,015.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20-Dec-18	20-Mar-19	1,100,000.00	1,166,263.28	1,128,202.67	(38,060.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	29-Jan-19	4,800,000.00	4,953,241.74	4,915,061.98	(38,179.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	200,000.00	242,433.91	204,150.59	(38,283.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	19-Jun-19	1,000,000.00	1,057,752.27	1,019,433.02	(38,319.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	12-Mar-19	500,000.00	550,185.22	511,797.75	(38,387.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	2,300,000.00	2,397,775.00	2,359,174.50	(38,600.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-Oct-18	15-Jan-19	200,000.00	247,896.13	209,169.56	(38,726.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	6-May-19	200,000.00	243,026.03	204,238.42	(38,787.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	3-Jun-19	2,600,000.00	2,676,046.07	2,636,800.49	(39,245.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	24-Jun-19	2,400,000.00	2,469,267.88	2,429,930.37	(39,337.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	8-Feb-19	1,400,000.00	1,473,411.27	1,433,993.03	(39,418.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	5-Mar-19	1,000,000.00	1,060,615.72	1,021,197.41	(39,418.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	6-Mar-19	900,000.00	958,436.65	919,007.36	(39,429.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	1-Apr-19	200,000.00	244,186.99	204,517.27	(39,669.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	9-Aug-19	900,000.00	945,512.29	905,699.55	(39,812.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19-Nov-18	18-Feb-19	300,000.00	347,752.64	307,724.55	(40,028.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	13-May-19	900,000.00	958,942.12	918,821.42	(40,120.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,500,000.00	1,576,849.34	1,536,713.80	(40,135.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 28 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	2,800,000.00	2,912,114.51	2,871,668.08	(40,446.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	2,600,000.00	2,704,107.08	2,663,637.25	(40,469.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-Dec-18	31-May-19	300,000.00	355,691.40	315,082.76	(40,608.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Aug-18	5-Feb-19	6,200,000.00	6,391,767.22	6,351,133.00	(40,634.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Sep-18	9-Jan-19	200,000.00	245,830.83	205,153.38	(40,677.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	15-Nov-19	400,000.00	442,441.37	401,546.73	(40,894.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	18-Jan-19	900,000.00	963,724.66	922,332.12	(41,392.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	800,000.00	861,021.39	819,580.69	(41,440.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	2,200,000.00	2,297,471.10	2,256,019.54	(41,451.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	7-May-19	900,000.00	960,797.59	919,036.96	(41,760.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	9-Jan-19	200,000.00	247,334.31	205,158.77	(42,175.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	900,000.00	962,878.08	920,623.83	(42,254.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	900,000.00	963,001.37	920,677.96	(42,323.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	10-Jan-19	1,000,000.00	1,067,891.37	1,025,529.59	(42,361.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	6-Feb-19	900,000.00	963,355.81	920,975.05	(42,380.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Aug-18	26-Feb-19	900,000.00	962,197.94	919,717.16	(42,480.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	11-Feb-19	200,000.00	247,557.85	204,838.77	(42,719.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	14-May-19	900,000.00	961,613.69	918,785.49	(42,828.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Nov-18	20-Feb-19	900,000.00	962,930.47	919,991.47	(42,939.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,100,000.00	1,170,408.01	1,127,266.60	(43,141.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	400,000.00	453,789.76	410,287.90	(43,501.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Nov-18	14-May-19	600,000.00	656,535.09	612,759.51	(43,775.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	15-Feb-19	1,100,000.00	1,170,253.92	1,126,258.55	(43,995.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	249,072.01	205,067.04	(44,004.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Jan-19	600,000.00	659,090.65	614,979.94	(44,110.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Jun-19	16,400,000.00	16,673,696.63	16,629,554.66	(44,141.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	3-Jan-19	100,000.00	146,955.62	102,619.10	(44,336.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	25-Oct-18	23-Jan-19	200,000.00	248,717.83	203,820.98	(44,896.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-Dec-18	28-Mar-19	700,000.00	771,298.14	726,319.21	(44,978.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	6-Mar-19	1,200,000.00	1,273,726.86	1,228,691.18	(45,035.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	8-Jan-19	500,000.00	558,010.69	512,907.02	(45,103.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24-Jul-18	22-Jan-19	4,000,000.00	4,143,191.45	4,098,028.95	(45,162.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	16-Jan-19	100,000.00	147,693.09	102,525.53	(45,167.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	10-Jan-19	100,000.00	147,815.76	102,571.98	(45,243.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Sep-18	5-Mar-19	200,000.00	250,403.39	204,807.37	(45,596.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	15-Jan-19	1,900,000.00	1,993,309.60	1,947,541.33	(45,768.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Jul-18	9-Jan-19	600,000.00	661,534.24	615,357.45	(46,176.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	800,000.00	865,310.65	819,081.45	(46,229.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Sep-18	18-Mar-19	100,000.00	148,669.52	102,337.53	(46,331.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	25-Jan-19	100,000.00	149,210.07	102,472.87	(46,737.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	3-Jun-19	1,000,000.00	1,067,094.08	1,020,073.48	(47,020.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 29 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	4-Dec-18	3-Jun-19	1,000,000.00	1,067,094.08	1,020,073.48	(47,020.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	7,400,000.00	7,626,634.93	7,579,389.83	(47,245.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	8-Jan-19	200,000.00	252,486.79	205,167.60	(47,319.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	5-Mar-19	1,300,000.00	1,378,651.51	1,331,007.88	(47,643.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	7-May-19	100,000.00	149,935.02	102,115.22	(47,819.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	29-Jan-19	200,000.00	252,969.64	204,898.92	(48,070.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	400,000.00	458,349.34	410,134.08	(48,215.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Aug-18	1-Aug-19	100,000.00	149,696.52	101,131.34	(48,565.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-Jan-19	1,100,000.00	1,176,548.21	1,127,523.93	(49,024.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	100,000.00	152,808.66	102,437.63	(50,371.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	800,000.00	869,206.85	818,706.92	(50,499.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-Dec-18	12-Jun-19	400,000.00	447,329.54	396,821.69	(50,507.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	256,449.95	205,201.71	(51,248.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	26-Feb-19	800,000.00	868,762.29	817,460.86	(51,301.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Jul-18	22-Jan-19	900,000.00	973,621.16	922,084.75	(51,536.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Jul-18	15-Jan-19	1,000,000.00	1,076,981.24	1,025,021.75	(51,959.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	1,500,000.00	1,589,613.53	1,537,596.70	(52,016.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	30-Jan-19	1,200,000.00	1,281,446.82	1,228,622.18	(52,824.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	565,678.63	512,556.34	(53,122.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	258,850.79	205,067.04	(53,783.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	24-Jul-18	22-Jan-19	1,100,000.00	1,215,687.42	1,161,889.54	(53,797.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	9-Jan-19	1,600,000.00	1,695,698.67	1,640,953.19	(54,745.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Jul-18	2-Jul-19	500,000.00	563,098.39	508,006.11	(55,092.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Jun-18	26-Jun-19	500,000.00	565,442.47	509,576.27	(55,866.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	19-Dec-18	20-Mar-19	3,500,000.00	3,986,971.92	3,930,733.24	(56,238.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	14-Dec-18	12-Jun-19	980,000.00	1,009,369.42	952,186.58	(57,182.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	4,600,000.00	4,768,702.05	4,711,512.60	(57,189.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	2,800,000.00	2,924,168.89	2,866,453.22	(57,715.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	4-Jan-19	400,000.00	468,822.17	410,405.81	(58,416.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-Oct-18	18-Jan-19	600,000.00	686,117.21	627,178.53	(58,938.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	7,400,000.00	7,643,032.87	7,583,429.85	(59,603.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	18-Oct-19	200,000.00	261,299.75	201,501.79	(59,797.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	4,600,000.00	4,772,800.01	4,712,588.98	(60,211.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Jan-18	4-Jan-19	400,000.00	470,730.77	410,405.81	(60,324.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Aug-18	26-Feb-19	2,800,000.00	2,925,920.56	2,865,283.83	(60,636.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	3,200,000.00	3,343,051.83	3,281,588.51	(61,463.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	21-Nov-19	900,000.00	958,991.46	897,245.18	(61,746.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	15-Jan-19	1,300,000.00	1,394,723.51	1,332,583.81	(62,139.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	29-Jan-19	900,000.00	984,533.90	921,536.85	(62,997.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	6-Dec-18	3-Jun-19	1,700,000.00	1,791,349.47	1,727,882.66	(63,466.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-Nov-18	19-Feb-19	500,000.00	585,789.08	521,979.71	(63,809.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 30 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH1126	20-Nov-18	19-Feb-19	3,800,000.00	3,964,522.87	3,897,688.11	(66,834.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Aug-18	4-Feb-19	7,600,000.00	7,855,154.79	7,785,643.37	(69,511.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	5,800,000.00	6,018,941.05	5,948,978.02	(69,963.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	8,300,000.00	8,576,682.84	8,505,738.89	(70,943.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18-Jul-18	14-Jan-19	1,200,000.00	1,318,892.55	1,246,397.00	(72,495.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	10-Aug-18	6-Feb-19	300,000.00	379,874.32	306,574.54	(73,299.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	11,100,000.00	11,345,252.39	11,271,559.87	(73,692.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-Aug-18	18-Feb-19	400,000.00	497,033.04	417,607.09	(79,425.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Aug-18	29-Jan-19	2,100,000.00	2,230,841.85	2,150,252.64	(80,589.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Jan-19	7,200,000.00	7,466,321.76	7,383,336.69	(82,985.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	4-Dec-18	4-Jan-19	20,800,000.00	21,449,024.87	21,363,471.49	(85,553.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Aug-18	12-Feb-19	300,000.00	399,178.37	313,310.24	(85,868.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	17-Dec-18	18-Mar-19	3,400,000.00	3,905,355.76	3,819,350.63	(86,005.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	400,000.00	496,712.12	410,335.20	(86,376.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	11-Dec-18	8-Feb-19	14,400,000.00	14,443,915.07	14,355,525.60	(88,389.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	20-Dec-18	22-Jan-19	5,700,000.00	5,772,096.55	5,682,289.87	(89,806.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	46,500,000.00	47,748,787.67	47,653,826.11	(94,961.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	11,100,000.00	11,472,860.14	11,377,741.43	(95,118.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	21-Dec-18	18-Jun-19	1,260,000.00	1,348,198.95	1,252,366.20	(95,832.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	23-Oct-18	18-Jan-19	1,400,000.00	1,530,230.79	1,431,500.02	(98,730.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00222	20-Dec-18	15-Jan-19	6,300,000.00	7,570,346.76	7,471,253.02	(99,093.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-Dec-18	18-Jan-19	4,000,000.00	4,280,328.32	4,181,190.20	(99,138.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-Dec-18	22-Jan-19	3,600,000.00	3,861,003.08	3,761,810.02	(99,193.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	14,800,000.00	15,266,980.83	15,162,242.81	(104,738.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	7,700,000.00	7,996,749.04	7,888,464.16	(108,284.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Aug-18	26-Feb-19	8,000,000.00	8,298,465.76	8,186,525.22	(111,940.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Dec-19	9,400,000.00	9,477,252.05	9,364,742.70	(112,509.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	25-Jan-19	9,200,000.00	9,536,198.64	9,423,025.19	(113,173.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	14-Dec-18	15-Jan-19	29,500,000.00	29,681,950.74	29,566,204.46	(115,746.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	6,900,000.00	7,196,114.88	7,077,232.48	(118,882.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Jan-18	8-Jan-19	2,600,000.00	2,789,360.91	2,666,720.93	(122,639.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Feb-18	18-Feb-19	1,200,000.00	1,354,418.03	1,228,548.29	(125,869.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	18-Dec-18	18-Mar-19	1,400,000.00	1,528,327.37	1,397,693.20	(130,634.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Jul-18	22-Jan-19	8,200,000.00	8,532,519.09	8,400,702.10	(131,816.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	19-Dec-18	17-Jun-19	1,800,000.00	2,119,396.94	1,980,338.79	(139,058.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	20-Nov-18	20-May-19	2,100,000.00	2,214,434.82	2,074,243.99	(140,190.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Apr-18	5-Apr-19	3,900,000.00	4,116,313.63	3,974,292.08	(142,021.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	18,500,000.00	19,095,123.29	18,952,803.51	(142,319.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-Dec-18	8-Jan-19	4,500,000.00	4,852,110.63	4,707,780.10	(144,330.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Aug-18	30-Jan-19	7,500,000.00	7,828,596.33	7,678,888.60	(149,707.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jan-18	23-Jan-19	2,500,000.00	2,737,672.50	2,560,994.67	(176,677.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 31 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	24-Oct-18	22-Jan-19	2,800,000.00	3,053,983.61	2,868,971.69	(185,011.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	19-Feb-19	2,800,000.00	3,064,860.22	2,866,274.23	(198,585.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Apr-18	17-Apr-19	8,400,000.00	8,766,543.78	8,552,425.94	(214,117.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-Jun-18	10-Jun-19	1,300,000.00	1,556,435.19	1,339,837.87	(216,597.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Oct-18	23-Apr-19	3,400,000.00	3,678,926.56	3,461,836.63	(217,089.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Feb-18	1-Feb-19	4,500,000.00	4,858,957.35	4,611,013.57	(247,943.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	20-Dec-18	18-Jan-19	9,900,000.00	10,127,460.72	9,871,747.78	(255,712.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-Oct-18	30-Jan-19	12,000,000.00	12,788,675.20	12,530,959.02	(257,716.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Aug-18	12-Feb-19	2,600,000.00	2,975,424.98	2,715,355.42	(260,069.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	18-Dec-18	17-Jan-19	20,600,000.00	23,557,716.90	23,292,441.78	(265,275.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	31-Jul-19	9,400,000.00	9,740,138.36	9,467,156.37	(272,981.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-Nov-18	31-Jan-19	21,500,000.00	22,755,693.65	22,468,939.77	(286,753.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-Oct-18	30-Jan-19	15,600,000.00	16,616,622.30	16,290,246.72	(326,375.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	28-Dec-18	29-Jan-19	14,200,000.00	14,488,943.80	14,149,586.02	(339,357.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	24-May-19	5,600,000.00	6,055,273.97	5,689,552.53	(365,721.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	26-Nov-18	26-Feb-19	28,700,000.00	29,051,094.28	28,571,060.31	(480,033.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18-Jul-18	14-Jan-19	6,200,000.00	6,926,893.41	6,439,717.85	(487,175.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-Dec-18	4-Jan-19	19,900,000.00	21,396,513.22	20,825,821.19	(570,692.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0224	21-Nov-18	20-May-19	8,270,000.00	8,767,087.77	8,173,308.55	(593,779.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-Oct-18	17-Jan-19	16,900,000.00	18,543,909.63	17,857,304.15	(686,605.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Jul-18	28-Jun-19	4,700,000.00	5,667,781.70	4,835,501.18	(832,280.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-Oct-18	30-Jan-19	39,600,000.00	42,266,151.08	41,352,164.75	(913,986.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	30-Jul-18	24-Jan-19	10,400,000.00	11,607,871.59	10,671,439.25	(936,432.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-Nov-18	26-Feb-19	61,600,000.00	65,859,895.83	64,282,765.59	(1,577,130.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	16-Oct-18	12-Apr-19	29,200,000.00	30,755,536.99	28,925,491.16	(1,830,045.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-Dec-18	4-Mar-19	107,700,000.00	116,415,311.29	112,154,087.27	(4,261,224.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	8-Apr-19	38,300,000.00	37,990,787.63	39,015,499.45	1,024,711.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	54,364,087.30	55,374,512.89	1,010,425.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	54,364,087.30	55,374,512.89	1,010,425.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	54,364,087.30	55,374,512.89	1,010,425.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	54,364,087.30	55,374,512.89	1,010,425.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	15-Jan-19	40,700,000.00	41,347,969.46	41,719,254.55	371,285.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	12-Apr-19	13,800,000.00	13,698,824.33	14,053,567.19	354,742.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	10-May-19	47,200,000.00	47,634,348.56	47,965,784.03	331,435.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	7-Jun-19	17,900,000.00	17,821,546.81	18,151,890.89	330,344.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	20-May-19	24,700,000.00	24,799,212.16	25,081,759.35	282,547.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	18,700,000.00	18,682,389.65	18,954,520.05	272,130.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	4-Jan-19	21,900,000.00	22,215,758.70	22,468,052.03	252,293.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	43,800,000.00	44,270,569.24	44,487,063.79	216,494.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	43,800,000.00	44,270,569.24	44,487,063.79	216,494.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	14,700,000.00	14,796,645.77	14,999,934.55	203,288.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 32 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	1-Oct-18	3-Jan-19	9,200,000.00	9,244,794.12	9,440,957.20	196,163.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	17-Jan-19	18,100,000.00	18,358,226.43	18,550,947.63	192,721.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	13-Dec-19	4,900,000.00	4,690,982.61	4,880,151.00	189,168.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	12-Mar-19	47,300,000.00	48,103,793.02	48,281,605.65	177,812.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	10-Jun-19	9,400,000.00	9,374,469.32	9,530,109.33	155,640.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	10-May-19	15,700,000.00	15,801,227.48	15,954,720.54	153,493.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Mar-18	7-Jan-19	20,600,000.00	20,980,758.22	21,130,213.72	149,455.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	11,800,000.00	11,948,215.76	12,095,508.69	147,292.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	31-May-19	19,200,000.00	19,340,690.41	19,480,518.29	139,827.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	14,200,000.00	14,398,792.04	14,534,087.56	135,295.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	29-Mar-19	4,800,000.00	4,784,284.42	4,911,488.11	127,203.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	11-Jan-19	14,100,000.00	14,339,435.71	14,459,034.35	119,598.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	14,100,000.00	14,339,723.76	14,459,034.35	119,310.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	4-Jan-19	9,500,000.00	9,628,881.61	9,746,415.26	117,533.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	14,100,000.00	14,349,226.03	14,460,178.51	110,952.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	5,100,000.00	5,112,514.93	5,223,145.81	110,630.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-Dec-18	4-Jan-19	16,000,000.00	16,207,674.09	16,315,786.89	108,112.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	3,100,000.00	3,071,212.84	3,172,840.32	101,627.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	4,800,000.00	4,811,586.19	4,912,785.01	101,198.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	29-Mar-19	5,000,000.00	5,021,849.73	5,116,133.45	94,283.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	17,700,000.00	18,061,932.84	18,152,404.27	90,471.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Sep-18	9-Sep-19	2,400,000.00	2,328,618.27	2,410,199.16	81,580.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	8,200,000.00	8,286,564.83	8,366,076.61	79,511.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	13-Dec-18	11-Feb-19	7,600,000.00	7,673,193.93	7,742,943.82	69,749.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	15-Jan-19	3,800,000.00	3,827,070.59	3,895,163.82	68,093.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	13-Mar-19	4,700,000.00	4,744,000.87	4,811,704.54	67,703.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	4-Jan-19	4,800,000.00	4,860,185.33	4,924,504.55	64,319.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	10-Jan-19	3,200,000.00	3,218,657.59	3,281,694.68	63,037.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Mar-19	3,200,000.00	3,215,239.25	3,277,025.78	61,786.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-Nov-18	15-Jan-19	10,900,000.00	11,459,503.98	11,519,098.35	59,594.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	29-Jan-19	4,800,000.00	4,857,971.80	4,914,863.19	56,891.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	13-Dec-18	13-Mar-19	33,700,000.00	34,181,775.20	34,237,759.26	55,984.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	900,000.00	865,026.76	920,553.58	55,526.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Nov-18	12-Feb-19	2,000,000.00	1,998,113.72	2,048,045.83	49,932.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	13,000,000.00	13,272,873.31	13,322,241.63	49,368.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	26-Feb-19	3,300,000.00	3,329,155.79	3,377,482.90	48,327.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	15-Jan-19	2,400,000.00	2,417,975.59	2,460,154.73	42,179.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	2,600,000.00	2,620,198.23	2,661,969.48	41,771.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	10-Jan-19	2,800,000.00	2,830,333.15	2,871,566.78	41,233.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	4,700,000.00	4,769,492.50	4,809,482.98	39,990.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Jan-19	10,600,000.00	10,820,239.39	10,856,963.81	36,724.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 33 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	11-Sep-18	11-Mar-19	6,100,000.00	6,190,063.09	6,226,444.60	36,381.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	4-Dec-18	3-Jan-19	6,900,000.00	7,006,703.46	7,037,717.10	31,013.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Sep-18	16-Sep-19	1,900,000.00	1,883,087.76	1,906,913.29	23,825.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-May-19	1,100,000.00	1,093,564.39	1,116,604.04	23,039.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	29-Jan-19	5,200,000.00	5,301,535.71	5,324,435.12	22,899.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	7-Oct-19	1,300,000.00	1,278,895.51	1,301,309.76	22,414.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	17-Dec-18	16-Jan-19	1,800,000.00	1,806,153.21	1,828,228.54	22,075.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,600,000.00	9,814,521.83	9,835,269.48	20,747.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,600,000.00	9,814,521.83	9,835,269.48	20,747.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,600,000.00	9,814,521.83	9,835,269.48	20,747.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	9,600,000.00	9,814,521.83	9,835,269.48	20,747.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	23-Jan-19	4,300,000.00	4,388,141.29	4,405,192.97	17,051.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	9-Jan-19	8,200,000.00	8,393,452.95	8,409,885.10	16,432.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	4,800,000.00	4,907,260.90	4,917,634.74	10,373.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	10-Jan-19	1,000,000.00	1,017,589.16	1,025,544.58	7,955.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	19-Mar-19	3,300,000.00	3,370,390.67	3,377,762.53	7,371.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	3,000,000.00	3,063,539.96	3,070,794.49	7,254.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	11-Dec-18	4-Jan-19	600,000.00	605,595.85	611,842.01	6,246.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	25-Jan-19	1,400,000.00	1,428,902.06	1,433,938.62	5,036.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	1,000,000.00	1,019,698.62	1,022,837.31	3,138.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	300,000.00	303,992.37	306,734.34	2,741.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	7-Jan-19	9,500,000.00	9,743,558.49	9,744,516.03	957.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Sep-18	18-Mar-19	1,300,000.00	1,331,363.32	1,330,387.93	(975.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Jun-18	21-Jun-19	7,200,000.00	7,296,433.06	7,295,388.43	(1,044.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	550,000.00	567,676.91	561,602.30	(6,074.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	380,000.00	395,169.87	388,481.73	(6,688.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Feb-19	4,900,000.00	5,023,605.03	5,016,227.43	(7,377.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	1,400,000.00	1,435,621.03	1,425,079.38	(10,541.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	8-Feb-19	2,400,000.00	2,471,271.87	2,458,407.86	(12,864.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-Nov-18	4-Jan-19	700,000.00	746,575.95	732,566.57	(14,009.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	5,700,000.00	5,860,271.55	5,841,436.75	(18,834.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	29-Nov-18	28-Feb-19	7,800,000.00	8,017,676.50	7,997,631.64	(20,044.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	3-Jan-19	9,100,000.00	9,358,687.36	9,338,338.10	(20,349.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-Nov-18	25-Feb-19	5,300,000.00	5,613,664.79	5,593,030.24	(20,634.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	6,600,000.00	6,786,033.15	6,763,768.87	(22,264.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-Dec-18	15-Feb-19	3,100,000.00	3,276,231.66	3,272,864.93	(23,366.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jun-18	6-Jun-19	1,100,000.00	1,139,574.54	1,115,817.22	(23,757.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Oct-18	25-Jan-19	1,400,000.00	1,458,066.98	1,433,938.62	(24,128.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jun-19	48,700,000.00	49,368,600.35	49,344,111.77	(24,488.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-Nov-18	11-Jan-19	5,800,000.00	6,158,165.78	6,131,200.94	(26,964.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	1,900,000.00	1,976,358.22	1,947,541.33	(28,816.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 34 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0423	12-Dec-18	12-Feb-19	2,600,000.00	2,680,400.24	2,648,830.61	(31,569.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	19-Feb-19	5,800,000.00	5,970,389.19	5,937,282.33	(33,106.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Aug-18	26-Feb-19	5,100,000.00	5,252,401.35	5,218,909.83	(33,491.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Sep-18	13-Mar-19	800,000.00	853,675.42	816,457.87	(37,217.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	3,000,000.00	3,114,376.82	3,073,128.87	(41,247.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	2,000,000.00	2,089,821.17	2,047,703.63	(42,117.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	7-Dec-18	8-Jan-19	300,000.00	355,148.26	308,206.86	(46,941.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	100,000.00	152,067.70	102,442.78	(49,624.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Nov-18	20-Feb-19	8,500,000.00	8,759,506.41	8,700,760.20	(58,746.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	16-Nov-18	15-Jan-19	6,100,000.00	6,152,419.50	6,083,750.82	(68,668.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	12-Dec-18	12-Mar-19	1,170,000.00	1,211,878.78	1,139,346.01	(72,532.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-Oct-18	22-Jan-19	8,700,000.00	8,774,710.39	8,672,968.75	(101,741.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	23-Nov-18	22-Jan-19	7,800,000.00	7,877,891.60	7,775,765.09	(102,126.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-Nov-18	7-Jan-19	4,100,000.00	4,402,460.31	4,289,669.84	(112,790.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	16-Jan-19	6,600,000.00	6,891,420.71	6,764,628.92	(126,791.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	7-Dec-18	7-Mar-19	13,100,000.00	14,828,236.03	14,695,095.91	(133,140.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	22-Jan-19	67,200,000.00	68,984,617.56	68,846,886.37	(137,731.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	69,100,000.00	70,670,872.26	70,523,145.84	(147,726.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	38,000,000.00	38,929,874.40	38,765,290.59	(164,583.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	12-Dec-19	14,100,000.00	14,215,557.53	14,037,076.33	(178,481.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	23,400,000.00	23,954,378.78	23,761,666.75	(192,712.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	20-Dec-18	20-Mar-19	17,400,000.00	19,674,844.45	19,477,416.24	(197,428.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	13-Dec-18	13-Mar-19	35,000,000.00	39,447,486.38	39,223,400.87	(224,085.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	18-Dec-18	17-Jan-19	20,800,000.00	21,360,054.54	21,125,137.67	(234,916.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	5-Dec-18	24-May-19	24,400,000.00	25,091,368.23	24,817,584.61	(273,783.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	29-Jan-19	48,400,000.00	49,877,172.36	49,560,208.28	(316,964.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	31-Oct-18	7-Feb-19	6,500,000.00	7,207,161.92	6,864,924.34	(342,237.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	12-Dec-18	12-Mar-19	5,780,000.00	5,957,963.54	5,612,374.27	(345,589.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	29-Jan-19	47,000,000.00	48,486,777.79	48,126,648.54	(360,129.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Jul-18	22-Jan-19	14,600,000.00	15,322,103.17	14,958,263.74	(363,839.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-Dec-18	28-Jan-19	7,800,000.00	8,690,846.18	8,146,489.62	(544,356.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Sep-18	22-Feb-19	63,800,000.00	63,508,646.46	62,924,001.79	(584,644.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-Nov-18	28-May-19	8,960,000.00	9,377,096.87	8,768,676.82	(608,420.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	67,200,000.00	68,875,766.26	68,238,632.72	(637,133.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Nov-18	20-May-19	67,200,000.00	68,875,766.26	68,238,632.72	(637,133.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	31-Oct-18	7-Jan-19	12,600,000.00	14,018,833.11	13,323,356.00	(695,477.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	29-Oct-18	25-Jan-19	6,900,000.00	8,494,314.48	7,791,768.35	(702,546.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	19-Nov-18	19-Feb-19	11,000,000.00	11,791,345.07	10,954,334.25	(837,010.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	12-Dec-18	12-Mar-19	16,440,000.00	16,965,341.84	15,963,223.70	(1,002,118.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	24-Jul-18	22-Jan-19	14,400,000.00	16,088,041.88	14,949,038.81	(1,139,003.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jun-19	23,000,000.00	24,500,740.99	23,328,707.03	(1,172,033.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 35 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

6. Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0123	1-Aug-18	29-Jan-19	20,030,000.00	20,750,968.05	19,497,962.36	(1,253,005.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-Sep-18	25-Feb-19	147,010,000.00	146,321,052.45	144,982,556.67	(1,338,495.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	28-Nov-18	27-May-19	18,980,000.00	20,345,506.61	18,900,205.90	(1,445,300.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-Nov-18	12-Feb-19	48,600,000.00	52,485,158.92	50,756,259.01	(1,728,899.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	28-Nov-18	27-May-19	30,760,000.00	31,873,189.02	29,732,175.08	(2,141,013.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	4-Oct-18	8-Jan-19	24,800,000.00	30,231,239.10	28,082,099.78	(2,149,139.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	27-Nov-18	28-May-19	37,140,000.00	38,559,642.33	36,279,833.62	(2,279,808.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	2-Aug-18	29-Jan-19	80,110,000.00	82,985,394.27	77,982,115.08	(5,003,279.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	25-Jul-18	22-Jan-19	46,700,000.00	53,508,826.42	48,480,563.37	(5,028,263.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Dec-18	31-May-19	50,100,000.00	50,573,030.67	50,820,899.55	247,868.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-Oct-18	7-Jan-19	72,200,000.00	76,827,633.03	75,540,039.61	(1,287,593.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-Dec-18	7-Mar-19	116,700,000.00	132,391,483.58	121,393,781.26	(10,997,702.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			5,999,360,000.00	6,184,304,398.96	6,139,176,957.58	(45,127,441.51)		

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0521	20-Dec-18	18-Feb-19	347,000.00	355,735.14	357,116.37	1,381.23	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	14-Dec-18	14-Jan-19	721,000.00	743,306.92	744,410.64	1,103.72	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	27-Jul-18	23-Jan-19	5,000.00	4,470.12	4,978.86	508.74	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	27-Jul-18	23-Jan-19	5,000.00	4,498.61	4,978.86	480.25	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Dec-18	3-Jan-19	3,000.00	2,760.69	3,213.72	453.03	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	2-Nov-18	4-Mar-19	5,000.00	4,963.79	5,339.99	376.21	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	8-Oct-18	9-Jan-19	5,000.00	4,979.41	5,353.59	374.18	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	2-Nov-18	4-Mar-19	5,000.00	4,978.11	5,339.99	361.88	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	18-Dec-18	18-Mar-19	34,000.00	34,619.48	34,885.51	266.03	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	10-Dec-18	9-Jan-19	3,000.00	3,006.51	3,212.15	205.64	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	5-Dec-18	4-Mar-19	11,000.00	11,576.66	11,747.98	171.32	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	25-Jul-18	22-Jan-19	5,000.00	5,000.17	5,158.09	157.92	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	28-Dec-18	29-Jan-19	3,000.00	3,135.72	3,208.67	72.94	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	5-Oct-18	3-Apr-19	9,000.00	9,556.68	9,598.82	42.14	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	30-Nov-18	3-Jan-19	8,000.00	8,557.94	8,569.92	11.98	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	26-Sep-18	25-Mar-19	6,000.00	6,161.10	6,152.06	(9.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	26-Dec-18	24-Jun-19	13,000.00	12,923.65	12,833.19	(90.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4227	18-Dec-18	17-Jun-19	6,915.00	7,316.35	7,205.21	(111.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	5-Oct-18	8-Jan-19	8,000.00	8,694.73	8,566.20	(128.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	29-Nov-18	2-Jan-19	24,000.00	25,842.37	25,709.76	(132.61)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	19-Oct-18	4-Mar-19	4,000.00	4,435.29	4,271.99	(163.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 36 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0327	2-Nov-18	31-Jan-19	24,000.00	25,867.36	25,669.73	(197.63)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	2-Nov-18	26-Feb-19	4,000.00	4,512.87	4,272.69	(240.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	31-Jul-18	25-Jan-19	9,000.00	9,948.41	9,628.09	(320.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	2-Nov-18	31-Jan-19	9,000.00	9,997.06	9,626.15	(370.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	2-Nov-18	4-Jan-19	9,000.00	9,874.01	9,459.70	(414.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-Nov-18	11-Feb-19	9,000.00	10,043.03	9,620.82	(422.20)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	20-Dec-18	18-Jan-19	172,000.00	177,934.85	177,511.55	(423.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	31-Oct-18	29-Jan-19	16,000.00	17,543.71	17,112.89	(430.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Dec-18	4-Mar-19	18,000.00	19,674.34	19,223.97	(450.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	7-Dec-18	7-Mar-19	48,000.00	49,783.19	49,302.98	(480.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	2-Aug-18	29-Jan-19	7,000.00	7,977.97	7,486.89	(491.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Dec-18	3-Jan-19	17,000.00	18,712.30	18,211.08	(501.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	2-Nov-18	18-Feb-19	9,000.00	9,957.19	9,427.05	(530.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Oct-18	8-Jan-19	11,000.00	12,390.69	11,778.53	(612.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	16-Oct-18	14-Jan-19	5,000.00	5,982.91	5,352.13	(630.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	8-Oct-18	5-Apr-19	46,000.00	47,778.86	47,116.16	(662.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	12-Dec-18	10-Jun-19	5,000.00	6,023.84	5,315.48	(708.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	2-Oct-18	29-Mar-19	19,000.00	20,290.59	19,473.92	(816.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	27-Dec-18	27-Mar-19	18,000.00	20,109.98	19,197.89	(912.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4227	23-Oct-18	18-Jan-19	30,436.00	32,903.05	31,978.08	(924.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4227	26-Oct-18	22-Feb-19	19,225.00	21,116.36	20,160.59	(955.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-Nov-18	11-Jan-19	49,000.00	54,244.61	52,459.45	(1,785.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	14-Dec-18	12-Jun-19	37,000.00	41,173.16	39,330.81	(1,842.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	27-Dec-18	25-Jan-19	76,000.00	83,472.23	81,303.87	(2,168.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Jul-18	4-Jul-19	19,000.00	22,547.30	20,160.75	(2,386.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	6-Nov-18	4-Feb-19	190,000.00	198,267.35	195,811.44	(2,455.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	16-Oct-18	12-Apr-19	45,000.00	50,974.05	47,973.62	(3,000.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	9-Nov-18	3-Jan-19	247,000.00	258,850.15	255,388.12	(3,462.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	3-Oct-18	4-Jan-19	99,000.00	108,009.38	104,056.65	(3,952.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	11-Jul-18	9-Jan-19	95,000.00	102,127.65	98,135.18	(3,992.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	24-Oct-18	22-Jan-19	92,000.00	102,616.86	98,436.51	(4,180.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	25-Jul-18	22-Jan-19	102,000.00	110,004.18	105,225.04	(4,779.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	28-Dec-18	29-Jan-19	378,000.00	394,621.02	389,669.96	(4,951.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	5-Dec-18	3-May-19	515,000.00	533,599.15	526,395.81	(7,203.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	20-Dec-18	14-Jan-19	776,000.00	799,479.80	801,196.47	1,716.67	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	21-Dec-18	19-Feb-19	624,000.00	640,777.12	642,128.11	1,350.99	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	13-Dec-18	11-Feb-19	236,000.00	242,065.05	243,049.36	984.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	13-Dec-18	25-Jan-19	484,000.00	498,319.93	499,148.58	828.65	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	6-Dec-18	7-Jan-19	6,000.00	6,492.60	6,425.00	(67.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	14-Dec-18	14-Jan-19	8,000.00	8,877.69	8,563.41	(314.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	26-Dec-18	25-Feb-19	242,000.00	249,242.68	248,881.86	(360.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4327	12-Oct-18	10-Apr-19	340,584.00	356,799.51	356,231.17	(568.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 37 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0521	10-Dec-18	8-Feb-19	48,000.00	50,220.01	49,448.50	(771.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	14-Dec-18	14-Mar-19	513,000.00	528,057.91	526,566.11	(1,491.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4227	12-Oct-18	10-Apr-19	902,792.00	945,774.59	944,268.22	(1,506.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	7-Nov-18	29-Jan-19	215,000.00	224,123.30	221,637.67	(2,485.63)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	10-Dec-18	12-Mar-19	157,000.00	163,918.23	161,183.24	(2,734.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	6-Dec-18	6-Mar-19	157,000.00	164,119.06	161,277.53	(2,841.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	9-Nov-18	7-Feb-19	208,000.00	217,566.15	214,298.14	(3,268.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	19-Dec-18	18-Jan-19	180,000.00	196,506.88	192,634.99	(3,871.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	9-Nov-18	7-Feb-19	292,000.00	305,844.05	300,841.62	(5,002.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	30-Nov-18	29-Jan-19	472,000.00	495,126.00	486,572.01	(8,553.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	23-Oct-18	22-Jan-19	192,000.00	207,574.56	198,070.67	(9,503.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	21-Sep-18	20-Mar-19	184,000.00	198,611.28	188,755.31	(9,855.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	7-Nov-18	29-Apr-19	760,000.00	788,400.81	777,109.56	(11,291.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	14-Dec-18	3-May-19	2,642,000.00	2,712,430.23	2,700,461.63	(11,968.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	9-Oct-18	10-Jan-19	257,000.00	278,254.42	265,454.14	(12,800.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-Sep-18	12-Mar-19	188,000.00	213,527.88	200,665.12	(12,862.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	22-Oct-18	22-Jan-19	275,000.00	298,481.45	283,694.97	(14,786.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	25-Sep-18	25-Mar-19	268,000.00	305,927.79	285,864.51	(20,063.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	19-Nov-18	18-Jan-19	1,334,000.00	1,400,700.17	1,376,746.53	(23,953.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	21-Nov-18	3-May-19	2,567,000.00	2,660,870.16	2,623,802.04	(37,068.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	4-Oct-18	7-Jan-19	923,000.00	997,770.21	953,657.30	(44,112.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	10-Oct-18	10-Jan-19	919,000.00	997,198.72	949,230.95	(47,967.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	4-Sep-18	20-Feb-19	924,000.00	1,000,222.59	950,748.99	(49,473.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	24-Aug-18	20-Feb-19	871,000.00	996,165.56	930,660.30	(65,505.26)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP5127	7-Dec-18	9-Jan-19	955,832.00	994,873.79	999,157.36	4,283.57	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4227	29-Nov-18	4-Jan-19	856,664.00	896,791.25	900,801.36	4,010.11	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4527	13-Dec-18	11-Feb-19	949,928.00	993,310.64	996,829.23	3,518.59	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	14-Dec-18	3-May-19	876,000.00	893,876.21	895,383.95	1,507.74	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP0927	29-Nov-18	4-Jan-19	187,360.00	198,799.94	199,644.54	844.60	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	19-Sep-18	18-Mar-19	527,000.00	568,129.87	540,725.33	(27,404.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	29-Oct-18	28-Mar-19	4,129,000.00	4,294,383.46	4,232,403.84	(61,979.63)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	4-Dec-18	31-May-19	1,032,000.00	1,090,771.68	1,019,923.12	(70,848.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	25-Sep-18	25-Mar-19	1,735,000.00	1,871,953.76	1,778,971.15	(92,982.61)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	22-Nov-18	21-May-19	1,827,000.00	1,926,663.97	1,806,866.02	(119,797.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			34,920,736.00	36,744,450.06	35,933,105.06	(811,344.97)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 38 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			-	-	-	-		

d) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0126	7-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	538,191.81	542,986.49	4,794.68	DOP	N/A
BO0126	9-Oct-18	8-Jan-19	6,900,000.00	7,562,051.18	7,562,449.33	398.15	DOP	N/A
BO0126	25-Oct-18	8-Jan-19	6,500,000.00	6,897,405.41	6,912,877.18	15,471.77	DOP	N/A
Total			13,900,000.00	14,997,648.40	15,018,313.01	20,664.61		

e) Oro

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

7. Contratos de venta forward DOP:

a) Títulos Valores de Deuda

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0126	2-Nov-18	23-Apr-19	3,400,000.00	3,678,926.55	3,461,836.63	(217,089.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-May-18	23-Jan-19	2,500,000.00	2,737,673.40	2,561,404.79	(176,268.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	19-Dec-18	18-Mar-19	1,400,000.00	1,528,327.36	1,397,693.20	(130,634.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Oct-18	8-Jan-19	6,900,000.00	7,196,114.88	7,077,480.58	(118,634.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	14-Dec-18	14-Jan-19	1,200,000.00	1,318,892.40	1,246,397.00	(72,495.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	26-Jun-19	500,000.00	565,442.20	510,232.47	(55,209.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 39 de 163

7. Contratos de venta forward DOP:

a) Títulos Valores de Deuda

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0126	17-Sep-18	30-Jan-19	1,200,000.00	1,281,454.72	1,228,879.33	(52,575.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-Dec-18	12-Jun-19	400,000.00	447,329.52	396,821.69	(50,507.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Dec-18	18-Mar-19	100,000.00	148,669.54	102,393.26	(46,276.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Dec-18	22-Jan-19	1,600,000.00	1,670,975.20	1,639,412.39	(31,562.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Oct-18	29-Jan-19	3,000,000.00	3,093,293.76	3,072,410.82	(20,882.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Dec-18	3-Jan-19	400,000.00	429,064.93	410,476.40	(18,588.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	530,743.18	512,156.94	(18,586.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Aug-18	16-Jan-19	800,000.00	838,152.04	820,046.18	(18,105.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Dec-18	10-Jan-19	1,400,000.00	1,448,447.47	1,435,846.34	(12,601.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Oct-18	8-Jan-19	200,000.00	217,325.15	205,174.79	(12,150.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-Dec-18	9-Jan-19	600,000.00	627,568.50	615,884.60	(11,683.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CM0928	10-Oct-18	8-Apr-19	195,586.00	205,347.01	194,134.89	(11,212.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	25-Feb-19	2,800,000.00	2,871,113.47	2,866,553.30	(4,560.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-Oct-18	18-Apr-19	500,000.00	512,497.63	511,944.97	(552.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-Dec-18	11-Feb-19	110,000.00	112,349.35	112,503.53	154.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	5-Feb-19	100,000.00	98,302.33	98,661.42	359.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Oct-18	11-Jan-19	7,100,000.00	7,261,768.18	7,281,375.77	19,607.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-Oct-18	15-Jan-19	5,600,000.00	5,719,965.05	5,740,719.91	20,754.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Dec-18	8-Jan-19	300,000.00	286,259.61	307,762.19	21,502.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Nov-18	5-Feb-19	400,000.00	383,834.81	409,853.61	26,018.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	11-Jun-19	1,900,000.00	1,900,811.76	1,927,961.52	27,149.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-Nov-18	17-Jan-19	6,360,000.00	6,245,683.67	6,274,345.76	28,662.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Dec-18	15-Jan-19	9,800,000.00	10,007,239.09	10,046,259.83	39,020.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-Dec-18	18-Jan-19	7,100,000.00	7,451,738.16	7,501,638.60	49,900.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-Oct-18	8-Jan-19	6,500,000.00	6,552,682.81	6,667,191.85	114,509.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Dec-18	22-Jan-19	67,200,000.00	68,984,612.58	68,855,320.57	(129,292.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	11-Jan-19	14,100,000.00	14,339,723.70	14,460,196.94	120,473.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	40,700,000.00	41,347,967.39	41,722,732.17	374,764.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-Dec-18	30-Jan-19	66,400,000.00	81,113,365.60	78,560,519.52	(2,552,846.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	13-Dec-18	16-Jan-19	35,200,000.00	38,899,938.38	36,556,257.80	(2,343,680.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	14-Dec-18	14-Jan-19	45,000,000.00	45,021,600.49	45,710,294.99	688,694.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			343,465,586.00	367,075,201.87	362,500,776.55	(4,574,425.32)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 40 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

Contratos de venta forward USD:

b) Títulos Valores de Deuda

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00327	31-Aug-18	25-Jan-19	9,000.00	9,948.41	9,628.09	(320)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00125	24-Aug-18	16-Jan-19	12,000.00	10,942.42	11,916.75	974	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	4-Sep-18	20-Feb-19	871,000.00	996,164.56	930,660.30	(65,504)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	14-Dec-18	3-May-19	2,567,000.00	2,660,870.75	2,623,802.04	(37,069)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			3,459,000.00	3,677,926.14	3,576,007.18	(101,919)		

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	5-Jan-18	4-Jan-19	400,000.00	491,467.76	498,749.41	-7,281.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Jan-18	4-Jan-19	2,800,000.00	3,043,782.88	3,092,623.32	-48,840.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Feb-18	1-Feb-19	4,500,000.00	4,883,090.91	4,943,772.42	-60,681.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Mar-18	7-Jan-19	20,600,000.00	22,067,126.03	22,201,945.69	-134,819.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Mar-18	20-Mar-19	1,000,000.00	1,019,990.12	1,028,989.90	-8,999.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Apr-18	3-Apr-19	3,100,000.00	3,188,606.25	3,222,301.19	-33,694.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Apr-18	5-Apr-19	3,900,000.00	4,210,434.52	4,252,793.30	-42,358.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Apr-18	17-Apr-19	8,400,000.00	8,999,298.57	9,105,681.53	-106,382.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jun-18	6-Jun-19	1,100,000.00	1,186,441.32	1,209,834.00	-23,392.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Jun-18	21-Jun-19	7,200,000.00	7,635,375.53	7,794,788.76	-159,413.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Jul-18	2-Jul-19	500,000.00	588,274.76	600,127.08	-11,852.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Jul-18	28-Jun-19	200,000.00	242,629.93	247,793.69	-5,163.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	4-Jan-19	400,000.00	489,559.16	491,066.75	-1,507.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	4-Jan-19	500,000.00	512,891.91	514,471.35	-1,579.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Jul-18	1-Jul-19	4,500,000.00	4,755,615.93	4,846,968.13	-91,352.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	500,000.00	491,987.30	492,013.20	-25.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	400,000.00	517,925.82	517,953.09	-27.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	6,900,000.00	7,562,112.67	7,562,510.83	-398.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Jul-18	8-Jan-19	5,800,000.00	6,326,539.68	6,330,646.26	-4,106.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	9-Jan-19	1,100,000.00	1,219,801.28	1,221,978.72	-2,177.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Jul-18	15-Jan-19	1,300,000.00	1,395,110.84	1,399,610.43	-4,499.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	355,832.49	351,117.32	4,715.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 41 de 163

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	17-Jul-18	15-Jan-19	3,000,000.00	3,089,296.14	3,097,409.62	-8,113.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	258,910.38	255,522.34	3,388.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	400,000.00	458,468.52	453,624.28	4,844.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	249,131.60	246,499.24	2,632.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Jul-18	15-Jan-19	1,500,000.00	1,590,060.45	1,569,560.77	20,499.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	15-Jan-19	1,600,000.00	1,624,062.26	1,607,217.84	16,844.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Jul-18	16-Jan-19	1,000,000.00	1,013,258.62	999,551.72	13,706.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Jul-18	18-Jan-19	700,000.00	739,838.30	731,466.00	8,372.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Jul-18	22-Jan-19	14,600,000.00	15,356,903.17	15,176,709.75	180,193.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Jul-18	22-Jan-19	900,000.00	975,766.37	978,312.07	-2,545.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Jul-18	23-Jan-19	500,000.00	536,397.41	537,871.81	-1,474.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	29-Jan-19	48,400,000.00	50,093,480.58	50,313,169.38	-219,688.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Jul-18	29-Jan-19	47,000,000.00	48,696,829.16	48,852,073.61	-155,244.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Aug-18	29-Jan-19	5,900,000.00	6,095,273.17	6,118,352.44	-23,079.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Aug-18	2-Aug-19	1,200,000.00	1,182,972.51	1,209,193.46	-26,220.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Aug-18	30-Jan-19	4,000,000.00	4,096,898.39	4,120,356.88	-23,458.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Aug-18	30-Jan-19	500,000.00	484,123.13	486,895.18	-2,772.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Aug-18	31-Jan-19	300,000.00	322,820.63	323,735.33	-914.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Aug-18	1-Feb-19	2,000,000.00	2,020,635.33	2,026,652.95	-6,017.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Aug-18	5-Feb-19	400,000.00	358,675.05	361,818.60	-3,143.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Aug-18	6-Feb-19	2,600,000.00	2,637,755.44	2,646,991.47	-9,236.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Aug-18	6-Feb-19	2,400,000.00	2,428,645.22	2,442,969.11	-14,323.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Aug-18	7-Feb-19	2,000,000.00	2,081,985.95	2,096,235.32	-14,249.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Aug-18	7-Feb-19	1,800,000.00	1,813,300.60	1,826,438.57	-13,137.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	8-Feb-19	1,400,000.00	1,483,839.35	1,494,507.51	-10,668.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Aug-18	12-Feb-19	1,300,000.00	1,312,275.10	1,322,469.88	-10,194.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	11-Feb-19	200,000.00	249,226.34	250,976.46	-1,750.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	11-Feb-19	700,000.00	728,051.63	733,018.23	-4,966.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	11-Feb-19	600,000.00	637,328.00	641,292.77	-3,964.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Aug-18	12-Feb-19	3,900,000.00	4,046,276.52	4,079,336.39	-33,059.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Aug-18	15-Feb-19	600,000.00	573,997.52	577,900.12	-3,902.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	1,300,000.00	1,290,209.84	1,299,540.94	-9,331.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	7,300,000.00	7,455,656.28	7,526,045.68	-70,389.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	18-Feb-19	2,000,000.00	2,098,399.70	2,136,028.11	-37,628.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Aug-18	19-Feb-19	3,700,000.00	3,794,662.76	3,824,937.06	-30,274.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	18-Feb-19	500,000.00	483,597.78	487,095.27	-3,497.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Aug-18	19-Feb-19	3,100,000.00	3,207,522.94	3,265,311.12	-57,788.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Aug-18	19-Feb-19	500,000.00	483,613.63	488,346.79	-4,733.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Aug-18	19-Feb-19	1,200,000.00	1,262,877.63	1,275,237.49	-12,359.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Aug-18	25-Feb-19	800,000.00	830,572.57	836,586.17	-6,013.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Aug-18	26-Feb-19	900,000.00	973,728.42	983,263.56	-9,535.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Sep-18	8-Jan-19	800,000.00	862,631.47	866,291.46	-3,659.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Sep-18	5-Mar-19	200,000.00	253,382.84	255,691.00	-2,308.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 42 de 163

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	6-Sep-18	4-Jan-19	15,700,000.00	16,826,794.20	16,878,611.94	-51,817.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	538,197.59	542,992.32	-4,794.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Sep-18	2-Sep-19	4,500,000.00	4,498,867.73	4,612,976.73	-114,109.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Sep-18	6-Mar-19	500,000.00	539,707.08	544,598.85	-4,891.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	8-Jan-19	4,700,000.00	5,075,452.95	5,096,987.16	-21,534.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Sep-18	8-Mar-19	900,000.00	931,018.80	938,812.96	-7,794.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Sep-18	11-Mar-19	6,700,000.00	6,841,020.03	6,902,833.54	-61,813.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Sep-18	13-Mar-19	400,000.00	388,113.69	392,285.71	-4,172.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Sep-18	9-Sep-19	2,400,000.00	2,369,377.17	2,426,815.98	-57,438.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Sep-18	14-Mar-19	200,000.00	169,253.98	171,133.58	-1,879.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Sep-18	12-Sep-19	500,000.00	486,441.28	485,314.72	1,126.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Sep-18	18-Mar-19	400,000.00	446,117.08	444,802.19	1,314.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Sep-18	16-Sep-19	1,900,000.00	1,919,317.90	1,967,570.20	-48,252.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Sep-18	23-Jan-19	4,100,000.00	4,135,258.06	4,109,046.92	26,211.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Sep-18	25-Mar-19	8,400,000.00	8,508,764.83	8,595,503.08	-86,738.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Sep-18	25-Mar-19	4,300,000.00	4,340,977.60	4,386,969.65	-45,992.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Sep-18	25-Jan-19	2,400,000.00	2,433,181.28	2,422,728.18	10,453.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Sep-18	27-Mar-19	700,000.00	730,429.17	739,419.94	-8,990.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	3-Jan-19	9,200,000.00	9,719,003.71	9,739,797.01	-20,793.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Oct-18	4-Jan-19	4,800,000.00	5,109,029.17	5,118,638.32	-9,609.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	4-Jan-19	5,000,000.00	5,246,043.00	5,260,100.33	-14,057.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Oct-18	4-Jan-19	9,500,000.00	10,121,385.03	10,160,657.83	-39,272.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	1-Apr-19	1,600,000.00	1,590,785.19	1,606,172.09	-15,386.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	270,612.86	274,193.74	-3,580.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	4-Oct-18	8-Jan-19	24,800,000.00	30,610,543.21	30,575,704.63	34,838.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Oct-18	4-Jan-19	500,000.00	539,516.32	540,854.21	-1,337.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	8-Jan-19	4,800,000.00	5,058,744.13	5,075,144.46	-16,400.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	8-Jan-19	200,000.00	263,093.64	263,841.40	-747.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	9-Jan-19	3,700,000.00	3,902,932.62	3,915,353.88	-12,421.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	10-Jan-19	2,800,000.00	2,980,497.53	2,991,594.11	-11,096.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Oct-18	3-Oct-19	400,000.00	409,191.81	420,784.21	-11,592.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	8-Jan-19	6,500,000.00	6,897,419.93	6,912,891.73	-15,471.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	9-Jan-19	200,000.00	258,000.75	258,770.28	-769.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	9-Jan-19	5,400,000.00	5,777,958.18	5,755,059.00	22,899.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	10-Jan-19	4,900,000.00	5,207,198.39	5,218,262.53	-11,064.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Oct-18	8-Apr-19	38,300,000.00	38,949,336.95	39,459,966.20	-510,629.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Oct-18	8-Jan-19	5,700,000.00	6,075,138.54	6,097,264.64	-22,126.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Oct-18	10-Jan-19	2,400,000.00	2,552,708.48	2,559,151.19	-6,442.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Oct-18	9-Apr-19	1,200,000.00	1,216,789.80	1,231,209.41	-14,419.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Oct-18	11-Oct-19	500,000.00	522,741.98	537,979.62	-15,237.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Oct-18	12-Apr-19	13,800,000.00	14,060,648.99	14,261,758.72	-201,109.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	15-Jan-19	2,400,000.00	2,418,690.66	2,429,878.49	-11,187.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Oct-18	16-Jan-19	3,800,000.00	3,877,423.91	3,889,698.68	-12,274.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 43 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	17-Oct-18	16-Jan-19	2,800,000.00	2,793,255.11	2,803,772.28	-10,517.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Oct-18	15-Apr-19	700,000.00	679,883.14	687,857.16	-7,974.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Oct-18	17-Jan-19	12,800,000.00	12,976,037.02	13,008,574.56	-32,537.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Oct-18	17-Apr-19	3,300,000.00	3,436,118.68	3,481,565.74	-45,447.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Oct-18	17-Apr-19	500,000.00	518,013.50	524,240.92	-6,227.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	55,887,659.90	56,668,771.29	-781,111.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	55,887,659.90	56,668,771.29	-781,111.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	55,887,659.90	56,668,771.29	-781,111.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	54,400,000.00	55,887,659.90	56,668,771.29	-781,111.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22-Oct-18	18-Apr-19	1,000,000.00	1,015,730.21	1,028,905.37	-13,175.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Oct-18	23-Jan-19	4,300,000.00	4,399,671.77	4,419,673.15	-20,001.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25-Oct-18	8-Jan-19	4,100,000.00	4,367,686.74	4,377,484.03	-9,797.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Apr-19	300,000.00	265,726.39	269,123.33	-3,466.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Oct-18	24-Apr-19	500,000.00	485,630.41	493,041.04	-7,410.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Oct-18	26-Feb-19	5,800,000.00	5,944,561.55	5,993,222.15	-48,660.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	9-Jan-19	3,600,000.00	3,864,191.53	3,871,089.41	-6,897.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	6,500,000.00	6,637,437.28	6,666,147.25	-28,709.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Oct-18	30-Jan-19	2,500,000.00	2,584,180.23	2,594,841.82	-10,661.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	30-Oct-18	3-Jan-19	7,300,000.00	7,572,911.99	7,587,602.07	-14,690.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31-Oct-18	4-Jan-19	21,900,000.00	23,351,108.70	23,385,712.70	-34,604.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	1-Nov-18	31-Jan-19	500,000.00	479,412.17	481,823.00	-2,410.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	31-Jan-19	1,900,000.00	1,922,913.06	1,915,807.63	7,105.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	2-May-19	10,000,000.00	10,311,240.92	10,459,908.17	-148,667.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	2-Nov-18	2-May-19	4,000,000.00	4,074,707.18	4,130,182.19	-55,475.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	1,900,000.00	1,979,745.82	1,990,452.69	-10,706.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	4-Feb-19	600,000.00	639,966.73	643,299.81	-3,333.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Nov-18	3-May-19	500,000.00	498,034.49	504,687.82	-6,653.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	7-Jan-19	4,800,000.00	5,164,974.29	5,176,865.61	-11,891.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	5-Feb-19	6,000,000.00	6,069,446.68	6,108,011.42	-38,564.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Nov-18	7-Mar-19	2,400,000.00	2,464,567.79	2,486,299.63	-21,731.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	6-Feb-19	1,800,000.00	1,875,780.56	1,887,219.28	-11,438.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	6-Feb-19	11,800,000.00	12,022,258.79	12,105,209.78	-82,950.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	8-Nov-18	7-May-19	4,900,000.00	5,004,232.76	5,082,052.90	-77,820.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-Jan-19	23,600,000.00	25,227,931.51	25,294,594.54	-66,663.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	9-Nov-18	8-May-19	1,100,000.00	1,120,890.57	1,138,033.84	-17,143.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	12-Feb-19	400,000.00	369,461.98	372,183.97	-2,721.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	10-May-19	47,200,000.00	49,265,658.15	50,083,149.18	-817,491.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Nov-18	10-May-19	15,700,000.00	16,343,845.29	16,615,047.33	-271,202.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	4,900,000.00	5,073,602.27	5,107,196.67	-33,594.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	521,329.85	524,468.67	-3,138.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	497,207.48	500,400.11	-3,192.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Nov-18	11-Feb-19	600,000.00	586,757.07	590,524.71	-3,767.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 44 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	13-Nov-18	13-May-19	900,000.00	977,986.50	993,067.13	-15,080.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15-Nov-18	14-May-19	600,000.00	677,987.14	689,770.09	-11,782.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-Jan-19	700,000.00	743,682.30	746,080.87	-2,398.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16-Nov-18	15-May-19	300,000.00	291,683.43	296,090.28	-4,406.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	16-May-19	1,900,000.00	2,024,634.65	2,055,518.20	-30,883.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	1,500,000.00	1,612,169.49	1,639,917.44	-27,747.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	43,800,000.00	45,875,719.24	46,683,826.22	-808,106.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Nov-18	17-May-19	43,800,000.00	45,875,719.24	46,683,826.22	-808,106.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	18-Jan-19	1,000,000.00	968,079.45	971,802.35	-3,722.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Nov-18	20-May-19	24,700,000.00	25,726,477.23	26,164,952.58	-438,475.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	229,499.93	230,023.20	-523.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	961,208.17	964,502.40	-3,294.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-Mar-19	6,000,000.00	6,141,940.78	6,214,037.97	-72,097.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23-Nov-18	22-May-19	3,700,000.00	3,856,217.53	3,921,510.30	-65,292.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	26-Feb-19	3,300,000.00	3,371,434.21	3,400,384.45	-28,950.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Nov-18	28-Jun-19	500,000.00	506,620.12	512,332.65	-5,712.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	22-Jan-19	700,000.00	722,981.40	726,166.91	-3,185.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Jan-19	4,200,000.00	4,293,527.85	4,311,672.66	-18,144.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Jan-19	200,000.00	241,534.19	242,458.41	-924.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	14,200,000.00	14,576,486.56	14,687,862.49	-111,375.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Nov-18	25-Feb-19	300,000.00	303,760.92	305,899.45	-2,138.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Nov-18	26-Feb-19	600,000.00	570,777.16	574,777.00	-4,099.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	960,335.07	964,009.77	-3,674.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	28-Feb-19	500,000.00	492,393.86	496,171.63	-3,777.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29-Nov-18	25-Nov-19	5,300,000.00	5,345,261.82	5,502,342.93	-157,081.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30-Nov-18	29-May-19	300,000.00	262,776.52	267,017.16	-4,240.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Jan-19	2,500,000.00	2,695,898.14	2,701,665.87	-5,767.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	4-Jan-19	16,400,000.00	17,601,213.52	17,665,983.96	-64,770.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	5-Mar-19	2,500,000.00	2,615,347.21	2,639,171.38	-23,824.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	31-May-19	2,000,000.00	2,130,908.49	2,165,914.56	-35,006.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	3-Dec-18	3-Dec-19	1,400,000.00	1,433,324.10	1,476,018.62	-42,694.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	8-Jan-19	3,100,000.00	3,282,244.18	3,289,606.68	-7,362.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	4-Mar-19	3,200,000.00	3,261,957.06	3,289,205.06	-27,248.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	4-Dec-18	31-May-19	50,100,000.00	52,618,037.18	52,394,550.35	223,486.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	4-Jan-19	1,000,000.00	1,108,885.57	1,110,971.18	-2,085.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	5-Dec-18	5-Mar-19	1,600,000.00	1,629,035.78	1,642,569.57	-13,533.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	6-Dec-18	7-Jan-19	14,100,000.00	15,101,516.05	15,145,333.45	-43,817.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	8-Jan-19	4,700,000.00	5,047,764.48	5,050,037.02	-2,272.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	-4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	-4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	-4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	7-Mar-19	5,900,000.00	6,041,640.83	6,091,284.90	-49,644.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	7-Dec-18	29-Mar-19	4,800,000.00	4,890,114.56	4,939,056.87	-48,942.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 45 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	7-Dec-18	5-Jun-19	700,000.00	750,928.96	746,536.94	4,392.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-Dec-18	7-Jan-19	240,000.00	259,253.86	257,187.18	2,066.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	8-Feb-19	2,400,000.00	2,489,148.58	2,501,065.83	-11,917.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	2,600,000.00	2,663,579.05	2,686,046.60	-22,467.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	29-Mar-19	5,000,000.00	5,132,089.46	5,184,481.00	-52,391.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	7-Jun-19	17,900,000.00	18,589,530.37	18,917,504.13	-327,973.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10-Dec-18	11-Mar-19	5,100,000.00	5,261,920.56	5,306,305.38	-44,384.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	9-Jan-19	330,000.00	354,370.88	354,862.22	-491.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	11-Mar-19	480,000.00	518,035.69	522,198.15	-4,162.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jan-19	17,700,000.00	19,011,186.26	19,062,963.96	-51,777.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	8-Feb-19	700,000.00	703,327.84	706,133.84	-2,806.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	6,400,000.00	6,596,257.90	6,650,578.43	-54,320.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	11-Mar-19	500,000.00	475,898.47	480,103.24	-4,204.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11-Dec-18	10-Jun-19	600,000.00	636,788.18	647,658.98	-10,870.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	11-Mar-19	400,000.00	432,120.99	435,506.74	-3,385.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Dec-18	10-Apr-19	570,000.00	612,733.00	619,347.23	-6,614.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	12-Mar-19	1,200,000.00	1,204,914.14	1,214,540.89	-9,626.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	12-Mar-19	47,300,000.00	48,907,083.09	49,366,353.61	-459,270.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12-Dec-18	10-Jun-19	9,400,000.00	9,786,170.00	9,963,075.60	-176,905.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	11-Jan-19	3,200,000.00	3,515,621.69	3,535,548.20	-19,926.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	13-Mar-19	4,700,000.00	4,825,220.73	4,867,412.52	-42,191.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13-Dec-18	13-Dec-19	900,000.00	948,842.42	979,064.43	-30,222.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-Dec-18	11-Jan-19	470,000.00	503,677.48	504,818.34	-1,140.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Dec-18	12-Feb-19	90,000.00	94,951.52	95,404.11	-452.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	518,357.96	519,512.56	-1,154.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	15-Jan-19	38,000,000.00	38,721,026.41	38,876,877.02	-155,850.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	25-Jan-19	900,000.00	959,959.94	962,866.89	-2,906.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	4,500,000.00	4,609,869.80	4,631,842.70	-21,972.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	1,300,000.00	1,346,827.78	1,353,247.42	-6,419.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	12-Feb-19	5,100,000.00	5,156,581.03	5,180,131.00	-23,549.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	600,000.00	626,273.97	631,596.19	-5,322.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	5,300,000.00	5,371,848.66	5,417,499.83	-45,651.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	14-Mar-19	2,100,000.00	2,213,099.46	2,231,906.87	-18,807.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14-Dec-18	13-Dec-19	4,900,000.00	4,912,892.20	5,055,483.56	-142,591.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	300,000.00	317,455.38	318,905.19	-1,449.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Dec-18	12-Jun-19	380,000.00	385,532.72	391,761.24	-6,228.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-Dec-18	17-Jan-19	100,000.00	101,839.34	102,135.34	-296.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	600,000.00	591,391.57	593,145.65	-1,754.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	16-Jan-19	500,000.00	526,786.33	528,033.49	-1,247.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	17-Jan-19	18,100,000.00	18,374,404.85	18,438,818.64	-64,413.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	15-Feb-19	3,300,000.00	3,403,762.12	3,381,167.35	22,594.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	3,000,000.00	3,119,851.60	3,104,572.29	15,279.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	500,000.00	538,187.86	543,093.61	-4,905.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 46 de 163

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	14,700,000.00	15,072,572.82	15,234,135.46	-161,562.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	19-Mar-19	3,300,000.00	3,433,316.70	3,465,829.20	-32,512.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	18,700,000.00	19,518,125.95	19,742,757.48	-224,631.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	2,600,000.00	2,758,744.64	2,806,481.30	-47,736.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17-Dec-18	13-Jun-19	4,100,000.00	4,280,664.12	4,289,486.71	-8,822.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Dec-18	17-Jan-19	160,000.00	168,186.01	167,111.81	1,074.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jan-19	37,300,000.00	38,113,549.49	37,892,531.90	221,017.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18-Dec-18	17-Jan-19	37,300,000.00	38,113,549.49	37,892,531.90	221,017.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-Dec-18	18-Feb-19	260,000.00	261,743.12	263,112.71	-1,369.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Jan-19	5,200,000.00	5,250,509.13	5,265,457.36	-14,948.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	18-Feb-19	6,500,000.00	6,652,353.79	6,689,818.93	-37,465.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19-Dec-18	19-Jun-19	1,200,000.00	1,273,752.42	1,298,692.06	-24,939.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Dec-18	18-Feb-19	270,000.00	289,158.80	290,787.30	-1,628.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jan-19	600,000.00	611,478.72	607,538.29	3,940.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	18-Jun-19	100,000.00	104,651.51	106,685.43	-2,033.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	8-Jan-19	19,300,000.00	20,584,288.43	20,638,680.96	-54,392.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,300,000.00	1,371,822.14	1,362,981.97	8,840.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,700,000.00	1,687,921.30	1,677,044.16	10,877.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	1,500,000.00	1,527,926.97	1,535,025.74	-7,098.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jan-19	14,200,000.00	14,475,042.88	14,390,274.09	84,768.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	3,900,000.00	4,074,808.41	4,054,505.32	20,303.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	8,200,000.00	8,445,369.62	8,536,807.84	-91,438.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	502,190.99	507,426.66	-5,235.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20-Dec-18	18-Jun-19	48,700,000.00	51,617,639.73	51,480,228.72	137,411.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Jan-19	430,000.00	459,643.64	456,681.65	2,961.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Jan-19	520,000.00	557,209.64	553,618.92	3,590.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	25,700,000.00	26,302,481.08	26,147,574.28	154,906.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	10,300,000.00	10,526,476.37	10,464,481.35	61,995.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	22-Jan-19	5,600,000.00	5,740,003.68	5,764,146.54	-24,142.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	4-Feb-19	2,500,000.00	2,516,210.28	2,501,449.46	14,760.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	19-Feb-19	2,500,000.00	2,524,348.45	2,538,424.91	-14,076.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	4,800,000.00	4,905,975.23	4,954,929.06	-48,953.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21-Dec-18	21-Mar-19	3,100,000.00	3,132,172.43	3,163,426.53	-31,254.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	21-Dec-18	21-Mar-19	480,000.00	513,060.16	513,998.35	-938.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-Dec-18	19-Jun-19	480,000.00	501,440.86	499,307.14	2,133.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26-Dec-18	25-Jan-19	5,700,000.00	5,886,892.31	5,927,107.68	-40,215.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	1,000,000.00	1,020,225.21	1,023,630.77	-3,405.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27-Dec-18	27-Mar-19	4,700,000.00	4,870,317.16	4,923,417.72	-53,100.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28-Dec-18	27-Dec-19	5,600,000.00	5,704,321.69	5,855,792.59	-151,470.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,705,060,000.00	1,775,088,968.79	1,787,674,330.63	- 12,585,361.81		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 47 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

e) Oro

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

8. Contratos de compra de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
CME LEAN HOGS 19-02-2019	26/12/2018	19/02/2019	20,000.00	1,205,000.00	1,219,500.00	14,500.00	USD	Bolsa de Chicago
CME LEAN HOGS 19-02-2019	28/12/2018	19/02/2019	6,400.00	385,600.00	390,240.00	4,640.00	USD	Bolsa de Chicago
CME LEAN HOGS 19-02-2019	27/12/2018	19/02/2019	3,600.00	216,900.00	219,510.00	2,610.00	USD	Bolsa de Chicago
Total			30,000.00	1,807,500.00	1,829,250.00	21,750.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

e) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 48 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

9. Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
NASDAQ 100 E-MINI 03-2019	27/12/2018	15/03/2019	400.00	2,480,000.00	2,533,300.00	53,300.00	USD	Bolsa de Chicago
NASDAQ 100 E-MINI 03-2019	28/12/2018	15/03/2019	200.00	1,240,000.00	1,266,650.00	26,650.00	USD	Bolsa de Chicago
NASDAQ 100 E-MINI 03-2019	31/12/2018	15/03/2019	300.00	1,905,000.00	1,899,975.00	(5,025.00)	USD	Bolsa de Chicago
Total			900.00	5,625,000.00	5,699,925.00	74,925.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

e) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

10. Inversiones en otras obligaciones DOP

Codigo ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participacion
N/A	BANCO MULTIPLE SANTA CRUZ	848,976,109.22	848,976,109.22	N/A	N/A	DOP	100.00%
Total		848,976,109.22	848,976,109.22	N/A			100%



LPHA Sociedad de Valores, S. A.

formación Suplementaria

NEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN al 31 de diciembre de 2018 y 2017 (valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 49 de 163

1. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

) Títulos Valores de Deuda DOP

Código ISIN	Títulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de participación
DO2015200226	COMIRDOM 12.00% 18-SEP-2028	195,586.00	N/A	195,581.64	-	DOP	OTC	100%
Total		195,586.00		195,581.64				

) Títulos Valores de Deuda USD

Nota: Tasa al cierre de mes 50.2762

Código ISIN	Títulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de participación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

) Acciones

Código ISIN	Acciones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

) Inversiones en otras obligaciones

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de participación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)

Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 111 de 163

Al 31 de diciembre de 2017

Equivalentes de efectivo USD

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
N/A	Banco Popular Dominicano	10,000,000	10,000,000	10,000,000	-	USD	40.00%
N/A	Banco Popular Dominicano	10,000,000	10,000,000	10,000,000	-	USD	40.00%
N/A	BANCO LAFISE	5,000,000	5,000,000	5,000,000	-	USD	20.00%
Total		25,000,000	25,000,000	25,000,000	-		

Certificado financiero DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
N/A	BANCO SANTA CRUZ	1,090,678,043.00	1,090,678,043.00	1,090,678,043.00	-	DOP	100.00%
Total		1,090,678,043.00	1,090,678,043.00	1,090,678,043.00	-		

1- Acciones

Acciones guaraníes (GS)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	Banco Continental	83,443	26,556,450,000.00	25,032,900,000.00	(1,523,550,000.00)	GS	BVPASA	100%
Total		83,443	26,556,450,000.00	25,032,900,000.00	(1,523,550,000.00)			

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de GS116.0012 por DOP1.00

Acciones en dólares canadienses (CAD)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A			

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 112 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2- Acciones (continuación)

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Acciones en pesos dominicanos (DOP)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
DO8013300124	GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	121,209	176,126,373.72	177,307,555.43	1,181,181.71	DOP	N/A	50%
DO8013400122	PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	16,217	16,226,730.20	17,876,809.95	1,650,079.75	DOP	N/A	7%
DO8012152021	PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	905	1,100,154.20	1,157,820.80	57,666.60	DOP	N/A	0%
N/A	AFI Universal - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	1,297	15,684,862.36	15,872,452.71	187,590.35	DOP	N/A	1%
N/A	BHD LIQUIDEZ - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	101,140	122,511,663.25	122,498,717.36	(12,945.90)	DOP	N/A	42%
N/A	Reservas - Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	17	17,688.16	18,013.10	324.94	DOP	N/A	0%
N/A	BHD- Fondo Mutuo Renta Fija Plazo 30 días	372	419,405.29	422,460.02	3,054.73	DOP	N/A	0%
Total		241,157	332,086,877.18	335,153,829.37	3,066,952.18			

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
US74348A1604	Proshares Ultrapro SQQQ	24,750	672,430.28	532,372.50	(140,057.78)	USD	N/A	41%
LU0974299876	Globant US	3,000	112,500.00	139,320.00	26,820.00	USD	N/A	11%
N/A	Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 días	2,984	30,520.11	30,796.77	276.66	USD	N/A	2%
N/A	Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	51.29	51,810.20	52,339.91	529.71	USD	N/A	4%
DO9014000119	Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	118	120,253.30	120,665.62	412.32	USD	N/A	9%
DO8013900121	JMMB Fondo de Inversion Cerrado	150	151,505.70	157,731.00	6,225.30	USD	N/A	12%
DO8013800123	Fondo Cerrado De Desarrollo de Sociedades GAM Energía	245	274,412.00	277,510.28	3,098.27	USD	N/A	21%
Total		31,298.29	1,413,431.59	1,310,736.08	(102,695.52)			

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 113 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002243124	BCRD 15.5% 15-MAR-19	3,210,000.00	3,254,811.62	3,507,775.65	252,964.03	DOP	OTC	0.20%
DO1002229321	BCRD 14.5% 19-ENE-18	2,110,000.00	2,111,917.20	2,118,916.86	6,999.66	DOP	OTC	0.13%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	2,160,000.00	2,175,511.89	2,387,262.24	211,750.35	DOP	OTC	0.14%
DO1002235823	BCRD 15.5% 13-JUL-18	28,210,000.00	28,530,743.25	29,442,353.85	911,610.60	DOP	OTC	1.80%
DO1002232721	BCRD 15.5% 29-JUN-18	200,000.00	203,372.05	208,171.60	4,799.55	DOP	OTC	0.01%
DO1002260524	BCRD 12% 22-FEB-19	2,070,000.00	2,048,509.90	2,175,226.38	126,716.48	DOP	OTC	0.13%
DO1002249022	BCRD 14% 18-OCT-19	3,510,000.00	3,543,118.47	3,887,156.52	344,038.05	DOP	OTC	0.22%
DO1002251523	BCRD 13% 20-MAR-20	410,000.00	426,594.30	452,624.01	26,029.71	DOP	OTC	0.03%
DO1002240229	BCRD 15.5% 11-ENE-19	12,980,000.00	13,568,018.14	14,022,216.12	454,197.98	DOP	OTC	0.83%
DO1002243223	BCRD 15.5% 19-ABR-19	2,750,000.00	2,923,497.49	3,024,681.00	101,183.51	DOP	OTC	0.18%
DO1002213325	BCRD 12% 07-ENE-22	1,000,000.00	1,041,176.32	1,106,407.00	65,230.68	DOP	OTC	0.06%
DO1002237027	BCRD 15.5% 05-OCT-18	22,320,000.00	22,826,643.34	23,689,599.84	862,956.50	DOP	OTC	1.42%
DO1002253727	BCRD 13% 07-AGO-20	20,000.00	21,636.43	22,304.48	668.05	DOP	OTC	0.00%
DO1002213424	BCRD 10.5% 10-ENE-20	40,000.00	40,000.84	41,991.80	1,990.96	DOP	OTC	0.00%
DO1002231822	BCRD 14.5% 30-MAR-18	20,000.00	20,214.45	20,360.54	146.09	DOP	OTC	0.00%
DO1002249923	BCRD 13% 03-ENE-20	4,000,000.00	4,217,123.59	4,380,552.00	163,428.41	DOP	OTC	0.25%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	26,680,000.00	27,615,205.67	28,367,856.84	752,651.17	DOP	OTC	1.70%
DO1002217425	BCRD 10.50% 04-OCT-2024	870,000.00	886,505.42	884,361.96	-2,143.46	DOP	OTC	0.06%
DO1002216112	BCRD 11% 03-FEB-23	3,500,000.00	3,729,065.69	3,729,344.50	278.81	DOP	OTC	0.22%
DO1002215726	BCRD 11% 30-SEPT-22	100,000.00	100,152.69	106,788.30	6,635.61	DOP	OTC	0.01%
DO1002214521	BCRD 11% 15-JUL-22	230,000.00	227,637.04	246,319.88	18,682.84	DOP	OTC	0.01%
DO1002260722	BCRD 12% 05-ABR-19	1,800,000.00	1,839,505.10	1,899,975.60	60,470.50	DOP	OTC	0.11%
DO1002216625	BCRD 11% 15-SEPT-2023	4,880,000.00	5,117,682.34	5,162,566.64	44,884.30	DOP	OTC	0.31%
DO1002216427	BCRD 11% 23-JUN-23	5,000,000.00	5,410,964.43	5,314,695.00	-96,269.43	DOP	OTC	0.32%
DO1002216724	BCRD 11% 05-ENE-2024	3,200,000.00	3,452,623.50	3,371,385.60	-81,237.90	DOP	OTC	0.20%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	101,400,000.00	104,813,717.40	105,975,675.00	1,161,957.60	DOP	OTC	6.46%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	100,000.00	102,043.70	102,926.00	882.3	DOP	OTC	0.01%
DO1005205013	MHRD 10.38% 06-MAR-26	43,700,000.00	44,258,425.24	44,235,499.80	-22,925.44	DOP	OTC	2.78%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	1,800,000.00	1,823,917.39	1,870,266.60	46,349.21	DOP	OTC	0.11%
DO1005205310	MHRD 11% 06-NOV-26	87,900,000.00	89,288,238.10	91,912,898.70	2,624,660.60	DOP	OTC	5.60%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	59,300,000.00	60,083,736.65	61,851,738.30	1,768,001.65	DOP	OTC	3.78%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	97,700,000.00	98,987,878.74	101,613,275.80	2,625,397.06	DOP	OTC	6.23%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	335,700,000.00	347,391,246.37	360,437,061.60	13,045,815.23	DOP	OTC	21.39%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	389,800,000.00	393,458,975.74	402,388,201.20	8,929,225.46	DOP	OTC	24.84%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	13,400,000.00	14,911,887.54	14,389,295.20	-522,592.34	DOP	OTC	0.85%
DO1005241125	MHRD 16.95% 04-FEB-22	151,500,000.00	187,403,632.59	189,356,668.50	1,953,035.91	DOP	OTC	9.65%
DO2009305916	EGE HAINA 11.5% 21-JUL-26 [E9]	60,000.00	59,999.92	60,655.92	656	DOP	OTC	0.00%
DO2013000529	CONSORCIO REMIX 12% 27-ABR-19	2,257,100.00	2,260,810.51	2,125,475.86	(135,334.65)	DOP	OTC	0.14%
DO2013000412	CONSORCIO REMIX 11.75% 27-07-1	252,000.00	252,000.00	244,722.04	(7,277.96)	DOP	OTC	0.02%
DO2009307714	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E7]	300,000.00	322,106.99	318,311.40	(3,795.59)	DOP	OTC	0.02%
DO2009307615	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E6]	545,000.00	569,798.02	578,265.71	8,467.69	DOP	OTC	0.03%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 114 de 163

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda en DOP (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO2009307813	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E8]	288,000.00	301,104.28	305,578.94	4,474.66	DOP	OTC	0.02%
DO2009307110	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E1]	1,057,554.00	1,057,554.00	1,137,616.13	80,062.13	DOP	OTC	0.07%
DO2009307318	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E3]	1,195,722.00	1,195,722.00	1,286,244.13	90,522.13	DOP	OTC	0.08%
DO2009307219	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E2]	1,188,233.00	1,188,233.00	1,278,188.18	89,955.18	DOP	OTC	0.08%
DO2009308514	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	3,000,000.00	3,138,367.81	3,138,501.00	133.19	DOP	OTC	0.19%
DO2009308712	EHE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	64,197,277.00	67,158,222.64	67,161,072.69	2,850.05	DOP	OTC	4.09%
DO2009308811	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	400,000.00	417,266.31	418,466.80	1,200.49	DOP	OTC	0.03%
DO1002217029	BCRD 0% 05-ENE-2018	30,000,000.00	29,962,940.30	29,960,100.00	(2,840.30)	DOP	OTC	1.91%
DO2006802923	PARVAL 9.45% 22-09-2018	311	309.4	311	1.6	DOP	OTC	0.00%
DO2006802022	PARVAL 9.75% 22-SEPT-18 [E2]	1,000,000.00	1,000,000.00	999,994.00	(6)	DOP	OTC	0.06%
DO2012502624	ALNAP 10.75% 08-SEP-2024 [E6]	48,894,136.00	48,894,136.00	51,006,362.68	2,112,226.68	DOP	OTC	3.12%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	200,000.00	223,231.60	228,875.20	5,643.60	DOP	OTC	0.01%
DO1005251025	MHRD 18.5% 04-FEB-28	1,000,000.00	1,451,994.22	1,411,445.00	(40,549.22)	DOP	OTC	0.06%
Total		1,569,405,333.00	1,637,309,727.62	1,675,364,587.59	38,054,859.97			100%

31 de diciembre de 2017

En USD (*):

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
USP3579EAG28	MH DOMREP 8.63% 20-ABR-27	4,114,000.00	4,784,997.49	4,996,041.60	211,044.11	USD	OTC	14.04%
USP3579EAT49	MHRD 6.6% 28-ENE-24	21,000.00	22,034.67	23,558.01	1,523.34	USD	OTC	0.07%
DO1005244525	MH CDEEE 7% 31-JUL-23	210,000.00	227,602.83	232,422.96	4,820.13	USD	OTC	0.72%
USP3579EAY34	MH DOMREP 7.45% 30-ABR-44 [REG	12,000.00	12,000.00	14,387.40	2,387.40	USD	OTC	0.04%
USP3579EBK21	MHRD 6.88% 29-ENE-26	191,000.00	220,982.29	219,336.76	(1,645.53)	USD	OTC	0.65%
DO1005205716	MHRD 6.00% 05-MAR-2027	1,397,000.00	1,497,805.36	1,535,582.40	37,777.04	USD	OTC	4.77%
DO2014300910	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E9]	189,460.00	189,460.00	206,730.79	17,270.79	USD	OTC	0.65%
DO2014301116	DPP 6.25% 31-MAR-2027 [E11]	166,124.00	166,124.00	181,406.58	15,282.58	USD	OTC	0.57%
DO2009360416	EGE HAINA 6% 17-MAR-20 [E7]	2,000.00	2,013.33	1,999.85	(13.48)	USD	OTC	0.01%
DO2009303911	EGE HAINA 5.75% 27-MAY-20 [E9]	2,000.00	1,988.99	1,999.96	10.97	USD	OTC	0.01%
DO2014304011	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E40]	9,256.00	9,323.09	10,128.75	805.66	USD	OTC	0.03%
DO2014304110	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E41]	304,003.00	304,003.00	327,133.37	23,130.37	USD	OTC	1.04%
DO2014304912	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E49]	858,809.00	858,809.00	918,769.33	59,960.33	USD	OTC	2.93%
DO2014304813	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E48]	799,111.00	799,111.00	854,903.33	55,792.33	USD	OTC	2.73%
DO2014305216	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E52]	648,996.00	648,996.00	694,307.60	45,311.60	USD	OTC	2.21%
DO2014305117	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E51]	699,477.00	699,477.00	748,313.09	48,836.09	USD	OTC	2.39%
DO2014305018	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E50]	700,018.00	700,018.00	748,891.86	48,873.86	USD	OTC	2.39%
DO2009904510	CEPM 5.50% 20-NOV-2027	1,081,399.00	1,081,399.00	1,114,961.30	33,562.30	USD	OTC	3.69%
DO2014304318	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E43]	2,158,090.00	2,238,467.17	2,322,290.44	83,823.27	USD	OTC	7.36%
DO2014304417	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E44]	9,334.00	10,118.48	10,044.19	(74.29)	USD	OTC	0.03%
DO2014304615	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E46]	113,489.00	123,027.27	122,123.92	(903.35)	USD	OTC	0.39%
DO2014304516	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E45]	588,277.00	637,719.18	633,036.64	(4,682.54)	USD	OTC	2.01%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 115 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda (continuación)

En USD (*): (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO2014304219	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E42]	1,937,558.00	2,100,224.93	2,084,979.04	(15,245.89)	USD	OTC	6.61%
DO2013001022	CONSORCIO REMIX 6.55% 15-DIC-2	584,017.00	584,017.00	584,006.20	(10.80)	USD	OTC	1.99%
USP10475AA22	BANRESERVAS 7% 01-FEB-23	623,000.00	625,438.93	660,934.47	35,495.54	USD	OTC	2.13%
DO2014800117	EDENORTE 10% 15-JUL-2020	6,566,079.00	3,984,527.51	3,861,339.98	(123,187.53)	USD	OTC	22.41%
DO2014700119	EDESUR 10% 15-JUL-2020	5,319,975.00	3,228,347.81	3,128,538.69	(99,809.12)	USD	OTC	18.15%
Total		29,305,472.00	25,758,033.33	26,238,168.51	480,135.18			100%

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de DOP48.29 por USD1.00.

31 de diciembre de 2017

4. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0923	28/12/2017	02/01/2018	10,000,000	10,804,635	10,579,030	(225,605)	DOP	BVRD
MH0227	29/12/2017	02/01/2018	160,000,000	177,173,120	166,408,640	(10,764,480)	DOP	BVRD
MH0227	29/12/2017	04/01/2018	190,000,000	210,386,050	197,610,260	(12,775,790)	DOP	BVRD
Total			360,000,000	398,363,805	374,597,930	(23,765,875)		

b) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

c) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

d) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 116 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

4. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda En DOP (continuación)

e) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0923	28/12/2017	02/01/2018	10,000,000	10,804,635	10,579,030	225,605	DOP	BVRD
MH0332	29/12/2017	04/01/2018	190,000,000	219,206,420	204,000,720	15,205,700	DOP	BVRD
MH0332	29/12/2017	02/01/2018	160,000,000	184,597,760	171,790,080	12,807,680	DOP	BVRD
Total			360,000,000	414,608,815	386,369,830	28,238,985		

b) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de DOP46.7111 por USD1.00

c) Acciones en DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CUOGAM	28/12/2017	03/01/2018	339.00	499,302.93	495,897.68	3,405.25	DOP	BVRD
Total			339.00	499,302.93	495,897.68	3,405.25		

d) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

e) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 117 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5. - Contratos de compra forward a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	29/09/2017	30/01/2018	53,000,000.00	53,954,114.78	54,909,033.71	954,918.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	14,000,000.00	14,152,614.00	15,015,235.95	862,621.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	03/01/2018	11,150,000.00	11,399,018.36	11,822,748.30	423,729.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	5,500,000.00	5,546,106.50	5,898,842.69	352,736.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	5,000,000.00	4,963,220.00	5,278,672.84	315,452.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/09/2017	05/01/2018	14,400,000.00	14,836,606.48	15,040,561.78	203,955.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/03/2017	12/03/2018	3,770,000.00	3,754,283.75	3,947,530.16	193,246.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	11,010,000.00	11,404,733.66	11,597,353.22	192,619.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/07/2017	11/01/2018	5,100,000.00	5,287,751.40	5,468,749.98	180,998.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/07/2017	08/01/2018	5,500,000.00	5,725,478.00	5,899,428.27	173,950.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	2,700,000.00	2,721,116.70	2,893,495.80	172,379.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/06/2017	28/06/2018	2,200,000.00	2,160,435.20	2,324,287.90	163,852.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/09/2017	10/01/2018	4,600,000.00	4,614,807.54	4,774,812.43	160,004.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/07/2017	19/07/2018	1,400,000.00	1,324,224.50	1,475,005.39	150,780.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,800,000.00	1,784,786.40	1,929,188.84	144,402.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/07/2017	19/07/2018	5,500,000.00	5,657,971.00	5,799,748.21	141,777.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/08/2017	30/07/2018	3,000,000.00	2,922,022.01	3,063,201.26	141,179.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	6,800,000.00	7,030,302.34	7,170,458.76	140,156.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	17/01/2018	10,720,000.00	11,203,783.84	11,334,766.02	130,982.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/08/2017	21/02/2018	3,900,000.00	3,910,641.72	4,032,684.50	122,042.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	17/01/2018	10,250,000.00	10,716,208.90	10,837,812.66	121,603.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/09/2017	05/03/2018	8,500,000.00	8,671,163.96	8,789,519.65	118,355.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/06/2017	13/06/2018	5,200,000.00	5,226,034.37	5,344,202.05	118,167.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/08/2017	14/02/2018	5,800,000.00	5,887,366.35	6,000,703.52	113,337.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	11/01/2018	3,500,000.00	3,519,394.16	3,632,707.73	113,313.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/06/2017	07/06/2018	1,900,000.00	1,898,307.10	2,011,129.72	112,822.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	11/07/2018	2,300,000.00	2,252,455.52	2,357,391.40	104,935.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	20/04/2018	2,370,000.00	2,357,120.82	2,461,727.43	104,606.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/12/2017	17/01/2018	4,700,000.00	4,773,067.50	4,874,824.44	101,756.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	04/01/2018	2,900,000.00	2,911,078.77	3,011,707.69	100,628.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/07/2017	12/04/2018	1,200,000.00	1,139,423.89	1,238,344.59	98,920.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/02/2017	09/02/2018	1,670,000.00	1,661,339.37	1,758,383.55	97,044.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	09/08/2018	2,400,000.00	2,353,638.12	2,448,531.47	94,893.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/03/2017	15/03/2018	1,650,000.00	1,633,712.73	1,726,924.77	93,212.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	04/01/2018	3,600,000.00	3,669,193.86	3,760,470.38	91,276.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	09/04/2018	4,500,000.00	4,555,513.94	4,642,709.89	87,195.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/09/2017	27/03/2018	1,800,000.00	1,770,268.76	1,857,045.70	86,776.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/10/2017	11/01/2018	2,300,000.00	2,301,153.92	2,387,253.28	86,099.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,100,000.00	1,095,012.30	1,178,795.37	83,783.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	4,610,000.00	4,777,834.77	4,861,615.96	83,781.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/09/2017	27/03/2018	7,700,000.00	7,866,237.46	7,949,476.33	83,238.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	2,110,000.00	2,147,275.72	2,230,179.47	82,903.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores

31 de diciembre de 2017

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 118 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

5. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	9,310,000.00	9,722,922.74	9,805,547.70	82,624.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	16/01/2018	9,800,000.00	10,082,651.60	10,165,222.72	82,571.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/01/2017	05/01/2018	500,000.00	437,955.59	519,238.06	81,282.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	3,300,000.00	3,330,817.50	3,411,701.34	80,883.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/09/2017	27/03/2018	1,800,000.00	1,777,774.17	1,857,045.70	79,271.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	16/02/2018	8,800,000.00	9,177,099.57	9,253,358.35	76,258.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	05/01/2018	8,140,000.00	8,553,732.62	8,627,361.48	73,628.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/09/2017	03/01/2018	1,200,000.00	1,174,638.49	1,246,318.22	71,679.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	900,000.00	894,229.20	965,265.17	71,035.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	15/02/2018	9,560,000.00	9,981,285.66	10,051,608.20	70,322.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	3,160,000.00	3,236,814.97	3,303,643.62	66,828.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/04/2017	05/04/2018	500,000.00	451,197.00	515,950.54	64,753.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2017	31/01/2018	1,920,000.00	1,960,844.38	2,024,794.50	63,950.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	07/02/2018	4,660,000.00	4,843,637.01	4,907,067.73	63,430.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	971,625.63	1,034,831.77	63,206.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/10/2017	18/04/2018	4,200,000.00	4,270,780.74	4,332,489.76	61,709.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/10/2017	11/01/2018	900,000.00	872,966.23	934,142.59	61,176.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/09/2017	07/09/2018	1,600,000.00	1,569,929.60	1,630,166.32	60,236.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,320,967.38	2,380,113.06	59,145.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/09/2017	01/03/2018	1,000,000.00	975,119.17	1,033,864.55	58,745.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	10/04/2018	3,000,000.00	3,035,714.90	3,094,024.07	58,309.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/07/2017	15/01/2018	500,000.00	461,001.27	518,744.22	57,742.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	3,350,000.00	3,469,784.40	3,527,125.12	57,340.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/08/2017	20/02/2018	1,000,000.00	979,266.26	1,034,037.70	54,771.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	1,290,000.00	1,309,590.70	1,364,128.36	54,537.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/09/2017	20/03/2018	1,600,000.00	1,598,218.57	1,652,589.93	54,371.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	16/01/2018	4,560,000.00	4,769,109.06	4,822,594.04	53,484.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/09/2017	22/03/2018	800,000.00	773,139.19	825,784.98	52,645.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/10/2017	10/01/2018	200,000.00	155,030.32	207,596.90	52,566.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/09/2017	16/03/2018	800,000.00	775,146.83	826,179.01	51,032.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	983,902.54	1,034,831.77	50,929.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	12/04/2018	3,800,000.00	3,871,368.10	3,921,424.53	50,056.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 119 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	20/09/2017	21/03/2018	500,000.00	467,235.10	516,396.28	49,161.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/09/2017	22/03/2018	500,000.00	466,953.04	516,055.00	49,101.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	29/03/2018	600,000.00	570,359.22	618,914.91	48,555.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	22/02/2018	3,360,000.00	3,480,362.15	3,528,196.03	47,833.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/04/2018	3,500,000.00	3,562,584.31	3,610,408.13	47,823.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	21/02/2018	6,140,000.00	6,402,530.71	6,450,152.92	47,622.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	3,810,000.00	3,964,532.87	4,012,001.73	47,468.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	16/01/2018	1,000,000.00	989,900.21	1,037,267.62	47,367.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	05/01/2018	6,600,000.00	6,806,584.26	6,853,662.43	47,078.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	04/01/2018	700,000.00	680,564.92	726,957.57	46,392.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,347,915.40	1,394,271.91	46,356.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	5,590,000.00	5,840,136.31	5,886,375.24	46,238.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,064,610.51	1,110,405.90	45,795.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/09/2017	06/03/2018	3,500,000.00	3,572,844.54	3,617,064.22	44,219.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	700,000.00	683,349.83	726,708.92	43,359.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/09/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,202,529.80	1,245,421.82	42,892.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	17/08/2018	300,000.00	265,670.12	306,862.67	41,192.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/10/2017	09/01/2018	900,000.00	893,961.29	935,145.64	41,184.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/07/2017	27/07/2018	700,000.00	675,238.53	715,552.45	40,313.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/08/2017	15/02/2018	1,200,000.00	1,201,589.26	1,241,578.62	39,989.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	06/10/2017	31/01/2018	600,000.00	582,668.58	622,310.02	39,641.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/08/2017	26/02/2018	800,000.00	787,345.90	826,776.99	39,431.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/10/2017	19/01/2018	300,000.00	282,141.62	321,435.65	39,294.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	13/02/2018	4,630,000.00	4,830,583.16	4,869,680.92	39,097.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	22/01/2018	1,980,000.00	2,052,497.53	2,091,383.43	38,885.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	08/02/2018	700,000.00	686,280.48	724,619.22	38,338.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	3,400,000.00	3,542,641.76	3,580,973.38	38,331.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	14/03/2018	600,000.00	581,710.27	619,667.13	37,956.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	2,330,000.00	2,419,622.21	2,457,537.02	37,914.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/08/2017	22/02/2018	1,300,000.00	1,306,483.38	1,344,107.35	37,623.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/05/2017	28/08/2018	800,000.00	803,179.47	840,560.01	37,380.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	18/06/2018	200,000.00	167,783.85	205,138.70	37,354.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 120 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	860,000.00	871,184.88	908,441.87	37,256.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,208,341.89	1,245,370.86	37,028.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2017	05/02/2018	1,880,000.00	1,943,773.14	1,980,459.87	36,686.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/04/2018	500,000.00	478,555.13	515,188.78	36,633.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/08/2017	13/02/2018	2,630,000.00	2,729,605.88	2,766,147.05	36,541.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	200,000.00	178,002.44	214,375.61	36,373.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/08/2017	20/02/2018	1,500,000.00	1,515,579.91	1,551,056.55	35,476.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	01/02/2018	3,300,000.00	3,444,413.39	3,479,093.01	34,679.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	2,770,000.00	2,882,280.57	2,916,458.68	34,178.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	500,000.00	483,009.23	515,676.14	32,666.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/01/2017	11/01/2018	1,070,000.00	1,100,464.21	1,132,803.48	32,339.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	14/02/2018	4,700,000.00	4,831,691.31	4,863,279.45	31,588.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	2,270,000.00	2,363,944.71	2,394,252.81	30,308.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/08/2017	21/08/2018	600,000.00	581,056.86	611,120.90	30,064.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/01/2018	300,000.00	281,448.56	311,374.57	29,926.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/03/2017	14/03/2018	4,340,000.00	4,512,417.80	4,542,170.14	29,752.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/01/2018	400,000.00	385,761.10	414,828.39	29,067.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	300,000.00	293,076.00	321,499.53	28,423.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/01/2018	2,340,000.00	2,450,326.32	2,478,188.15	27,861.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/12/2017	19/06/2018	200,000.00	177,768.68	205,123.06	27,354.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/07/2017	05/07/2018	1,500,000.00	1,512,086.28	1,539,349.20	27,262.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	15/01/2018	18,080,000.00	19,098,160.65	19,124,955.00	26,794.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/08/2017	05/04/2018	1,200,000.00	1,211,305.24	1,238,063.21	26,757.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/10/2017	03/01/2018	300,000.00	295,234.35	321,935.11	26,700.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	3,000,000.00	3,074,942.69	3,101,546.67	26,603.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/11/2017	22/05/2018	200,000.00	179,100.41	205,560.78	26,460.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/07/2017	12/01/2018	1,620,000.00	1,688,513.42	1,714,753.28	26,239.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16/10/2017	12/04/2018	3,900,000.00	3,996,004.21	4,022,236.88	26,232.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/03/2018	300,000.00	285,588.00	311,749.95	26,161.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	1,320,000.00	1,368,567.61	1,394,255.62	25,688.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/07/2017	23/01/2018	1,180,000.00	1,220,915.43	1,246,128.85	25,213.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	12/01/2018	800,000.00	805,436.47	830,264.23	24,827.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	01/03/2018	4,460,000.00	4,655,445.45	4,680,044.54	24,599.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	16/01/2018	5,000,000.00	5,162,065.20	5,186,467.84	24,402.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	9,140,000.00	9,550,478.64	9,574,387.82	23,909.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	07/12/2017	06/04/2018	200,000.00	184,965.04	207,737.90	22,772.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	08/01/2018	1,000,000.00	1,015,809.41	1,038,175.11	22,365.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	8,850,000.00	9,274,337.10	9,296,654.92	22,317.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 121 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,500,000.00	1,557,410.68	1,579,620.40	22,209.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	3,110,000.00	3,253,355.50	3,275,537.42	22,181.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	1,560,000.00	1,626,121.95	1,647,813.97	21,692.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	200,000.00	192,457.35	214,083.87	21,626.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/09/2017	26/01/2018	1,100,000.00	1,118,467.12	1,139,912.67	21,445.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	22/01/2018	1,540,000.00	1,606,422.05	1,626,914.55	20,492.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	16/01/2018	200,000.00	193,930.61	214,354.32	20,423.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	04/01/2018	1,500,000.00	1,546,515.77	1,566,862.66	20,346.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	410,000.00	410,141.14	430,268.44	20,127.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	2,830,000.00	2,955,272.86	2,975,319.42	20,046.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/09/2017	06/03/2018	2,100,000.00	2,150,197.34	2,170,238.53	20,041.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	400,000.00	395,273.89	415,228.89	19,955.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	13/02/2018	5,840,000.00	6,123,294.46	6,143,145.12	19,850.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	30/01/2018	1,850,000.00	1,931,408.96	1,951,172.51	19,763.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	26/01/2018	2,300,000.00	2,407,679.46	2,427,426.45	19,746.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/10/2017	10/01/2018	2,300,000.00	2,367,751.31	2,387,448.06	19,696.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	23/01/2018	2,770,000.00	2,905,768.51	2,925,234.68	19,466.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/07/2017	24/01/2018	1,260,000.00	1,311,730.96	1,330,343.96	18,613.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/09/2017	26/01/2018	1,800,000.00	1,846,700.55	1,865,311.65	18,611.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	7,600,000.00	8,015,698.63	8,034,003.07	18,304.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/01/2018	2,360,000.00	2,481,981.61	2,499,289.94	17,308.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	15/01/2018	8,890,000.00	9,386,567.10	9,403,576.97	17,009.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	2,780,000.00	2,909,985.20	2,926,812.32	16,827.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	3,660,000.00	3,810,561.42	3,827,082.24	16,520.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	17/11/2017	15/02/2018	300,000.00	296,046.29	312,473.11	16,426.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	22/01/2018	760,000.00	786,361.11	802,781.17	16,420.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	10/01/2018	300,000.00	295,002.61	311,395.35	16,392.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	900,000.00	934,909.58	951,203.54	16,293.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	880,000.00	913,426.78	929,503.75	16,076.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/10/2017	18/01/2018	600,000.00	606,407.57	622,242.58	15,835.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	660,000.00	682,159.02	697,549.26	15,390.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	980,000.00	1,018,204.46	1,033,389.64	15,185.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	19/02/2018	300,000.00	297,376.31	312,371.21	14,994.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/01/2018	1,700,000.00	1,748,384.54	1,763,187.81	14,803.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	200,000.00	196,135.92	210,905.97	14,770.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/07/2017	10/07/2018	200,000.00	197,146.60	211,668.74	14,522.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/04/2018	200,000.00	191,571.65	206,043.50	14,471.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/07/2017	10/07/2018	200,000.00	197,331.20	211,668.74	14,337.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	12/01/2018	300,000.00	297,090.55	311,342.72	14,252.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	30/01/2018	1,720,000.00	1,799,858.37	1,814,063.09	14,204.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	3,590,000.00	3,744,578.17	3,758,762.79	14,184.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 122 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,000,000.00	1,039,256.27	1,053,080.26	13,823.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/12/2017	09/01/2018	200,000.00	193,878.75	207,631.12	13,752.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	3,800,000.00	3,974,725.75	3,987,481.89	12,756.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/09/2017	21/03/2018	200,000.00	193,930.14	206,462.66	12,532.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	22/01/2018	1,590,000.00	1,666,455.06	1,678,860.22	12,405.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/09/2017	12/03/2018	200,000.00	194,269.17	206,589.13	12,319.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/02/2017	09/02/2018	2,890,000.00	3,031,013.69	3,042,951.17	11,937.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/08/2017	22/02/2018	900,000.00	918,720.01	930,607.72	11,887.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	1,230,000.00	1,285,527.68	1,297,266.05	11,738.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/09/2017	03/01/2018	500,000.00	507,579.82	519,299.26	11,719.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/07/2017	16/01/2018	450,000.00	464,300.03	475,951.06	11,651.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	630,000.00	654,259.31	665,842.48	11,583.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	05/01/2018	710,000.00	740,944.08	752,509.42	11,565.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	500,000.00	507,486.42	519,001.35	11,514.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	1,580,000.00	1,654,586.11	1,666,077.18	11,491.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	17/01/2018	1,200,000.00	1,274,659.72	1,285,998.13	11,338.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	12/01/2018	2,100,000.00	2,168,127.80	2,179,399.01	11,271.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/10/2017	25/04/2018	1,400,000.00	1,431,051.37	1,442,289.71	11,238.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	04/05/2018	720,000.00	734,441.44	745,562.21	11,120.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/03/2017	15/03/2018	870,000.00	899,366.85	910,355.65	10,988.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/04/2017	24/04/2018	920,000.00	944,430.41	955,327.49	10,897.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	440,000.00	453,275.49	464,170.64	10,895.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2017	13/02/2018	4,630,000.00	4,859,007.84	4,869,680.92	10,673.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	3,440,000.00	3,603,718.62	3,614,322.17	10,603.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	27/04/2018	1,120,000.00	1,151,819.17	1,162,342.26	10,523.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	450,000.00	464,104.09	474,561.21	10,457.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/08/2017	13/02/2018	800,000.00	831,246.85	841,413.55	10,166.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/07/2017	04/01/2018	900,000.00	955,594.81	965,744.27	10,149.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/07/2017	08/01/2018	530,000.00	551,356.74	561,434.48	10,077.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31/10/2017	12/01/2018	200,000.00	204,395.00	214,439.49	10,044.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/03/2017	02/03/2018	1,600,000.00	1,669,066.63	1,679,096.37	10,029.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	25/01/2018	2,290,000.00	2,407,470.82	2,417,359.89	9,889.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/01/2018	450,000.00	467,363.84	477,232.62	9,868.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	24/01/2018	400,000.00	412,482.69	422,331.42	9,848.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	7,040,000.00	7,445,951.05	7,455,745.55	9,794.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2017	25/01/2018	460,000.00	475,863.35	485,602.24	9,738.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,950,000.00	2,030,590.75	2,040,122.95	9,532.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	12/06/2018	200,000.00	195,605.71	205,134.50	9,528.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	11/01/2018	680,000.00	710,423.75	719,844.95	9,421.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	930,000.00	975,739.33	984,920.93	9,181.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	560,000.00	583,947.95	593,051.85	9,103.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	04/05/2018	330,000.00	332,464.39	341,552.76	9,088.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,210,000.00	1,265,199.57	1,274,152.78	8,953.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	25/01/2018	470,000.00	487,306.99	496,139.37	8,832.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 123 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	01/11/2017	02/05/2018	200,000.00	203,466.25	212,244.11	8,777.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2017	06/02/2018	890,000.00	928,600.96	937,372.44	8,771.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	15/01/2018	410,000.00	425,015.48	433,685.78	8,670.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	2,110,000.00	2,199,710.77	2,208,370.46	8,659.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/10/2017	02/03/2018	200,000.00	204,971.81	213,598.40	8,626.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	25/01/2018	370,000.00	381,972.65	390,577.80	8,605.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	340,000.00	350,945.49	359,537.71	8,592.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2017	05/02/2018	890,000.00	928,978.91	937,558.13	8,579.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	360,000.00	371,452.89	379,722.96	8,270.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/08/2017	30/01/2018	450,000.00	466,356.17	474,609.53	8,253.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25/10/2017	25/01/2018	600,000.00	634,276.71	642,488.02	8,211.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	02/04/2018	300,000.00	301,258.83	309,430.00	8,171.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/07/2017	12/01/2018	870,000.00	912,779.30	920,886.02	8,106.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	18/01/2018	420,000.00	436,027.80	443,984.38	7,956.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	450,000.00	467,378.07	475,314.42	7,936.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	30/01/2018	930,000.00	973,025.89	980,859.70	7,833.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/03/2017	29/03/2018	150,000.00	148,918.79	156,648.56	7,729.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	16/05/2018	190,000.00	188,714.11	196,174.34	7,460.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/08/2017	31/01/2018	1,000,000.00	1,028,481.91	1,035,925.16	7,443.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	470,000.00	489,367.72	496,739.63	7,371.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	470,000.00	487,649.25	495,016.91	7,367.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	02/03/2018	740,000.00	769,123.31	776,366.07	7,242.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/08/2017	13/02/2018	400,000.00	413,469.56	420,706.77	7,237.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	12/01/2018	4,100,000.00	4,332,370.31	4,339,369.03	6,998.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	17/01/2018	190,000.00	193,918.91	200,890.52	6,971.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/02/2018	520,000.00	541,242.39	548,140.16	6,897.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/03/2018	1,320,000.00	1,375,301.79	1,382,052.06	6,750.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	17/11/2017	15/02/2018	100,000.00	102,374.96	109,055.97	6,681.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	20/02/2018	600,000.00	623,662.81	630,232.72	6,569.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/05/2017	24/05/2018	910,000.00	933,014.53	939,539.38	6,524.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/05/2018	160,000.00	159,011.03	165,403.40	6,392.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/10/2017	22/01/2018	1,400,000.00	1,445,008.76	1,451,397.17	6,388.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	16/01/2018	300,000.00	305,085.45	311,180.29	6,094.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	06/02/2018	270,000.00	278,326.02	284,403.76	6,077.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	690,000.00	720,417.65	726,482.49	6,064.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	10/04/2018	4,700,000.00	4,841,359.57	4,847,304.37	5,944.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	1,100,000.00	1,145,807.06	1,151,710.05	5,902.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	700,000.00	730,224.55	736,090.79	5,866.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	22/01/2018	130,000.00	131,642.57	137,317.83	5,675.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	06/02/2018	580,000.00	605,234.85	610,906.67	5,671.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2017	04/01/2018	450,000.00	471,367.78	477,038.35	5,670.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 124 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	16/11/2017	14/02/2018	190,000.00	194,144.16	199,809.81	5,665.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	110,000.00	110,794.91	116,354.72	5,559.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	04/04/2018	370,000.00	380,305.88	385,800.81	5,494.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	10/01/2018	1,600,000.00	1,655,327.13	1,660,775.22	5,448.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	02/03/2018	200,000.00	208,190.50	213,598.40	5,407.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	12/01/2018	230,000.00	238,020.14	243,428.02	5,407.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/10/2017	24/01/2018	200,000.00	201,890.60	207,296.19	5,405.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	140,000.00	142,273.09	147,670.04	5,396.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2017	28/02/2018	460,000.00	477,329.32	482,697.82	5,368.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	920,000.00	967,562.19	972,928.85	5,366.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	1,350,000.00	1,419,703.92	1,424,909.63	5,205.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	370,000.00	382,568.35	387,746.35	5,178.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	12/04/2018	220,000.00	223,634.71	228,714.76	5,080.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	02/07/2018	210,000.00	210,738.56	215,779.04	5,040.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	13/02/2018	130,000.00	131,745.06	136,729.70	4,984.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/06/2018	300,000.00	302,738.13	307,701.74	4,963.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/08/2017	30/01/2018	270,000.00	279,813.70	284,765.72	4,952.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	50,000.00	47,432.20	52,319.29	4,887.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	13/02/2018	550,000.00	573,586.42	578,471.82	4,885.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/09/2017	02/03/2018	200,000.00	208,725.04	213,598.40	4,873.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	190,000.00	195,517.45	200,390.69	4,873.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	50,000.00	47,499.86	52,344.73	4,844.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	100,000.00	100,891.47	105,713.63	4,822.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,190,000.00	1,253,657.55	1,258,462.31	4,804.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	05/03/2018	50,000.00	47,660.21	52,422.97	4,762.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	24/01/2018	920,000.00	966,644.93	971,362.26	4,717.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	15/01/2018	180,000.00	185,684.94	190,398.63	4,713.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	4,730,000.00	4,939,829.79	4,944,409.75	4,579.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	50,000.00	47,942.67	52,515.31	4,572.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/08/2017	07/02/2018	180,000.00	184,988.49	189,543.39	4,554.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	06/03/2018	280,000.00	289,145.38	293,629.83	4,484.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/10/2017	23/01/2018	500,000.00	500,703.52	505,185.56	4,482.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2017	19/07/2018	80,000.00	77,561.90	81,952.75	4,390.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2017	25/01/2018	130,000.00	132,987.52	137,240.79	4,253.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	210,000.00	217,253.86	221,484.45	4,230.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	27/12/2017	26/02/2018	300,000.00	320,209.23	324,417.58	4,208.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	02/02/2018	190,000.00	196,112.83	200,281.98	4,169.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/02/2018	160,000.00	164,345.36	168,492.84	4,147.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	12/01/2018	210,000.00	218,244.59	222,260.37	4,015.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	12/01/2018	1,830,000.00	1,932,831.90	1,936,840.32	4,008.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	190,000.00	195,871.44	199,849.16	3,977.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 125 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	510,000.00	531,217.67	535,162.04	3,944.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	610,000.00	636,222.06	640,155.49	3,933.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	120,000.00	121,636.11	125,566.30	3,930.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	110,000.00	111,904.66	115,625.50	3,720.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	460,000.00	481,789.31	485,485.29	3,695.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	110,000.00	111,938.45	115,625.50	3,687.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	280,000.00	291,640.55	295,254.18	3,613.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	28/02/2018	6,410,000.00	6,726,086.86	6,729,625.32	3,538.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	460,000.00	482,035.89	485,485.29	3,449.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	470,000.00	494,196.35	497,639.92	3,443.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/10/2017	02/04/2018	80,000.00	80,043.87	83,447.51	3,403.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	19/03/2018	400,000.00	409,663.77	413,037.72	3,373.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/07/2017	09/01/2018	330,000.00	346,160.82	349,504.71	3,343.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	460,000.00	482,941.09	486,268.61	3,327.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	30/01/2018	280,000.00	292,029.58	295,312.60	3,283.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	280,000.00	289,502.82	292,747.11	3,244.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2017	09/01/2018	210,000.00	219,289.62	222,412.09	3,122.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	13/02/2018	1,120,000.00	1,175,041.15	1,178,137.42	3,096.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	390,000.00	404,712.87	407,754.90	3,042.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	1,160,000.00	1,215,073.97	1,218,113.20	3,039.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	06/07/2017	03/01/2018	200,000.00	205,911.77	208,933.35	3,021.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	04/01/2018	920,000.00	972,303.81	975,278.41	2,974.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	01/02/2018	460,000.00	482,020.01	484,988.47	2,968.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	460,000.00	483,352.05	486,268.61	2,916.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	1,190,000.00	1,256,595.75	1,259,500.86	2,905.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	750,000.00	785,038.79	787,852.11	2,813.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	22/05/2018	310,000.00	317,151.60	319,945.24	2,793.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	440,000.00	453,596.51	456,343.29	2,746.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	430,000.00	449,427.82	452,080.34	2,652.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	09/11/2017	09/03/2018	300,000.00	309,058.29	311,688.30	2,630.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/06/2018	420,000.00	428,046.24	430,552.71	2,506.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	750,000.00	785,859.84	788,355.71	2,495.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	02/02/2018	260,000.00	271,606.92	274,056.12	2,449.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	11/01/2018	700,000.00	724,157.47	726,555.35	2,397.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	20/02/2018	640,000.00	669,805.90	672,196.01	2,390.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	938,764.56	941,085.80	2,321.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	13/02/2018	230,000.00	239,616.03	241,922.66	2,306.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	460,000.00	484,750.41	487,051.84	2,301.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	08/01/2018	230,000.00	241,354.81	243,623.82	2,269.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,510,000.00	1,576,876.86	1,579,038.70	2,161.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19/12/2017	16/02/2018	90,000.00	96,841.37	98,999.77	2,158.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 126 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	300,000.00	315,515.40	317,598.52	2,083.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	01/02/2018	480,000.00	504,030.79	506,074.93	2,044.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	10/01/2018	460,000.00	485,010.68	487,051.84	2,041.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	2,780,000.00	2,912,424.50	2,914,461.06	2,036.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2017	18/01/2018	280,000.00	293,974.11	295,998.15	2,024.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	100,000.00	103,470.24	105,468.78	1,998.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/03/2018	240,000.00	249,429.77	251,416.51	1,986.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	680,000.00	710,644.95	712,614.91	1,969.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2017	05/02/2018	470,000.00	493,189.54	495,114.97	1,925.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	05/01/2018	7,400,000.00	7,682,434.93	7,684,330.93	1,896.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	460,000.00	481,228.22	483,044.89	1,816.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/01/2017	25/01/2018	280,000.00	293,828.48	295,630.31	1,801.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0119	27/10/2017	10/01/2018	420,000.00	451,047.44	452,745.34	1,697.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	3,100,000.00	3,275,438.43	3,277,122.43	1,684.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	1,140,000.00	1,199,045.28	1,200,679.31	1,634.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/12/2017	01/06/2018	200,000.00	204,734.46	206,343.77	1,609.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2017	11/09/2018	110,000.00	109,816.73	111,387.18	1,570.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	440,000.00	460,772.09	462,297.02	1,524.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	27/03/2018	470,000.00	489,345.57	490,817.49	1,471.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	2,740,000.00	2,898,566.31	2,899,968.57	1,402.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	1,230,000.00	1,297,088.95	1,298,407.28	1,318.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	07/02/2018	130,000.00	135,574.25	136,892.45	1,318.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	240,000.00	251,073.60	252,323.91	1,250.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	550,000.00	575,787.54	577,030.27	1,242.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	15/02/2018	330,000.00	345,766.15	346,994.11	1,227.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	04/04/2018	410,000.00	426,369.51	427,509.00	1,139.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/02/2017	02/02/2018	190,000.00	199,204.60	200,322.81	1,118.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	14/05/2018	130,000.00	133,231.76	134,304.73	1,072.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	320,000.00	336,862.73	337,877.88	1,015.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	2,830,000.00	2,990,684.66	2,991,609.04	924.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	11/01/2018	530,000.00	560,145.46	561,066.15	920.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	730,000.00	766,091.10	766,934.34	843.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,740,000.00	5,010,168.01	5,010,970.95	802.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	02/03/2018	220,000.00	230,009.67	230,811.53	801.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	05/01/2018	1,360,000.00	1,440,653.20	1,441,441.02	787.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	90,000.00	94,060.95	94,801.25	740.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/01/2017	18/01/2018	90,000.00	94,432.43	95,153.28	720.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2017	31/01/2018	210,000.00	220,733.23	221,451.27	718.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	05/02/2018	280,000.00	294,248.03	294,962.11	714.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	10/01/2018	250,000.00	264,007.85	264,702.09	694.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	1,070,000.00	1,122,688.04	1,123,381.12	693.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 127 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	13/10/2017	08/02/2018	400,000.00	427,149.71	427,800.02	650.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/02/2017	15/02/2018	710,000.00	746,073.76	746,720.41	646.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,320,000.00	1,395,353.89	1,395,977.73	623.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	19/04/2018	90,000.00	92,834.73	93,447.77	613.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8,350,000.00	8,826,518.68	8,827,087.83	569.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	3,200,000.00	3,353,876.72	3,354,444.04	567.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	18/01/2018	190,000.00	200,446.83	200,850.08	403.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/10/2017	06/04/2018	200,000.00	204,941.00	205,311.40	370.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	410,000.00	429,343.72	429,707.95	364.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	19/02/2018	460,000.00	482,899.04	483,236.87	337.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	340,000.00	358,228.07	358,522.94	294.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	22/05/2018	240,000.00	247,224.34	247,497.71	273.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	890,000.00	932,464.14	932,687.17	223.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	12/02/2018	1,370,000.00	1,441,012.32	1,441,206.56	194.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	12/01/2018	4,570,000.00	4,836,748.91	4,836,906.67	157.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	220,000.00	231,564.64	231,645.96	81.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	1,480,000.00	1,566,643.37	1,566,721.37	78.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	320,000.00	338,696.44	338,750.57	54.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/05/2018	290,000.00	299,786.93	299,793.66	6.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	14/02/2018	1,280,000.00	1,346,000.92	1,345,994.60	(6.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	26/04/2018	290,000.00	300,741.23	300,638.00	(103.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/04/2017	05/04/2018	110,000.00	114,710.00	114,580.21	(129.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	1,330,000.00	1,396,492.46	1,396,352.24	(140.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/04/2018	440,000.00	457,504.02	457,363.30	(140.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	05/02/2018	290,000.00	305,653.25	305,496.47	(156.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	870,000.00	914,178.39	914,017.64	(160.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,290,000.00	1,363,595.11	1,363,391.74	(203.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	590,000.00	622,253.85	622,019.66	(234.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	18/01/2018	1,540,000.00	1,628,182.73	1,627,942.73	(240.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	220,000.00	230,283.90	230,043.19	(240.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	929,863.61	929,581.84	(281.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	15/01/2018	140,000.00	148,387.43	148,087.83	(299.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	15/02/2018	390,000.00	410,351.08	410,026.35	(324.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	21/03/2018	550,000.00	575,258.87	574,931.37	(327.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	125,000.00	125,777.01	125,447.99	(329.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	230,000.00	242,868.97	242,530.22	(338.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	410,000.00	431,017.81	430,659.03	(358.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14/12/2017	15/01/2018	90,000.00	99,812.85	99,431.16	(381.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	790,000.00	826,251.13	825,865.92	(385.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	520,000.00	547,323.27	546,885.48	(437.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	280,000.00	294,459.69	293,968.89	(490.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 128 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	300,000.00	318,229.13	317,711.39	(517.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	150,000.00	157,336.59	156,818.53	(518.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	420,000.00	440,271.27	439,743.84	(527.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	20/02/2018	470,000.00	494,283.11	493,643.94	(639.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,820,000.00	1,900,533.15	1,899,756.52	(776.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	1,370,000.00	1,449,043.14	1,448,234.76	(808.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	100,000.00	106,257.94	105,447.92	(810.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	3,810,000.00	3,978,846.52	3,978,015.23	(831.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	480,000.00	508,346.58	507,512.89	(833.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	140,000.00	148,867.47	147,999.08	(868.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	1,240,000.00	1,305,171.64	1,304,278.71	(892.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	900,000.00	929,857.89	928,934.02	(923.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,050,000.00	1,111,332.47	1,110,407.92	(924.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	09/01/2018	600,000.00	623,890.75	622,843.34	(1,047.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	01/03/2018	70,000.00	74,519.39	73,446.91	(1,072.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	10/01/2018	1,200,000.00	1,271,684.49	1,270,592.01	(1,092.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	08/01/2018	110,000.00	117,668.05	116,515.74	(1,152.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	90,000.00	95,791.78	94,546.34	(1,245.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	23/01/2018	190,000.00	201,952.40	200,647.87	(1,304.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,370,000.00	1,449,700.67	1,448,234.76	(1,465.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	140,000.00	149,338.01	147,786.19	(1,551.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/10/2017	06/04/2018	200,000.00	206,906.61	205,311.40	(1,595.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	27/04/2018	80,000.00	84,557.78	82,917.88	(1,639.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	660,000.00	699,223.84	697,549.26	(1,674.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	530,000.00	558,347.84	556,662.32	(1,685.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	90,000.00	96,628.22	94,907.69	(1,720.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	2,820,000.00	2,953,091.49	2,951,364.01	(1,727.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	1,920,000.00	2,018,739.45	2,016,988.68	(1,750.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	20/02/2018	2,960,000.00	3,110,678.22	3,108,906.54	(1,771.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	19/12/2017	19/02/2018	60,000.00	66,725.05	64,944.56	(1,780.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	240,000.00	253,883.74	252,073.50	(1,810.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	240,000.00	254,116.01	252,273.83	(1,842.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/02/2017	02/02/2018	200,000.00	212,728.22	210,866.11	(1,862.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	910,000.00	954,180.68	952,318.12	(1,862.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,020,000.00	1,066,675.54	1,064,698.71	(1,976.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	10/01/2018	430,000.00	457,297.57	455,287.59	(2,009.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	440,000.00	466,406.61	464,396.11	(2,010.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	480,000.00	510,392.39	508,346.29	(2,046.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	03/01/2018	2,290,000.00	2,430,176.71	2,428,099.95	(2,076.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 129 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	760,000.00	796,845.54	794,747.95	(2,097.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/08/2017	07/02/2018	120,000.00	128,462.86	126,362.26	(2,100.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	470,000.00	493,582.08	491,455.92	(2,126.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	870,000.00	922,404.37	920,237.45	(2,166.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	90,000.00	97,184.71	95,005.41	(2,179.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	10/01/2018	90,000.00	97,483.84	95,292.75	(2,191.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	910,000.00	956,920.31	954,722.82	(2,197.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	26/02/2018	180,000.00	191,064.12	188,846.12	(2,218.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	11/04/2018	700,000.00	724,107.31	721,886.02	(2,221.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	620,000.00	651,417.87	649,145.66	(2,272.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	03/04/2018	90,000.00	96,158.49	93,860.94	(2,297.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	03/01/2018	90,000.00	97,742.96	95,426.82	(2,316.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	05/02/2018	800,000.00	845,101.08	842,748.88	(2,352.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	440,000.00	465,147.57	462,749.26	(2,398.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,200,000.00	1,255,157.03	1,252,752.43	(2,404.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	26/02/2018	540,000.00	568,927.45	566,489.23	(2,438.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	21/02/2018	180,000.00	191,549.87	189,017.56	(2,532.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	370,000.00	391,908.14	389,179.94	(2,728.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/06/2018	910,000.00	936,438.76	933,705.93	(2,732.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	12/03/2018	180,000.00	191,243.61	188,476.24	(2,767.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	21/11/2017	22/02/2018	40,000.00	46,060.50	43,275.98	(2,784.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	180,000.00	191,273.42	188,405.83	(2,867.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2017	16/02/2018	90,000.00	97,492.33	94,609.47	(2,882.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,560,000.00	4,823,386.32	4,820,401.84	(2,984.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2017	17/04/2018	90,000.00	96,481.37	93,456.75	(3,024.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2017	18/01/2018	90,000.00	98,178.77	95,139.51	(3,039.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	07/12/2017	09/03/2018	90,000.00	101,828.94	98,787.72	(3,041.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	2,590,000.00	2,727,311.18	2,724,259.56	(3,051.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	14/02/2018	180,000.00	192,386.57	189,293.50	(3,093.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/01/2018	630,000.00	668,585.28	665,486.49	(3,098.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/02/2018	910,000.00	960,247.81	957,107.91	(3,139.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	920,000.00	969,448.73	966,281.76	(3,166.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	06/02/2018	180,000.00	192,761.09	189,591.72	(3,169.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	04/05/2018	200,000.00	210,581.59	207,339.99	(3,241.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	380,000.00	399,947.05	396,704.94	(3,242.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	1,170,000.00	1,227,889.88	1,224,637.87	(3,252.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	22/01/2018	1,640,000.00	1,735,608.22	1,732,317.25	(3,290.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	1,210,000.00	1,272,920.78	1,269,582.38	(3,338.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	08/01/2018	820,000.00	871,978.90	868,584.39	(3,394.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30/11/2017	28/02/2018	70,000.00	80,353.22	76,923.19	(3,430.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	01/12/2017	04/05/2018	200,000.00	210,848.38	207,339.99	(3,508.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 130 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	460,000.00	490,411.98	486,875.72	(3,536.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	25/01/2018	690,000.00	731,922.58	728,374.81	(3,547.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1,170,000.00	1,240,763.85	1,237,062.66	(3,701.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,640,000.00	1,737,012.98	1,733,304.23	(3,708.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	06/03/2018	950,000.00	999,569.93	995,752.25	(3,817.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1,400,000.00	1,484,175.30	1,480,327.30	(3,848.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	05/01/2018	5,800,000.00	6,151,133.12	6,147,260.02	(3,873.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	1,040,000.00	1,096,264.50	1,092,318.51	(3,945.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2,740,000.00	2,899,963.83	2,895,886.33	(4,077.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	910,000.00	965,859.46	961,772.47	(4,086.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	480,000.00	511,761.23	507,641.48	(4,119.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,480,000.00	1,549,242.08	1,545,061.33	(4,180.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	14/02/2018	1,730,000.00	1,823,506.17	1,819,320.87	(4,185.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	11/01/2018	2,240,000.00	2,375,506.57	2,371,253.96	(4,252.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	18/01/2018	6,920,000.00	7,319,466.63	7,315,171.22	(4,295.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	360,000.00	381,235.71	376,923.29	(4,312.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	160,000.00	173,101.21	168,757.91	(4,343.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	04/01/2018	730,000.00	778,220.69	773,862.21	(4,358.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	08/02/2018	270,000.00	288,649.94	284,258.75	(4,391.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	15/01/2018	2,290,000.00	2,426,801.65	2,422,234.20	(4,567.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	460,000.00	484,890.85	480,221.76	(4,669.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	1,140,000.00	1,200,890.68	1,196,026.39	(4,864.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,200,000.00	1,273,198.36	1,268,271.38	(4,926.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	1,830,000.00	1,943,018.09	1,938,039.47	(4,978.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	26/01/2018	1,000,000.00	1,060,476.16	1,055,402.81	(5,073.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	360,000.00	381,478.37	376,343.96	(5,134.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	550,000.00	586,825.49	581,657.39	(5,168.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	3,820,000.00	4,022,985.90	4,017,749.70	(5,236.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	26/09/2017	27/03/2018	100,000.00	108,976.01	103,737.60	(5,238.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	22/01/2018	270,000.00	290,755.59	285,198.57	(5,557.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	21/03/2018	320,000.00	340,201.14	334,464.86	(5,736.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	05/01/2018	590,000.00	631,090.97	625,324.73	(5,766.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	420,000.00	449,200.62	443,358.58	(5,842.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	1,210,000.00	1,276,460.81	1,270,618.08	(5,842.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	830,000.00	883,860.33	877,796.72	(6,063.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	200,000.00	213,821.54	207,614.45	(6,207.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	02/01/2018	1,230,000.00	1,310,658.50	1,304,428.32	(6,230.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,090,000.00	1,158,548.63	1,152,245.18	(6,303.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	09/02/2018	640,000.00	680,141.15	673,664.99	(6,476.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	02/02/2018	2,920,000.00	3,084,339.71	3,077,861.00	(6,478.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 131 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,090,000.00	1,158,795.21	1,152,245.18	(6,550.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	06/08/2018	100,000.00	108,903.13	102,301.87	(6,601.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,820,000.00	1,930,157.26	1,923,544.93	(6,612.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/09/2017	26/03/2018	500,000.00	522,556.10	515,887.82	(6,668.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	180,000.00	196,767.45	190,056.31	(6,711.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	20/09/2017	19/03/2018	900,000.00	941,088.32	934,272.38	(6,815.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/01/2018	670,000.00	715,786.88	708,688.61	(7,098.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	1,360,000.00	1,442,505.75	1,435,406.16	(7,099.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	460,000.00	493,774.25	486,464.42	(7,309.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	540,000.00	577,416.16	569,917.51	(7,498.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	19/01/2018	520,000.00	557,228.07	549,600.98	(7,627.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	08/05/2018	300,000.00	316,250.93	308,611.78	(7,639.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	450,000.00	479,269.18	471,583.40	(7,685.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	8,710,000.00	9,153,172.62	9,145,270.19	(7,902.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/10/2017	05/03/2018	200,000.00	209,638.97	201,655.82	(7,983.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	520,000.00	557,948.46	549,805.63	(8,142.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	3,610,000.00	3,803,349.58	3,795,163.17	(8,186.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	15/02/2018	2,090,000.00	2,205,592.63	2,197,320.70	(8,271.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	08/01/2018	910,000.00	972,302.05	963,902.92	(8,399.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	30/01/2018	1,460,000.00	1,548,270.03	1,539,844.25	(8,425.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	06/02/2018	540,000.00	577,244.90	568,742.83	(8,502.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,090,000.00	1,160,767.81	1,152,245.18	(8,522.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	08/02/2018	500,000.00	535,294.31	526,436.59	(8,857.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	15/02/2018	1,390,000.00	1,470,284.59	1,461,375.97	(8,908.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	7,520,000.00	7,958,532.60	7,949,434.62	(9,097.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	11/09/2017	08/03/2018	300,000.00	320,833.48	311,714.72	(9,118.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	5,090,000.00	5,381,627.52	5,372,218.65	(9,408.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	1,360,000.00	1,438,331.23	1,428,700.32	(9,630.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	1,640,000.00	1,744,428.50	1,734,700.48	(9,728.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	10/01/2018	400,000.00	425,064.26	415,230.19	(9,834.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	2,640,000.00	2,781,806.72	2,771,706.70	(10,100.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/08/2017	23/08/2018	200,000.00	214,855.07	204,695.18	(10,159.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	12/01/2018	1,610,000.00	1,714,160.96	1,703,996.13	(10,164.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/09/2017	19/03/2018	100,000.00	113,545.99	103,294.49	(10,251.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	1,090,000.00	1,164,155.87	1,153,869.11	(10,286.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	319,831.84	309,418.78	(10,413.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	02/02/2018	1,820,000.00	1,929,076.71	1,918,392.82	(10,683.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	5,470,000.00	5,794,420.81	5,783,691.24	(10,729.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	20/06/2018	1,540,000.00	1,590,798.35	1,579,801.16	(10,997.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/04/2018	1,100,000.00	1,145,532.04	1,133,987.88	(11,544.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/10/2017	23/01/2018	400,000.00	426,195.27	414,631.72	(11,563.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 132 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	2,730,000.00	2,893,161.78	2,881,366.78	(11,795.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,160,000.00	1,237,815.55	1,225,995.67	(11,819.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	1,820,000.00	1,925,201.64	1,913,076.53	(12,125.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	2,270,000.00	2,412,383.82	2,400,113.02	(12,270.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	01/02/2018	2,250,000.00	2,384,397.47	2,372,108.87	(12,288.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	24/02/2017	23/02/2018	500,000.00	525,417.80	512,735.26	(12,682.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	2,450,000.00	2,587,151.51	2,573,450.27	(13,701.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/10/2017	18/04/2018	700,000.00	735,417.78	721,515.49	(13,902.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	2,730,000.00	2,900,148.47	2,885,898.47	(14,250.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/09/2017	21/09/2018	2,500,000.00	2,554,818.15	2,540,501.42	(14,316.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	07/02/2018	1,750,000.00	1,857,659.19	1,842,997.99	(14,661.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	17/05/2018	500,000.00	528,787.84	514,097.30	(14,690.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/09/2017	27/08/2018	800,000.00	830,636.93	815,787.96	(14,848.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	529,152.93	513,628.45	(15,524.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	22/01/2018	800,000.00	872,437.97	856,906.22	(15,531.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	29/05/2018	500,000.00	529,363.27	513,628.45	(15,734.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2,180,000.00	2,320,325.10	2,304,096.40	(16,228.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	04/01/2018	4,300,000.00	4,574,985.49	4,558,366.46	(16,619.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	25/01/2018	4,550,000.00	4,819,841.10	4,803,051.31	(16,789.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	7,570,000.00	8,020,933.15	8,004,121.15	(16,812.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,370,000.00	4,637,006.88	4,619,819.21	(17,187.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	900,000.00	981,931.55	964,690.24	(17,241.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	16/02/2018	700,000.00	746,357.06	729,044.47	(17,312.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	16/02/2018	200,000.00	231,071.83	213,736.58	(17,335.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	16/03/2018	8,200,000.00	8,603,016.49	8,585,111.33	(17,905.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	3,100,000.00	3,223,106.90	3,204,931.56	(18,175.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	24/01/2018	3,100,000.00	3,291,260.03	3,273,068.47	(18,191.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	25/01/2018	6,300,000.00	6,669,091.96	6,650,378.74	(18,713.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	19/06/2018	900,000.00	942,735.60	923,667.68	(19,067.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	09/08/2018	300,000.00	326,260.31	307,031.09	(19,229.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/02/2018	3,070,000.00	3,241,198.39	3,221,154.66	(20,043.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/08/2017	16/02/2018	420,000.00	461,769.86	441,510.86	(20,259.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	03/01/2018	5,490,000.00	5,842,524.55	5,821,036.17	(21,488.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	11/04/2018	100,000.00	124,726.30	103,070.39	(21,655.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/08/2017	05/01/2018	200,000.00	231,884.78	208,896.69	(22,988.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	19/07/2018	300,000.00	339,886.41	316,825.20	(23,061.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	26/04/2018	200,000.00	235,553.80	212,364.76	(23,189.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 133 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0122	15/02/2017	09/02/2018	470,000.00	541,865.89	517,962.55	(23,903.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	21/02/2018	5,500,000.00	5,799,705.50	5,775,536.70	(24,168.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	07/07/2017	05/01/2018	200,000.00	233,125.26	208,896.69	(24,228.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/08/2017	16/01/2018	270,000.00	310,094.23	285,540.90	(24,553.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	400,000.00	437,616.57	412,540.91	(25,075.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	9,120,000.00	9,666,046.60	9,640,803.69	(25,242.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	03/01/2018	9,390,000.00	9,981,462.01	9,956,198.48	(25,263.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	09/01/2018	600,000.00	648,724.40	622,853.34	(25,871.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	01/02/2018	200,000.00	240,107.06	214,043.01	(26,064.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/08/2017	31/01/2018	100,000.00	133,129.88	107,031.72	(26,098.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/04/2017	10/04/2018	100,000.00	129,302.65	103,153.33	(26,149.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	9,120,000.00	9,669,138.63	9,642,744.83	(26,393.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	12/03/2018	900,000.00	956,567.47	930,130.13	(26,437.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8,210,000.00	8,705,307.50	8,678,837.53	(26,469.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	04/06/2018	100,000.00	132,515.45	105,790.26	(26,725.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/03/2017	15/03/2018	300,000.00	338,783.24	312,015.31	(26,767.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	200,000.00	233,137.64	206,298.28	(26,839.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/04/2018	800,000.00	853,895.66	824,718.46	(29,177.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31/07/2017	25/01/2018	890,000.00	1,012,045.48	981,870.43	(30,175.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	7,300,000.00	7,698,960.28	7,668,759.06	(30,201.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	31/01/2018	1,100,000.00	1,176,269.68	1,146,041.52	(30,228.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	300,000.00	342,035.00	311,421.67	(30,613.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/04/2018	300,000.00	339,900.48	309,065.25	(30,835.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	11/10/2018	800,000.00	842,385.28	811,251.30	(31,133.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/10/2017	03/04/2018	900,000.00	960,718.41	929,310.11	(31,408.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	200,000.00	246,444.41	213,654.86	(32,789.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	3,630,000.00	3,876,446.43	3,843,474.28	(32,972.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	26/02/2018	600,000.00	673,572.69	640,596.85	(32,975.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	30/01/2018	2,700,000.00	2,924,170.75	2,890,132.24	(34,038.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	05/04/2018	2,500,000.00	2,613,903.03	2,579,653.78	(34,249.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/03/2018	6,340,000.00	6,664,195.62	6,629,824.02	(34,371.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	19/01/2018	5,700,000.00	5,946,039.59	5,910,916.68	(35,122.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/09/2017	07/03/2018	200,000.00	241,852.02	206,672.68	(35,179.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	15/06/2018	1,400,000.00	1,472,351.06	1,436,882.59	(35,468.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	22/01/2018	200,000.00	243,255.05	207,370.16	(35,884.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/09/2017	12/01/2018	200,000.00	250,994.15	214,439.49	(36,554.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	05/01/2018	1,100,000.00	1,179,410.67	1,142,288.73	(37,121.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 134 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	400,000.00	466,246.24	428,878.98	(37,367.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	12/01/2018	900,000.00	971,628.07	934,047.26	(37,580.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/10/2017	19/04/2018	900,000.00	965,906.50	927,594.71	(38,311.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/07/2017	11/01/2018	200,000.00	252,842.67	214,460.78	(38,381.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	08/01/2018	4,100,000.00	4,381,279.93	4,342,859.32	(38,420.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	05/01/2018	600,000.00	682,243.84	643,765.63	(38,478.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	16/01/2018	100,000.00	147,321.73	107,177.16	(40,144.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/11/2017	05/02/2018	100,000.00	147,558.83	106,980.65	(40,578.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	20/07/2017	16/01/2018	300,000.00	353,874.61	311,523.67	(42,350.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	30/01/2018	200,000.00	249,576.24	207,222.40	(42,353.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	12/10/2018	400,000.00	450,387.09	407,576.96	(42,810.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	11/01/2018	1,200,000.00	1,288,790.62	1,245,476.14	(43,314.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	25/01/2018	100,000.00	150,607.50	107,081.34	(43,526.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	20/03/2018	100,000.00	148,355.05	103,968.25	(44,386.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	18/01/2018	100,000.00	151,604.79	107,155.86	(44,448.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/12/2017	17/04/2018	900,000.00	972,473.10	927,730.84	(44,742.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	21/05/2018	400,000.00	455,933.90	411,152.82	(44,781.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	08/02/2018	800,000.00	873,219.07	828,183.74	(45,035.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	18/01/2018	500,000.00	580,978.52	535,779.32	(45,199.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/10/2017	16/10/2018	100,000.00	147,154.32	101,823.89	(45,330.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	08/01/2018	900,000.00	1,010,865.60	965,360.99	(45,504.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	12/10/2017	10/01/2018	900,000.00	980,779.50	935,063.55	(45,715.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/01/2018	800,000.00	875,590.92	829,735.44	(45,855.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/09/2017	13/03/2018	200,000.00	252,841.55	206,680.35	(46,161.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	06/04/2018	200,000.00	259,087.33	212,766.94	(46,320.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/11/2017	01/11/2018	100,000.00	148,945.86	101,753.63	(47,192.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/10/2017	19/04/2018	500,000.00	563,170.20	515,190.76	(47,979.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	100,000.00	152,550.95	104,378.31	(48,172.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	900,000.00	987,654.95	939,404.75	(48,250.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	09/05/2018	1,400,000.00	1,489,470.90	1,441,077.20	(48,393.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	08/11/2017	04/05/2018	700,000.00	773,264.43	724,536.10	(48,728.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27/12/2017	01/03/2018	400,000.00	464,598.82	415,325.57	(49,273.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/09/2017	02/03/2018	500,000.00	583,410.27	533,995.99	(49,414.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/01/2018	1,100,000.00	1,191,030.47	1,141,589.96	(49,440.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	16/02/2018	1,600,000.00	1,704,523.98	1,655,064.45	(49,459.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	01/05/2018	1,100,000.00	1,184,830.07	1,133,127.06	(51,703.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	05/06/2018	900,000.00	976,298.49	924,392.38	(51,906.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 135 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	06/09/2017	31/08/2018	200,000.00	258,539.70	204,378.57	(54,161.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	13/02/2018	1,100,000.00	1,193,188.94	1,138,535.01	(54,653.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	500,000.00	591,712.67	536,205.19	(55,507.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,017,265.78	1,961,273.03	(55,992.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/02/2018	6,790,000.00	7,186,471.09	7,130,162.59	(56,308.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	17/01/2018	400,000.00	485,019.68	428,666.04	(56,353.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	02/03/2018	400,000.00	484,249.55	427,196.79	(57,052.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	18/04/2018	700,000.00	779,028.55	721,741.84	(57,286.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/10/2017	25/04/2018	400,000.00	469,696.66	411,965.21	(57,731.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	19/06/2018	500,000.00	570,441.36	512,679.71	(57,761.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/09/2017	26/03/2018	4,600,000.00	4,807,229.38	4,749,094.26	(58,135.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/12/2017	09/01/2018	500,000.00	594,601.70	536,258.43	(58,343.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	11/09/2017	08/03/2018	300,000.00	370,362.36	311,714.72	(58,647.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	05/01/2018	400,000.00	487,983.46	429,177.09	(58,806.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/12/2017	19/01/2018	800,000.00	888,460.46	829,578.11	(58,882.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/10/2017	23/01/2018	4,600,000.00	4,827,484.14	4,768,430.71	(59,053.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	18/01/2018	600,000.00	681,359.11	622,242.58	(59,116.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/01/2018	600,000.00	683,243.97	622,301.58	(60,942.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	15/02/2018	400,000.00	488,966.28	427,514.01	(61,452.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/11/2017	19/01/2018	400,000.00	490,335.67	428,580.87	(61,754.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/06/2017	15/06/2018	1,300,000.00	1,437,438.60	1,375,048.21	(62,390.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	10/04/2018	6,800,000.00	7,076,657.89	7,014,138.86	(62,519.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	24/11/2017	25/01/2018	600,000.00	689,721.53	625,949.28	(63,772.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/10/2017	24/01/2018	500,000.00	582,412.18	518,259.24	(64,152.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	20/03/2018	700,000.00	787,108.11	722,676.79	(64,431.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	200,000.00	276,390.40	211,399.54	(64,990.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,443,628.47	2,378,570.60	(65,057.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	03/04/2018	1,900,000.00	2,037,241.42	1,971,306.91	(65,934.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/11/2017	03/01/2018	400,000.00	482,341.08	415,439.41	(66,901.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	17/01/2018	3,600,000.00	3,926,093.55	3,857,994.40	(68,099.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	01/02/2018	700,000.00	817,680.93	749,150.54	(68,530.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	300,000.00	390,230.72	321,125.80	(69,104.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/08/2017	20/02/2018	1,300,000.00	1,414,813.00	1,344,348.99	(70,464.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	08/01/2018	400,000.00	491,070.99	417,905.02	(73,165.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/10/2017	23/01/2018	3,900,000.00	4,116,044.33	4,042,659.24	(73,385.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/11/2017	10/05/2018	600,000.00	713,266.47	636,689.46	(76,577.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	23/01/2018	900,000.00	1,015,824.04	939,084.19	(76,739.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	12/01/2018	600,000.00	720,209.20	643,318.47	(76,890.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	08/01/2018	4,500,000.00	4,750,672.43	4,671,856.19	(78,816.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	27/04/2018	600,000.00	717,007.93	637,430.39	(79,577.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/08/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,366,062.88	1,284,503.22	(81,559.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 136 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0423	11/08/2017	07/02/2018	1,100,000.00	1,214,337.76	1,132,340.89	(81,996.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	11/01/2018	2,000,000.00	2,160,489.04	2,075,793.57	(84,695.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	28/03/2018	200,000.00	298,715.84	212,901.11	(85,814.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	08/05/2018	700,000.00	806,974.04	720,456.25	(86,517.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	04/01/2018	1,100,000.00	1,229,669.26	1,142,381.88	(87,287.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	404,339.65	316,918.34	(87,421.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/11/2017	21/03/2018	1,100,000.00	1,224,971.61	1,135,412.94	(89,558.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,164,739.00	1,072,197.45	(92,541.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/10/2017	24/01/2018	4,600,000.00	4,741,796.79	4,647,360.73	(94,436.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	22/01/2018	800,000.00	952,165.16	856,906.22	(95,258.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	1,000,000.00	1,133,927.76	1,037,896.78	(96,030.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,445,733.89	1,349,515.58	(96,218.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/11/2017	06/02/2018	2,100,000.00	2,344,049.89	2,246,379.09	(97,670.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/11/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,172,384.50	1,072,197.45	(100,187.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	418,449.02	316,918.34	(101,530.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/07/2017	04/07/2018	900,000.00	1,027,110.60	922,635.29	(104,475.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/09/2017	06/03/2018	1,700,000.00	1,872,662.53	1,766,682.78	(105,979.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/02/2018	10,920,000.00	11,593,296.96	11,485,294.95	(108,002.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	800,000.00	971,747.20	857,757.96	(113,989.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	800,000.00	972,830.45	857,502.44	(115,328.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	800,000.00	973,786.07	857,502.44	(116,283.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	1,100,000.00	1,252,586.47	1,136,297.04	(116,289.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	1,700,000.00	1,939,149.87	1,822,735.66	(116,414.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	19/02/2018	1,100,000.00	1,292,314.30	1,175,214.08	(117,100.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	08/01/2018	1,700,000.00	1,944,236.52	1,823,459.65	(120,776.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	1,700,000.00	1,944,158.19	1,822,916.66	(121,241.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/01/2018	1,300,000.00	1,515,455.85	1,392,195.79	(123,260.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	10/01/2018	2,100,000.00	2,306,132.88	2,179,767.47	(126,365.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/10/2017	18/01/2018	6,100,000.00	6,662,955.66	6,536,507.72	(126,447.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/11/2017	15/05/2018	800,000.00	958,413.68	823,116.59	(135,297.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	04/01/2018	1,300,000.00	1,486,006.88	1,350,064.05	(135,942.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	23/05/2018	1,200,000.00	1,370,221.14	1,234,220.16	(136,000.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24/10/2017	24/04/2018	1,800,000.00	2,051,189.94	1,912,804.13	(138,385.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	08/01/2018	2,700,000.00	2,942,299.48	2,803,031.88	(139,267.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/11/2017	23/01/2018	1,800,000.00	1,959,128.07	1,818,668.03	(140,460.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	10/01/2018	1,500,000.00	1,752,878.45	1,608,615.58	(144,262.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,530,089.46	2,380,573.19	(149,516.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	31/01/2018	4,300,000.00	4,608,652.37	4,455,504.00	(153,148.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	1,100,000.00	1,299,167.46	1,141,686.46	(157,481.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	22/08/2017	20/02/2018	2,100,000.00	2,353,153.74	2,183,736.81	(169,416.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 137 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	16/11/2017	15/05/2018	800,000.00	1,019,544.57	848,539.31	(171,005.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/01/2018	2,700,000.00	2,973,860.39	2,799,826.13	(174,034.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2017	06/06/2018	1,700,000.00	1,920,819.75	1,746,346.87	(174,472.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/12/2017	05/01/2018	1,500,000.00	1,735,834.35	1,557,634.65	(178,199.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	22/05/2018	1,700,000.00	1,926,984.16	1,748,239.74	(178,744.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/01/2018	2,600,000.00	2,875,411.60	2,696,128.87	(179,282.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	12/01/2018	2,600,000.00	2,881,537.00	2,698,303.54	(183,233.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,575,320.52	2,391,028.21	(184,292.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2017	15/03/2018	2,600,000.00	2,872,194.82	2,685,006.99	(187,187.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	08/01/2018	2,600,000.00	2,887,606.77	2,699,215.88	(188,390.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	08/05/2018	3,400,000.00	3,691,279.89	3,500,663.56	(190,616.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	25/01/2018	1,900,000.00	2,229,297.28	2,034,545.40	(194,751.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/07/2017	12/07/2018	2,000,000.00	2,308,172.00	2,110,329.23	(197,842.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/06/2017	15/06/2018	1,900,000.00	2,207,613.80	2,009,685.85	(197,927.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/04/2017	05/04/2018	4,800,000.00	5,157,716.15	4,955,666.77	(202,049.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	30/05/2018	2,100,000.00	2,362,062.34	2,158,816.66	(203,245.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	01/09/2017	01/03/2018	4,300,000.00	4,681,587.97	4,470,561.44	(211,026.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/03/2018	2,600,000.00	2,898,671.46	2,685,441.49	(213,229.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	05/01/2018	4,000,000.00	4,367,362.27	4,153,692.39	(213,669.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	14/02/2018	3,100,000.00	3,421,513.94	3,207,272.57	(214,241.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	10/01/2018	2,200,000.00	2,499,455.12	2,283,645.97	(215,809.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	12/06/2018	4,200,000.00	4,533,785.87	4,313,663.10	(220,122.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	2,100,000.00	2,405,141.39	2,179,583.25	(225,558.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	11/01/2018	2,900,000.00	3,335,344.64	3,109,681.36	(225,663.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	31/01/2018	2,500,000.00	2,902,520.00	2,675,793.01	(226,727.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	03/01/2018	2,100,000.00	2,411,619.48	2,181,056.88	(230,562.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	1,600,000.00	1,943,904.81	1,712,670.96	(231,233.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	08/01/2018	4,400,000.00	4,808,293.25	4,567,903.80	(240,389.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2017	16/01/2018	3,300,000.00	3,672,478.36	3,423,411.28	(249,067.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/09/2017	02/03/2018	19,200,000.00	20,766,993.59	20,515,903.07	(251,090.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	11/01/2018	3,000,000.00	3,366,306.80	3,113,749.49	(252,557.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	20/10/2017	15/02/2018	4,400,000.00	4,840,648.70	4,577,627.94	(263,020.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/12/2017	28/03/2018	3,100,000.00	3,478,073.17	3,212,405.08	(265,668.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	08/12/2017	05/01/2018	2,500,000.00	2,879,631.17	2,611,208.64	(268,422.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/10/2017	24/01/2018	9,000,000.00	9,597,605.57	9,328,328.53	(269,277.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/06/2018	5,800,000.00	6,231,947.20	5,956,963.33	(274,983.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/01/2018	3,300,000.00	3,703,968.56	3,422,109.66	(281,858.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/11/2017	08/01/2018	6,100,000.00	6,831,354.87	6,543,002.26	(288,352.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	04/01/2018	2,500,000.00	2,891,352.69	2,596,277.02	(295,075.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	09/01/2018	3,600,000.00	4,033,629.88	3,737,120.06	(296,509.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/01/2018	3,500,000.00	3,937,313.70	3,629,748.40	(307,565.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 138 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	4,600,000.00	5,245,661.98	4,933,087.77	(312,574.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	15/01/2018	4,400,000.00	4,892,566.43	4,564,625.76	(327,940.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/11/2017	26/03/2018	1,800,000.00	2,199,130.67	1,867,435.24	(331,695.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/11/2017	28/05/2018	3,000,000.00	3,421,221.30	3,084,460.00	(336,761.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/11/2017	29/05/2018	4,100,000.00	4,552,591.80	4,215,130.60	(337,461.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	22/01/2018	3,100,000.00	3,658,494.89	3,320,511.59	(337,983.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/01/2018	4,300,000.00	4,804,816.99	4,465,596.47	(339,220.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	23/01/2018	3,300,000.00	3,876,136.55	3,534,386.80	(341,749.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	06/02/2018	4,300,000.00	4,795,170.53	4,452,529.29	(342,641.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	4,200,000.00	4,854,902.80	4,503,676.45	(351,226.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2017	24/01/2018	1,600,000.00	2,020,104.06	1,667,910.31	(352,193.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	3,300,000.00	3,889,927.10	3,537,197.55	(352,729.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/01/2018	5,200,000.00	5,745,715.08	5,392,769.06	(352,946.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/01/2018	5,200,000.00	5,766,106.74	5,396,607.08	(369,499.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/07/2017	04/07/2018	4,600,000.00	5,236,088.00	4,857,252.93	(378,835.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16/11/2017	12/01/2018	3,400,000.00	3,915,494.10	3,528,911.76	(386,582.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	10/01/2018	5,200,000.00	5,790,045.53	5,397,992.48	(392,053.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	26/11/2018	4,400,000.00	4,854,885.24	4,454,765.18	(400,120.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	08/01/2018	3,700,000.00	4,381,918.47	3,968,706.29	(413,212.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/02/2018	4,200,000.00	4,912,406.68	4,489,755.11	(422,651.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	22/01/2018	5,000,000.00	5,808,329.18	5,355,663.85	(452,665.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	18/01/2018	3,200,000.00	3,884,987.32	3,428,987.66	(455,999.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	18/01/2018	4,100,000.00	4,751,341.12	4,279,875.63	(471,465.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	25/01/2018	3,500,000.00	4,220,852.91	3,747,846.79	(473,006.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/12/2017	05/01/2018	4,100,000.00	4,873,772.39	4,399,065.17	(474,707.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	06/02/2018	8,800,000.00	9,596,016.67	9,113,643.50	(482,373.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2017	01/02/2018	13,200,000.00	14,234,447.04	13,751,190.62	(483,256.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	6,300,000.00	7,270,842.60	6,751,490.19	(519,352.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	17/01/2018	4,700,000.00	5,444,501.36	4,906,617.40	(537,883.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/02/2018	6,100,000.00	7,066,136.86	6,517,096.28	(549,040.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	08/01/2018	8,700,000.00	9,610,930.77	9,031,991.60	(578,939.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	6,700,000.00	7,764,078.92	7,184,436.25	(579,642.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2017	01/02/2018	17,200,000.00	18,500,937.82	17,918,218.08	(582,719.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	13/02/2018	8,700,000.00	9,892,162.85	9,300,207.01	(591,955.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/11/2017	12/01/2018	8,000,000.00	8,911,986.08	8,302,472.43	(609,513.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16/11/2017	16/03/2018	4,600,000.00	5,398,615.80	4,750,529.31	(648,086.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	25/01/2018	7,800,000.00	9,008,739.49	8,352,344.26	(656,395.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	10/01/2018	8,600,000.00	9,610,698.52	8,926,666.79	(684,031.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2017	08/01/2018	8,000,000.00	9,006,469.02	8,305,279.63	(701,189.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/12/2017	26/01/2018	10,900,000.00	12,004,421.00	11,295,498.33	(708,922.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	19/07/2017	17/01/2018	30,700,000.00	32,639,380.37	31,876,455.95	(762,924.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 139 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	11,300,000.00	12,497,461.98	11,728,456.40	(769,005.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2017	12/01/2018	8,500,000.00	9,600,065.17	8,821,376.96	(778,688.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	19/01/2018	9,400,000.00	10,563,160.73	9,747,542.83	(815,617.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	15/01/2018	10,300,000.00	11,503,278.87	10,684,869.26	(818,409.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	11,900,000.00	13,175,355.37	12,351,206.30	(824,149.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	21/11/2017	18/01/2018	6,800,000.00	7,948,501.63	7,098,330.32	(850,171.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	11,500,000.00	13,231,807.40	12,326,597.53	(905,209.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	28/11/2017	29/05/2018	4,900,000.00	5,998,220.94	5,061,959.07	(936,261.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	11,300,000.00	13,067,828.50	12,109,815.75	(958,012.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/12/2017	05/01/2018	8,200,000.00	9,617,388.56	8,564,764.35	(1,052,624.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	15/01/2018	16,700,000.00	18,430,124.82	17,324,829.57	(1,105,295.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/11/2017	15/05/2018	8,600,000.00	9,968,183.76	8,848,503.33	(1,119,680.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	17,700,000.00	19,519,231.84	18,371,470.89	(1,147,760.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/02/2018	18,300,000.00	20,144,151.20	18,934,981.43	(1,209,169.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	9,900,000.00	11,843,921.37	10,597,151.54	(1,246,769.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/09/2017	06/03/2018	19,500,000.00	21,553,236.47	20,275,485.61	(1,277,750.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/11/2017	07/02/2018	20,100,000.00	22,778,091.82	21,499,003.90	(1,279,087.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	20,900,000.00	22,893,995.13	21,602,249.35	(1,291,745.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	04/08/2017	30/07/2018	10,500,000.00	11,966,651.12	10,673,872.17	(1,292,778.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/01/2018	16,200,000.00	18,211,936.24	16,800,549.75	(1,411,386.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2017	12/01/2018	17,600,000.00	19,682,456.44	18,267,307.94	(1,415,148.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/11/2017	08/02/2018	22,500,000.00	24,707,946.58	23,291,332.01	(1,416,614.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2017	01/02/2018	41,700,000.00	44,912,026.32	43,441,261.28	(1,470,765.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	08/01/2018	17,100,000.00	19,262,319.88	17,752,535.22	(1,509,784.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	04/01/2018	11,400,000.00	13,755,733.37	12,232,760.80	(1,522,972.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2017	08/01/2018	8,200,000.00	10,100,299.79	8,561,569.37	(1,538,730.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/12/2017	06/03/2018	21,400,000.00	23,748,398.69	22,131,470.18	(1,616,928.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	23/01/2018	16,000,000.00	18,283,167.45	16,585,268.67	(1,697,898.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/12/2017	22/01/2018	15,500,000.00	17,772,263.39	16,069,040.10	(1,703,223.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	05/01/2018	18,300,000.00	21,421,313.43	19,634,851.86	(1,786,461.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	08/01/2018	17,800,000.00	20,930,828.65	19,092,695.12	(1,838,133.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	20/10/2017	18/04/2018	25,300,000.00	28,303,641.44	26,219,167.58	(2,084,473.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	01/03/2018	39,600,000.00	43,598,318.34	40,967,924.19	(2,630,394.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2017	09/01/2018	43,700,000.00	48,028,834.16	45,363,756.60	(2,665,077.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/01/2018	43,400,000.00	47,971,453.45	45,040,912.95	(2,930,540.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/01/2018	42,900,000.00	47,880,573.25	44,491,581.84	(3,388,991.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	15/12/2017	16/01/2018	40,400,000.00	45,144,802.02	41,649,092.55	(3,495,709.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/01/2018	33,700,000.00	38,466,922.35	34,945,978.03	(3,520,944.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/01/2018	33,700,000.00	38,466,922.35	34,945,978.03	(3,520,944.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	33,700,000.00	39,565,912.37	36,012,439.62	(3,553,472.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	01/12/2017	03/01/2018	101,900,000.00	110,187,827.40	106,451,542.34	(3,736,285.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 140 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0729	18/12/2017	17/01/2018	31,000,000.00	37,534,697.88	32,338,138.81	(5,196,559.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	48,700,000.00	58,106,502.81	52,041,715.41	(6,064,787.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	58,200,000.00	68,981,230.96	62,193,590.08	(6,787,640.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	21/03/2018	61,800,000.00	74,879,994.92	65,872,538.42	(9,007,456.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/07/2017	09/01/2018	43,700,000.00	43,002,111.87	45,367,399.93	2,365,288.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	30/01/2018	45,600,000.00	45,892,536.77	47,253,036.01	1,360,499.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,324,686.71	42,498,290.52	1,173,603.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,324,686.71	42,498,290.52	1,173,603.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	01/02/2018	45,500,000.00	46,038,852.41	47,141,487.65	1,102,635.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/07/2017	10/01/2018	11,400,000.00	11,489,649.60	12,225,478.39	735,828.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	15/01/2018	47,900,000.00	49,103,183.82	49,691,002.33	587,818.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/06/2017	26/06/2018	7,000,000.00	6,677,556.58	7,187,920.36	510,363.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/07/2017	23/01/2018	14,700,000.00	14,868,535.18	15,237,715.59	369,180.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	10/01/2018	12,300,000.00	12,518,749.70	12,768,328.38	249,578.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/07/2017	05/04/2018	32,200,000.00	33,039,228.60	33,240,807.55	201,578.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	11/04/2018	12,600,000.00	12,800,867.32	12,995,852.94	194,985.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	04/01/2018	9,000,000.00	9,186,882.79	9,346,597.27	159,714.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	4,380,000.00	4,462,753.08	4,618,162.22	155,409.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16/10/2017	16/01/2018	12,600,000.00	12,918,013.16	13,071,206.71	153,193.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/07/2017	05/04/2018	41,300,000.00	42,492,454.90	42,634,948.81	142,493.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	05/04/2018	22,900,000.00	23,536,808.24	23,642,660.21	105,851.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	11/04/2018	2,300,000.00	2,277,219.20	2,372,606.61	95,387.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/08/2017	01/03/2018	4,800,000.00	4,881,739.82	4,962,549.85	80,810.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	11/01/2018	2,600,000.00	2,625,039.36	2,698,634.14	73,594.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	300,000.00	262,522.50	321,755.06	59,232.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/09/2017	13/03/2018	5,600,000.00	5,729,609.24	5,787,359.68	57,750.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/07/2017	03/01/2018	2,100,000.00	2,198,859.60	2,253,626.89	54,767.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	11/01/2018	4,800,000.00	4,930,005.88	4,982,093.80	52,087.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/10/2017	11/10/2018	1,200,000.00	1,174,493.39	1,216,876.95	42,383.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	13/02/2018	13,830,000.00	14,511,114.67	14,545,936.74	34,822.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	1,870,000.00	1,944,607.40	1,971,876.16	27,268.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	21/12/2017	19/01/2018	300,000.00	286,183.17	312,334.38	26,151.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/10/2017	01/02/2018	800,000.00	803,198.80	828,664.65	25,465.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	01/03/2018	4,530,000.00	4,729,776.03	4,753,498.15	23,722.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	940,000.00	973,002.17	991,014.37	18,012.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	23/01/2018	1,860,000.00	1,948,516.70	1,964,237.01	15,720.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	470,000.00	486,397.13	495,507.19	9,110.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	480,000.00	499,529.15	507,002.04	7,472.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	490,000.00	510,716.49	517,564.59	6,848.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	350,000.00	364,142.93	369,688.99	5,546.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	21/02/2018	350,000.00	364,690.40	367,679.73	2,989.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 141 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	12/12/2017	23/01/2018	920,000.00	970,755.55	971,558.09	802.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	09/02/2018	2,900,000.00	3,001,747.45	3,002,072.99	325.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	02/05/2018	1,300,000.00	1,338,274.70	1,338,580.49	305.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/10/2017	25/04/2018	500,000.00	519,251.25	514,784.40	(4,466.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	25/01/2018	5,800,000.00	6,023,172.39	6,018,029.97	(5,142.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2017	24/01/2018	4,580,000.00	4,842,715.32	4,835,694.71	(7,020.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/10/2017	15/02/2018	1,600,000.00	1,653,314.69	1,646,115.47	(7,199.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	22/09/2017	19/01/2018	11,500,000.00	11,952,740.11	11,938,594.18	(14,145.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/09/2017	14/09/2018	400,000.00	427,402.96	408,065.32	(19,337.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	14/02/2018	8,900,000.00	9,535,110.35	9,513,095.78	(22,014.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	100,000.00	153,042.51	107,241.04	(45,801.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/10/2017	05/01/2018	2,800,000.00	2,972,110.84	2,924,553.68	(47,557.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	2,700,000.00	2,944,249.43	2,894,070.72	(50,178.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	24/01/2018	3,900,000.00	4,092,789.31	4,042,568.45	(50,220.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	26/01/2018	400,000.00	481,398.56	428,282.76	(53,115.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	22/09/2017	21/03/2018	1,200,000.00	1,303,619.82	1,239,435.41	(64,184.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/10/2017	25/04/2018	2,800,000.00	2,953,364.63	2,884,579.42	(68,785.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	30/01/2018	300,000.00	386,265.74	310,805.85	(75,459.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/10/2017	11/01/2018	14,000,000.00	15,087,716.31	15,012,254.85	(75,461.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	22,800,000.00	24,551,385.88	24,438,819.45	(112,566.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	21/03/2018	2,600,000.00	2,813,047.30	2,684,326.03	(128,721.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	04/01/2018	800,000.00	965,186.29	830,808.65	(134,377.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/11/2017	01/03/2018	4,500,000.00	4,941,145.83	4,806,370.79	(134,775.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	20/03/2018	1,500,000.00	1,694,626.76	1,549,303.06	(145,323.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	21/03/2018	2,900,000.00	3,139,649.25	2,994,055.95	(145,593.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/10/2017	23/01/2018	5,100,000.00	5,433,290.71	5,286,738.40	(146,552.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12/07/2017	09/01/2018	4,800,000.00	5,102,491.20	4,950,975.32	(151,515.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,440,467.39	1,284,503.22	(155,964.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/11/2017	23/01/2018	1,700,000.00	1,924,435.70	1,762,491.52	(161,944.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/03/2018	2,200,000.00	2,451,394.44	2,272,771.40	(178,623.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	23/01/2018	2,300,000.00	2,503,451.14	2,323,853.59	(179,597.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/12/2017	28/03/2018	2,600,000.00	2,868,912.13	2,682,858.81	(186,053.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	14/12/2018	4,200,000.00	4,427,362.06	4,239,758.74	(187,603.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/09/2017	21/09/2018	1,700,000.00	1,923,602.67	1,734,891.74	(188,710.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	09/05/2018	2,600,000.00	2,873,401.40	2,675,783.54	(197,617.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/10/2017	15/01/2018	18,100,000.00	19,625,862.39	19,400,992.63	(224,869.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	25/10/2017	23/01/2018	9,600,000.00	10,134,448.13	9,891,677.50	(242,770.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	21/02/2018	1,900,000.00	2,215,644.74	1,964,492.26	(251,152.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	13/03/2018	4,300,000.00	4,703,053.48	4,442,235.00	(260,818.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/12/2017	10/01/2018	3,500,000.00	3,909,861.79	3,632,945.79	(276,916.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	10/01/2018	9,000,000.00	9,633,520.60	9,342,024.32	(291,496.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 142 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0326	23/11/2017	22/01/2018	2,700,000.00	3,029,479.98	2,728,205.39	(301,274.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	18/10/2017	17/04/2018	4,200,000.00	4,667,324.54	4,352,924.87	(314,399.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	02/02/2018	4,200,000.00	4,833,260.80	4,494,474.23	(338,786.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	19/01/2018	4,200,000.00	4,838,921.07	4,500,099.13	(338,821.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/11/2017	13/02/2018	5,300,000.00	6,036,942.31	5,665,643.35	(371,298.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	11/01/2018	6,700,000.00	7,579,300.67	7,184,436.25	(394,864.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	13/03/2018	2,600,000.00	3,199,167.87	2,771,738.15	(427,429.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	31/01/2018	6,800,000.00	7,734,259.35	7,278,156.97	(456,102.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	10/01/2018	5,100,000.00	5,776,319.13	5,293,721.00	(482,598.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/01/2018	6,100,000.00	6,810,378.41	6,326,308.84	(484,069.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/04/2018	7,800,000.00	8,552,399.14	8,050,195.29	(502,203.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/11/2017	11/01/2018	19,200,000.00	20,433,421.73	19,927,996.72	(505,425.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	07/02/2018	5,900,000.00	6,835,861.20	6,310,652.89	(525,208.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	28/02/2018	4,300,000.00	5,137,756.62	4,593,143.09	(544,613.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	09/01/2018	7,600,000.00	8,445,037.12	7,889,348.97	(555,688.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	16/02/2018	6,100,000.00	7,080,212.04	6,518,965.54	(561,246.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	8,600,000.00	9,461,099.40	8,888,963.85	(572,135.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/10/2017	26/04/2018	8,100,000.00	9,180,444.70	8,606,079.73	(574,364.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	13/12/2017	13/03/2018	6,800,000.00	7,660,180.17	7,077,504.42	(582,675.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	22/02/2018	23,500,000.00	24,965,218.04	24,295,448.92	(669,769.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	8,400,000.00	9,654,949.01	8,973,504.07	(681,444.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	22/01/2018	5,900,000.00	7,002,280.77	6,319,683.35	(682,597.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/10/2017	25/04/2018	61,400,000.00	63,967,401.23	63,265,278.04	(702,123.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	02/02/2018	6,800,000.00	7,999,175.76	7,276,767.80	(722,407.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	17/01/2018	7,800,000.00	8,873,287.91	8,142,896.97	(730,390.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/10/2017	03/04/2018	12,900,000.00	14,217,905.03	13,384,136.39	(833,768.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	26/02/2018	8,500,000.00	9,914,801.04	9,075,122.08	(839,678.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/10/2017	19/01/2018	53,300,000.00	56,119,420.85	55,278,713.69	(840,707.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	08/12/2017	04/01/2018	9,600,000.00	10,873,580.35	10,027,921.02	(845,659.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/06/2018	15,800,000.00	17,096,590.49	16,239,228.46	(857,362.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	22/01/2018	8,600,000.00	9,566,611.84	8,689,839.39	(876,772.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	20/03/2018	12,500,000.00	13,792,768.13	12,914,563.34	(878,204.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	14/09/2017	13/03/2018	14,900,000.00	16,383,935.70	15,484,211.98	(899,723.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	28/12/2017	07/02/2018	6,700,000.00	7,890,420.68	6,975,788.67	(914,632.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	19/06/2018	16,000,000.00	17,390,536.12	16,437,160.28	(953,375.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	10,400,000.00	12,106,039.37	11,145,317.15	(960,722.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	16/02/2018	12,400,000.00	14,245,792.79	13,251,667.66	(994,125.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	8,400,000.00	10,034,769.64	8,991,522.52	(1,043,247.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 143 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	30/10/2017	26/4/2018	12,900,000.00	14,764,579.54	13,705,978.82	(1,058,600.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7/12/2017	7/2/2018	12,100,000.00	14,032,308.31	12,942,186.43	(1,090,121.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	13/2/2018	12,200,000.00	14,146,426.11	13,041,669.61	(1,104,756.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	11/4/2018	22,700,000.00	25,310,727.00	24,150,617.49	(1,160,109.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9/11/2017	18/1/2018	16,900,000.00	19,307,172.58	18,109,341.06	(1,197,831.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6/12/2017	10/1/2018	12,400,000.00	14,506,894.75	13,297,888.78	(1,209,005.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/3/2018	18,000,000.00	20,021,192.29	18,718,076.35	(1,303,115.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/3/2018	18,000,000.00	20,021,192.29	18,718,076.35	(1,303,115.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7/11/2017	6/2/2018	22,000,000.00	24,129,321.70	22,779,140.59	(1,350,181.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5/12/2017	4/4/2018	18,600,000.00	20,550,388.36	19,196,619.54	(1,353,768.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	20/2/2018	9,200,000.00	10,959,983.37	9,516,685.52	(1,443,297.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/2/2018	16,600,000.00	19,256,631.81	17,745,222.58	(1,511,409.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/11/2017	14/5/2018	12,900,000.00	14,857,682.57	13,284,089.58	(1,573,592.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19/10/2017	15/2/2018	22,600,000.00	25,091,312.42	23,512,361.69	(1,578,950.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31/10/2017	5/1/2018	54,300,000.00	59,876,814.38	58,260,789.96	(1,616,024.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/12/2017	22/1/2018	26,000,000.00	28,704,658.21	26,954,518.87	(1,750,139.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	20/4/2018	12,600,000.00	15,159,582.17	13,394,416.50	(1,765,165.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	24/1/2018	20,900,000.00	23,612,412.69	21,666,374.33	(1,946,038.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	18/1/2018	28,800,000.00	31,824,922.02	29,868,474.52	(1,956,447.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	18/1/2018	34,900,000.00	38,277,122.35	36,194,783.36	(2,082,338.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	18/1/2018	34,900,000.00	38,277,122.35	36,194,783.36	(2,082,338.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	21/12/2017	22/1/2018	11,200,000.00	13,952,611.66	11,677,682.03	(2,274,929.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/11/2017	12/1/2018	26,400,000.00	29,937,773.20	27,400,961.92	(2,536,811.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/3/2017	29/3/2018	28,900,000.00	32,401,755.20	29,850,264.00	(2,551,491.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/11/2017	26/1/2018	25,500,000.00	29,115,241.43	26,425,248.39	(2,689,993.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	19/6/2018	19,000,000.00	22,924,842.18	20,089,639.10	(2,835,203.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	20/3/2018	12,800,000.00	16,669,772.04	13,644,719.00	(3,025,053.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7/12/2017	2/3/2018	37,600,000.00	43,548,940.02	40,176,976.85	(3,371,963.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0223	4/7/2017	8/1/2018	40,600,000.00	50,114,163.40	46,397,849.57	(3,716,313.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	16/1/2018	51,800,000.00	57,538,919.58	53,731,806.87	(3,807,112.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	25/10/2017	24/1/2018	45,700,000.00	51,634,308.19	47,639,688.33	(3,994,619.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2017	27/4/2018	44,800,000.00	50,400,940.80	46,395,381.92	(4,005,558.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/11/2017	10/1/2018	41,600,000.00	48,708,262.66	44,612,272.03	(4,095,990.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	16/1/2018	42,400,000.00	48,084,873.99	43,980,147.30	(4,104,726.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	27/12/2017	9/2/2018	63,100,000.00	67,792,675.34	63,684,394.30	(4,108,281.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19/9/2017	16/3/2018	94,000,000.00	102,050,630.00	97,663,087.33	(4,387,542.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19/12/2017	18/1/2018	26,800,000.00	32,548,677.73	27,954,079.04	(4,594,598.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20/11/2017	17/5/2018	44,500,000.00	51,377,626.37	45,537,491.45	(5,840,134.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/11/2017	15/5/2018	41,800,000.00	50,688,710.99	44,336,178.88	(6,352,532.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	15/8/2017	8/2/2018	112,600,000.00	123,671,910.09	117,223,741.75	(6,448,168.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	4/10/2017	2/4/2018	101,600,000.00	111,887,914.40	105,421,165.87	(6,466,748.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 144 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0223	11/07/2017	09/01/2018	77,000,000.00	95,053,257.78	87,983,818.56	(7,069,439.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18/04/2017	18/04/2018	98,600,000.00	111,627,623.60	101,684,911.15	(9,942,712.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/09/2017	09/03/2018	223,800,000.00	245,916,811.20	232,646,511.69	(13,270,299.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/11/2017	04/01/2018	98,400,000.00	119,136,664.74	105,588,040.56	(13,548,624.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	07/12/2017	07/03/2018	83,300,000.00	100,168,430.03	86,606,055.79	(13,562,374.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/12/2017	12/02/2018	129,900,000.00	150,229,665.41	134,461,944.06	(15,767,721.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/05/2018	103,900,000.00	128,375,533.24	110,115,215.99	(18,260,317.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	293,400,000.00	339,364,146.63	314,582,731.74	(24,781,414.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	293,400,000.00	339,364,146.63	314,582,731.74	(24,781,414.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/11/2017	21/03/2018	207,700,000.00	259,566,220.90	221,387,155.84	(38,179,065.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	14/06/2018	334,300,000.00	403,529,794.03	353,630,691.84	(49,899,102.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	12/01/2018	100,000,000.00	102,949,639.00	103,791,522.41	841,883.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	12/01/2018	30,000,000.00	31,942,407.90	31,137,456.72	(804,951.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/10/2017	05/01/2018	136,600,000.00	147,554,363.80	146,563,976.21	(990,387.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	12/01/2018	60,000,000.00	63,877,220.40	62,274,913.45	(1,602,306.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/12/2017	02/01/2018	24,900,000.00	27,766,537.80	26,027,890.84	(1,738,646.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	41,500,000.00	49,777,963.50	43,903,654.12	(5,874,309.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/11/2017	15/05/2018	69,400,000.00	82,079,736.21	73,610,785.04	(8,468,951.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	05/01/2018	101,000,000.00	117,294,730.85	108,367,215.20	(8,927,515.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	30/11/2017	30/05/2018	82,700,000.00	96,844,811.63	85,426,860.81	(11,417,950.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/12/2017	18/01/2018	96,700,000.00	112,571,176.63	100,864,158.32	(11,707,018.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	18/01/2018	108,400,000.00	128,791,340.80	116,156,956.84	(12,634,383.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/09/2017	10/01/2018	38,300,000.00	38,905,637.69	39,754,806.73	849,169.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/08/2017	03/01/2018	1,100,000.00	1,097,710.32	1,146,832.19	49,121.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/09/2017	02/02/2018	10,200,000.00	10,570,933.20	10,577,495.83	6,562.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	03/10/2017	30/01/2018	23,500,000.00	24,407,570.00	24,375,853.48	(31,716.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	13/09/2017	03/01/2018	14,100,000.00	14,718,890.38	14,658,331.21	(60,559.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/09/2017	16/02/2018	9,800,000.00	10,465,703.64	10,140,752.03	(324,951.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	06/12/2017	15/01/2018	5,700,000.00	6,609,371.37	6,111,399.44	(497,971.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	08/02/2018	73,200,000.00	78,838,018.83	78,287,402.84	(550,615.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20/11/2017	19/01/2018	8,900,000.00	9,832,352.91	9,173,130.51	(659,222.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	05/07/2017	04/01/2018	18,600,000.00	20,091,217.80	19,334,825.54	(756,392.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	02/02/2018	8,700,000.00	9,861,317.85	9,071,324.12	(789,993.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	30/08/2017	19/01/2018	20,100,000.00	22,013,640.60	20,963,486.62	(1,050,153.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	16/01/2018	12,500,000.00	14,555,150.87	13,397,144.73	(1,158,006.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	18/10/2017	18/04/2018	17,100,000.00	19,060,601.81	17,721,255.56	(1,339,346.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/10/2017	23/01/2018	71,500,000.00	78,059,234.18	76,578,380.66	(1,480,853.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/10/2017	23/01/2018	58,400,000.00	62,487,581.86	60,884,748.50	(1,602,833.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	09/01/2018	16,700,000.00	19,525,444.39	17,911,031.45	(1,614,412.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	31/01/2018	31,600,000.00	34,596,446.79	32,735,235.07	(1,861,211.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	31/01/2018	31,600,000.00	34,596,446.79	32,735,235.07	(1,861,211.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 145 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0423	27/11/2017	25/01/2018	24,900,000.00	27,524,345.27	25,652,731.95	(1,871,613.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	19/01/2018	20,800,000.00	24,219,799.82	22,286,205.23	(1,933,594.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	16,300,000.00	19,440,069.69	17,447,835.36	(1,992,234.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	19/01/2018	25,200,000.00	29,027,362.07	27,000,594.80	(2,026,767.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	02/02/2018	25,200,000.00	29,019,455.22	26,966,845.36	(2,052,609.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	30/01/2018	20,600,000.00	24,410,164.93	22,050,638.56	(2,359,526.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	06/02/2018	24,900,000.00	29,080,242.75	26,635,637.81	(2,444,604.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	33,800,000.00	38,588,374.04	36,107,671.14	(2,480,702.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	23/01/2018	20,300,000.00	24,368,117.23	21,741,833.95	(2,626,283.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	06/12/2017	15/01/2018	35,600,000.00	39,422,589.76	36,703,406.67	(2,719,183.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	38,000,000.00	43,413,317.98	40,594,423.18	(2,818,894.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	14/12/2017	13/02/2018	33,900,000.00	38,102,521.99	35,275,258.99	(2,827,263.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/11/2017	16/01/2018	35,400,000.00	39,434,986.74	36,494,501.89	(2,940,484.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/11/2017	27/03/2018	17,400,000.00	21,097,152.00	18,062,758.82	(3,034,393.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	06/02/2018	33,200,000.00	38,773,656.99	35,514,183.74	(3,259,473.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20/11/2017	19/01/2018	44,600,000.00	49,232,802.62	45,968,721.42	(3,264,081.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	19/01/2018	42,000,000.00	48,430,284.00	45,000,991.33	(3,429,292.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	25/01/2018	34,400,000.00	39,133,488.77	35,651,561.46	(3,481,927.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	25/01/2018	34,400,000.00	39,133,488.77	35,651,561.46	(3,481,927.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	07/02/2018	42,000,000.00	48,710,550.00	44,923,291.74	(3,787,258.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	01/12/2017	30/01/2018	33,100,000.00	38,294,941.97	34,488,710.20	(3,806,231.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	22/01/2018	57,700,000.00	64,063,645.63	60,210,868.94	(3,852,776.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2017	23/01/2018	36,900,000.00	43,184,184.30	38,469,986.64	(4,714,197.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22/11/2017	23/01/2018	41,000,000.00	48,698,930.68	43,912,078.42	(4,786,852.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	01/03/2018	55,500,000.00	62,601,428.94	57,407,151.27	(5,194,277.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2017	24/01/2018	28,700,000.00	35,219,209.52	29,918,141.25	(5,301,068.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/11/2017	15/01/2018	93,900,000.00	107,217,838.94	100,649,348.52	(6,568,490.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	29/12/2017	26/02/2018	89,100,000.00	96,669,222.96	89,817,264.69	(6,851,958.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/11/2017	13/02/2018	84,000,000.00	97,236,673.53	89,795,102.20	(7,441,571.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	13/02/2018	59,200,000.00	71,137,990.32	63,284,167.26	(7,853,823.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	18/12/2017	09/01/2018	102,700,000.00	111,818,862.09	103,873,402.50	(7,945,459.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	26/01/2018	82,700,000.00	96,886,619.48	88,547,460.58	(8,339,158.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	18/01/2018	99,900,000.00	116,279,565.09	107,048,708.38	(9,230,856.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	01/03/2018	81,900,000.00	97,061,572.51	87,519,845.84	(9,541,726.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	28/12/2017	22/01/2018	126,700,000.00	142,723,765.47	132,103,777.91	(10,619,987.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/01/2018	200,000,000.00	221,406,126.04	207,583,044.82	(13,823,081.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	23/11/2017	21/02/2018	77,700,000.00	95,919,550.40	80,790,564.86	(15,128,985.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	300,000,000.00	345,119,122.20	321,563,413.80	(23,555,708.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			10,879,500,000.00	12,205,431,283.46	11,434,045,557.94	(771,385,725.52)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 146 de 163

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0723	02/11/2017	05/01/2018	3,000.00	2,783.81	3,318.33	534.52	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	28/12/2017	26/02/2018	29,000.00	31,560.01	31,764.49	204.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	02/10/2017	29/03/2018	38,000.00	42,193.71	41,573.42	(620.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13/10/2017	11/04/2018	184,000.00	202,826.10	201,142.75	(1,683.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0723	13/12/2017	13/03/2018	17,000.00	20,411.57	18,710.06	(1,701.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	21/12/2017	19/06/2018	35,000.00	39,981.92	38,119.40	(1,862.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	02/11/2017	31/01/2018	202,000.00	216,552.08	221,632.05	5,079.97	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP0927	15/12/2017	13/02/2018	1,823,377.00	2,036,803.65	1,983,648.07	(53,155.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP3227	01/08/2017	25/01/2018	389,389.00	394,338.84	425,285.18	30,946.34	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP3227	01/08/2017	25/01/2018	307,131.00	311,034.75	335,444.15	24,409.41	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP3127	01/08/2017	25/01/2018	193,834.00	196,298.18	211,702.77	15,404.59	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP0927	10/10/2017	08/01/2018	924,668.00	995,799.93	1,008,011.69	12,211.76	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	30/11/2017	23/05/2018	377,000.00	405,947.82	395,004.72	(10,943.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	24/11/2017	23/05/2018	1,337,000.00	1,439,635.37	1,400,227.55	(39,407.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	02/11/2017	24/01/2018	144,000.00	154,197.95	158,026.34	3,828.39	USD	Alpha Sociedad de Valores
			6,004,399.00	6,490,365.69	6,473,610.97	(16,754.72)		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de DOP 48.7111 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 147 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR								
Total								

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR								
Total								

d) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
MH0227	02/10/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,047,139.43	2,067,320.22	20,180.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	16/01/2018	450,000.00	483,982.90	488,833.39	4,850.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	930,000.00	1,013,654.47	1,015,640.90	1,986.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	549,474.80	555,616.44	6,141.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,072,789.41	1,093,517.43	20,728.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18/12/2017	17/01/2018	30,700,000.00	34,200,633.95	34,483,305.94	282,671.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	11/01/2018	199,200,000.00	235,092,806.04	233,872,974.30	(1,219,831.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			234,750,000.00	274,460,481.00	273,577,208.62	(883,272.38)		

e) Oro

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR								
Total								

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 148 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

6. Contratos de venta forward:

a) Títulos Valores de Deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR								
Total								

6.- Contratos de venta forward

a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0729	13/09/2017	06/03/2018	19,500,000.00	21,553,236.51	20,275,485.61	1,277,750.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18/12/2017	17/01/2018	30,700,000.00	32,639,349.70	31,890,520.66	748,829.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,172,384.00	1,072,543.25	99,840.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,164,739.00	1,072,543.25	92,195.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	02/10/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,017,272.99	1,961,273.03	55,999.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	14/08/2017	15/02/2018	720,000.00	843,621.93	790,017.29	53,604.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	07/12/2017	15/03/2018	300,000.00	338,783.10	312,015.31	26,767.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/12/2017	10/04/2018	100,000.00	129,302.65	103,153.33	26,149.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	529,363.50	513,964.26	15,399.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	18/01/2018	7,520,000.00	7,958,532.64	7,954,253.23	4,279.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	31/01/2018	340,000.00	358,228.07	358,609.00	(380.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/09/2017	13/02/2018	400,000.00	413,464.68	420,848.28	(7,383.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	930,000.00	975,741.04	985,217.30	(9,476.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	04/05/2018	720,000.00	734,430.19	745,733.88	(11,303.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	16/01/2018	450,000.00	464,300.03	475,951.06	(11,651.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	05/01/2018	710,000.00	740,944.08	752,668.55	(11,724.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/11/2017	25/04/2018	1,400,000.00	1,431,051.37	1,443,495.80	(12,444.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	660,000.00	682,159.02	697,993.34	(15,834.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/11/2017	16/01/2018	5,000,000.00	5,162,065.20	5,189,055.33	(26,990.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	14/11/2017	09/01/2018	900,000.00	893,961.00	935,384.35	(41,423.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,064,610.51	1,111,299.22	(46,688.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	16/01/2018	9,800,000.00	10,082,651.60	10,170,548.44	(87,896.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	17/01/2018	10,720,000.00	11,203,783.84	11,340,979.78	(137,195.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	23/01/2018	1,700,000.00	1,924,435.70	1,763,468.33	160,967.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	23/01/2018	920,000.00	970,755.52	972,295.15	(1,539.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	23/01/2018	1,860,000.00	1,948,516.65	1,965,727.14	(17,210.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	11/01/2018	199,200,000.00	226,710,033.44	213,666,903.29	13,043,130.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/12/2017	15/01/2018	35,600,000.00	39,422,585.60	36,717,611.00	2,704,974.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/12/2017	25/01/2018	24,900,000.00	27,524,335.50	25,668,511.13	1,855,824.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19/12/2017	15/01/2018	5,700,000.00	6,609,371.39	6,113,745.00	495,626.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			366,220,000.00	407,664,010.45	387,441,814.59	20,222,195.87		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 149 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2018

6.- Contratos de venta forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0427	28/12/17	04/1/18	4,111,000.00	4,929,992.10	4,989,371.40	(59,379.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			4,111,000.00	4,929,992.10	4,989,371.40	(59,379.29)		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de DOP 46.7111 por USD1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 150 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	05/01/2017	05/01/2018	500,000.00	464,025.80	472,514.78	(8,488.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/02/2017	09/02/2018	1,670,000.00	1,751,404.99	1,786,748.86	(35,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	410,000.00	435,909.36	441,731.19	(5,821.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/03/2017	15/03/2018	1,650,000.00	1,746,523.00	1,766,421.02	(19,898.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/03/2017	12/03/2018	3,770,000.00	4,007,235.26	4,051,400.56	(44,165.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/04/2017	05/04/2018	4,800,000.00	5,273,557.24	5,318,715.02	(45,157.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/06/2017	26/06/2018	7,000,000.00	7,017,512.06	7,146,803.52	(129,291.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/06/2017	28/06/2018	2,200,000.00	2,243,613.28	2,319,415.33	(75,802.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/07/2017	04/07/2018	900,000.00	1,068,442.79	1,095,360.63	(26,917.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	07/07/2017	05/01/2018	200,000.00	244,531.43	245,488.35	(956.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	03/01/2018	11,150,000.00	11,825,162.20	11,880,560.08	(55,397.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	02/07/2018	210,000.00	218,586.23	223,848.23	(5,262.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	300,000.00	274,949.90	277,038.33	(2,088.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	900,000.00	931,511.39	937,415.09	(5,903.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	5,500,000.00	5,773,942.12	5,820,224.29	(46,282.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,401,767.45	1,411,238.81	(9,471.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	14,000,000.00	14,732,559.21	14,863,041.98	(130,482.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	300,000.00	327,646.91	336,199.61	(8,552.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	5,000,000.00	5,165,411.78	5,300,246.69	(134,834.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/07/2017	09/01/2018	43,700,000.00	45,332,728.65	45,715,158.00	(382,429.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2017	09/01/2018	210,000.00	227,850.72	229,533.58	(1,682.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/07/2017	10/01/2018	11,400,000.00	11,965,638.64	12,068,213.09	(102,574.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/07/2017	12/04/2018	1,200,000.00	1,170,886.90	1,193,464.42	(22,577.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/07/2017	16/01/2018	450,000.00	483,982.91	488,833.40	(4,850.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	19/07/2017	17/01/2018	30,700,000.00	34,200,664.62	34,483,336.86	(282,672.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,800,000.00	1,863,493.25	1,879,424.42	(15,931.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	300,000.00	306,292.44	308,823.98	(2,531.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	2,700,000.00	2,840,064.65	2,868,915.07	(28,850.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/07/2017	19/07/2018	1,400,000.00	1,386,821.76	1,425,481.31	(38,659.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	1,290,000.00	1,366,562.76	1,381,597.82	(15,035.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	2,110,000.00	2,242,254.63	2,258,105.53	(15,850.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	630,000.00	682,617.94	691,903.67	(9,285.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	22/01/2018	760,000.00	821,539.74	833,052.13	(11,512.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	20/04/2018	2,370,000.00	2,372,217.40	2,419,218.69	(47,001.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	880,000.00	954,159.93	966,519.33	(12,359.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	860,000.00	910,992.27	919,907.58	(8,915.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,072,809.37	1,093,537.77	(20,728.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/07/2017	27/07/2018	700,000.00	677,949.83	705,178.86	(27,229.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	190,000.00	204,957.59	207,792.28	(2,834.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 151 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	440,000.00	475,136.86	479,801.92	(4,665.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2017	31/01/2018	1,920,000.00	2,057,054.79	2,078,802.77	(21,747.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/08/2017	30/07/2018	3,000,000.00	2,936,323.38	3,014,459.40	(78,136.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/08/2017	05/01/2018	200,000.00	243,290.94	244,802.27	(1,511.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2017	31/01/2018	210,000.00	231,256.24	235,418.48	(4,162.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	4,380,000.00	4,684,093.08	4,728,276.67	(44,183.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	06/02/2018	270,000.00	292,543.56	295,420.58	(2,877.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	06/08/2018	100,000.00	109,588.40	113,830.72	(4,242.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	09/08/2018	2,400,000.00	2,372,229.90	2,434,547.20	(62,317.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	09/08/2018	300,000.00	328,584.28	337,216.03	(8,631.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	992,840.90	1,004,081.63	(11,240.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,341,525.60	2,363,605.94	(22,080.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	30/01/2018	200,000.00	250,529.67	252,936.77	(2,407.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	980,563.99	991,872.28	(11,308.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	11/07/2018	2,300,000.00	2,374,434.29	2,439,045.41	(64,611.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	17/08/2018	300,000.00	268,709.16	275,320.44	(6,611.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/08/2017	15/02/2018	1,200,000.00	1,213,030.36	1,226,549.78	(13,519.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/08/2017	20/02/2018	1,000,000.00	990,290.24	1,001,931.95	(11,641.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	900,000.00	929,177.89	936,817.88	(7,639.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,471,039.43	2,492,174.36	(21,134.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/09/2017	02/03/2018	200,000.00	220,429.15	222,492.96	(2,063.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/09/2017	31/08/2018	200,000.00	261,399.97	268,654.63	(7,254.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/09/2017	07/03/2018	200,000.00	244,950.65	247,652.70	(2,702.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/09/2017	10/01/2018	4,600,000.00	4,861,506.17	4,884,847.58	(23,341.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/09/2017	05/01/2018	14,400,000.00	15,657,850.32	15,751,838.19	(93,987.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/09/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,267,601.03	1,275,621.37	(8,020.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	11/01/2018	700,000.00	761,907.12	766,624.23	(4,717.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/09/2017	20/03/2018	1,600,000.00	1,629,204.87	1,644,679.84	(15,474.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	19/03/2018	400,000.00	417,291.17	421,116.15	(3,824.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	21/03/2018	500,000.00	477,067.29	481,358.71	(4,291.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/09/2017	26/03/2018	4,600,000.00	4,904,538.29	4,960,913.56	(56,375.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/09/2017	21/09/2018	1,700,000.00	1,964,396.85	2,023,198.72	(58,801.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2017	25/01/2018	130,000.00	139,170.54	139,918.60	(748.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,047,132.22	2,067,312.94	(20,180.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	30/01/2018	45,600,000.00	46,109,917.59	46,562,640.98	(452,723.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/10/2017	05/03/2018	200,000.00	219,871.85	221,644.52	(1,772.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	900,000.00	951,041.79	961,341.55	(10,299.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 152 de 163

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	440,000.00	475,136.86	479,801.92	(4,665.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2017	31/01/2018	1,920,000.00	2,057,054.79	2,078,802.77	(21,747.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/08/2017	30/07/2018	3,000,000.00	2,936,323.38	3,014,459.40	(78,136.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/08/2017	05/01/2018	200,000.00	243,290.94	244,802.27	(1,511.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2017	31/01/2018	210,000.00	231,256.24	235,418.48	(4,162.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	4,380,000.00	4,684,093.08	4,728,276.67	(44,183.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	06/02/2018	270,000.00	292,543.56	295,420.58	(2,877.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	06/08/2018	100,000.00	109,588.40	113,830.72	(4,242.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	09/08/2018	2,400,000.00	2,372,229.90	2,434,547.20	(62,317.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	09/08/2018	300,000.00	328,584.28	337,216.03	(8,631.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	992,840.90	1,004,081.63	(11,240.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/08/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,341,525.60	2,363,605.94	(22,080.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	30/01/2018	200,000.00	250,529.67	252,936.77	(2,407.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	980,563.99	991,872.28	(11,308.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	11/07/2018	2,300,000.00	2,374,434.29	2,439,045.41	(64,611.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	17/08/2018	300,000.00	268,709.16	275,320.44	(6,611.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/08/2017	15/02/2018	1,200,000.00	1,213,030.36	1,226,549.78	(13,519.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/08/2017	20/02/2018	1,000,000.00	990,290.24	1,001,931.95	(11,641.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	900,000.00	929,177.89	936,817.88	(7,639.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,471,039.43	2,492,174.36	(21,134.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/09/2017	02/03/2018	200,000.00	220,429.15	222,492.96	(2,063.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/09/2017	31/08/2018	200,000.00	261,399.97	268,654.63	(7,254.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/09/2017	07/03/2018	200,000.00	244,950.65	247,652.70	(2,702.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/09/2017	10/01/2018	4,600,000.00	4,861,506.17	4,884,847.58	(23,341.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/09/2017	05/01/2018	14,400,000.00	15,657,850.32	15,751,838.19	(93,987.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/09/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,267,601.03	1,275,621.37	(8,020.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	11/01/2018	700,000.00	761,907.12	766,624.23	(4,717.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/09/2017	20/03/2018	1,600,000.00	1,629,204.87	1,644,679.84	(15,474.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	19/03/2018	400,000.00	417,291.17	421,116.15	(3,824.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	21/03/2018	500,000.00	477,067.29	481,358.71	(4,291.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/09/2017	26/03/2018	4,600,000.00	4,904,538.29	4,960,913.56	(56,375.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/09/2017	21/09/2018	1,700,000.00	1,964,396.85	2,023,198.72	(58,801.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2017	25/01/2018	130,000.00	139,170.54	139,918.60	(748.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,047,132.22	2,067,312.94	(20,180.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	30/01/2018	45,600,000.00	46,109,917.59	46,562,640.98	(452,723.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/10/2017	05/03/2018	200,000.00	219,871.85	221,644.52	(1,772.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	900,000.00	951,041.79	961,341.55	(10,299.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 153 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00729	03/10/2017	04/01/2018	3,600,000.00	3,873,382.90	3,896,105.76	(22,722.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	400,000.00	446,516.32	448,753.38	(2,237.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	12,300,000.00	13,178,400.38	13,244,424.67	(66,024.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	01/02/2018	45,500,000.00	46,282,869.53	46,622,392.26	(339,522.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	02/04/2018	300,000.00	308,230.75	311,467.76	(3,237.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/10/2017	10/01/2018	2,300,000.00	2,491,100.62	2,506,184.69	(15,084.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/10/2017	03/04/2018	900,000.00	981,902.31	989,873.13	(7,970.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/10/2017	11/01/2018	900,000.00	921,501.51	926,628.52	(5,127.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/10/2017	11/01/2018	2,300,000.00	2,425,188.51	2,438,174.88	(12,986.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	11/01/2018	4,800,000.00	5,188,860.67	5,214,478.63	(25,617.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	11/01/2018	2,600,000.00	2,765,252.38	2,779,482.10	(14,229.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	11/01/2018	3,500,000.00	3,708,142.45	3,725,676.02	(17,533.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	09/04/2018	4,500,000.00	4,669,477.98	4,722,400.90	(52,922.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	11/04/2018	12,600,000.00	13,127,474.85	13,290,376.24	(162,901.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	11/04/2018	2,300,000.00	2,336,838.03	2,352,197.56	(15,359.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	12/04/2018	3,800,000.00	3,971,000.98	4,029,093.22	(58,092.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/10/2017	09/02/2018	2,900,000.00	3,024,212.52	3,035,480.05	(11,267.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	11/04/2018	22,700,000.00	25,586,858.51	25,723,258.62	(136,400.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/10/2017	16/01/2018	12,600,000.00	12,925,521.38	12,947,012.09	(21,490.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/10/2017	12/04/2018	3,900,000.00	4,098,259.00	4,129,080.58	(30,821.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	14/02/2018	4,700,000.00	4,875,101.93	4,897,238.36	(22,136.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	12/10/2018	400,000.00	461,113.12	472,708.30	(11,595.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	14/02/2018	8,900,000.00	10,009,126.79	10,033,822.88	(24,696.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/10/2017	18/04/2018	3,500,000.00	3,660,608.28	3,689,972.96	(29,364.68)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/10/2017	19/01/2018	53,300,000.00	56,198,823.24	56,315,054.53	(116,231.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00729	19/10/2017	15/02/2018	22,600,000.00	25,373,038.45	25,438,717.02	(65,678.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/10/2017	15/02/2018	1,600,000.00	1,713,610.58	1,722,312.08	(8,701.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/10/2017	19/04/2018	500,000.00	577,322.60	581,902.04	(4,579.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00729	20/10/2017	15/02/2018	4,400,000.00	4,895,498.02	4,920,356.75	(24,858.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	22/01/2018	130,000.00	137,659.97	137,573.51	86.46	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/10/2017	24/01/2018	4,600,000.00	4,924,851.58	4,925,116.68	(265.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	24/01/2018	3,900,000.00	4,104,409.17	4,111,417.42	(7,008.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	61,400,000.00	65,815,078.62	66,206,433.54	(391,354.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	47,630,670.74	47,913,896.07	(283,225.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	47,630,670.74	47,913,896.07	(283,225.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	25/10/2017	23/01/2018	9,600,000.00	10,432,705.66	10,427,558.13	5,147.53	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26/10/2017	25/04/2018	400,000.00	481,733.64	486,597.33	(4,863.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	2,330,000.00	2,535,388.10	2,541,751.69	(6,363.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 154 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	360,000.00	389,339.46	390,882.46	(1,543.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	26/04/2018	12,900,000.00	14,985,116.53	15,122,581.71	(137,465.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	31/01/2018	4,300,000.00	4,630,432.16	4,658,028.69	(27,596.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31/10/2017	01/05/2018	1,100,000.00	1,219,898.22	1,228,769.35	(8,871.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	450,000.00	486,653.40	488,540.20	(1,886.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/11/2017	11/01/2018	19,200,000.00	21,468,840.90	21,547,978.23	(79,137.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	4,610,000.00	5,008,839.97	5,032,427.30	(23,587.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	08/01/2018	4,500,000.00	4,989,326.54	5,010,885.03	(21,558.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	6,800,000.00	7,371,047.54	7,405,758.84	(34,711.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	11/01/2018	6,700,000.00	7,861,251.35	7,873,893.21	(12,641.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/11/2017	01/11/2018	100,000.00	152,223.25	156,389.28	(4,166.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/01/2018	450,000.00	484,371.38	485,968.42	(1,597.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	02/03/2018	200,000.00	219,894.61	221,127.97	(1,233.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	04/01/2018	1,100,000.00	1,286,695.98	1,288,612.46	(1,916.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2017	06/02/2018	8,800,000.00	9,656,320.78	9,686,774.67	(30,453.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	11,010,000.00	11,984,493.11	12,029,750.62	(45,257.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	930,000.00	1,013,654.21	1,015,640.64	(1,986.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	90,000.00	98,800.13	99,296.48	(496.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	2,770,000.00	3,030,494.54	3,068,530.23	(38,035.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	220,000.00	243,336.15	244,415.36	(1,079.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/11/2017	06/02/2018	2,100,000.00	2,450,373.17	2,460,644.67	(10,271.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	18/04/2018	700,000.00	798,633.34	807,535.29	(8,901.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	08/05/2018	3,400,000.00	3,806,763.45	3,845,479.92	(38,716.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/11/2017	09/05/2018	1,400,000.00	1,537,440.07	1,548,791.16	(11,351.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/11/2017	18/01/2018	16,900,000.00	20,057,254.77	20,108,508.37	(51,253.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/01/2018	2,340,000.00	2,545,721.38	2,553,355.02	(7,633.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	3,350,000.00	3,649,032.35	3,665,216.06	(16,183.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	520,000.00	576,471.76	579,328.99	(2,857.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	440,000.00	489,811.68	492,239.39	(2,427.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/11/2017	14/05/2018	12,900,000.00	15,318,901.75	15,428,303.82	(109,402.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/11/2017	15/05/2018	8,600,000.00	10,278,225.54	10,522,535.39	(244,309.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	16/01/2018	4,560,000.00	4,968,562.21	4,975,793.68	(7,231.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	15/02/2018	330,000.00	364,404.37	365,347.64	(943.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	14/05/2018	130,000.00	135,384.77	136,211.88	(827.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16/11/2017	12/01/2018	3,400,000.00	4,099,862.59	4,100,219.42	(356.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	13/02/2018	5,840,000.00	6,448,174.46	6,463,303.02	(15,128.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	22/02/2018	3,360,000.00	3,680,121.06	3,692,004.35	(11,883.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 155 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas (continuación)								
Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	17/11/2017	19/04/2018	90,000.00	93,369.80	94,071.68	(701.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	20/03/2018	700,000.00	800,664.61	804,440.62	(3,776.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	17/05/2018	500,000.00	547,111.47	550,758.69	(3,647.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	480,000.00	529,960.61	530,449.70	(489.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/11/2017	22/05/2018	200,000.00	186,727.81	188,004.57	(1,276.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	21/11/2017	22/02/2018	40,000.00	48,778.31	48,956.02	(177.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	750,000.00	828,990.84	832,153.93	(3,163.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	12/04/2018	220,000.00	224,288.68	225,418.09	(1,129.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	20/02/2018	9,200,000.00	11,061,403.92	11,096,734.48	(35,330.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	21/05/2018	400,000.00	471,069.51	476,972.76	(5,903.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	22/05/2018	310,000.00	323,338.86	326,017.44	(2,678.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	22/01/2018	8,600,000.00	9,903,955.67	9,918,193.43	(14,237.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	22/01/2018	200,000.00	243,731.76	244,385.23	(653.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	08/01/2018	400,000.00	498,665.51	498,954.95	(289.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	24/01/2018	20,900,000.00	23,674,683.24	23,734,731.20	(60,047.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	23/05/2018	1,200,000.00	1,416,343.06	1,430,002.86	(13,659.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	3,800,000.00	4,211,939.45	4,228,926.91	(16,987.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/05/2018	103,900,000.00	131,108,245.57	133,016,774.34	(1,908,528.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/11/2017	29/05/2018	4,100,000.00	4,717,504.47	4,765,332.85	(47,828.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	440,000.00	487,520.58	488,585.56	(1,064.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	1,350,000.00	1,484,485.42	1,490,192.91	(5,707.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	01/03/2018	4,460,000.00	4,933,859.43	4,953,758.52	(19,899.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	02/03/2018	740,000.00	815,631.80	818,684.23	(3,052.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	9,900,000.00	12,322,376.17	12,350,750.26	(28,374.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	8,400,000.00	10,440,731.29	10,464,772.62	(24,041.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/11/2017	28/05/2018	3,000,000.00	3,540,995.27	3,577,952.08	(36,956.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	15/01/2018	18,080,000.00	19,881,297.09	19,940,545.93	(59,248.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	140,000.00	149,228.98	149,541.69	(312.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	510,000.00	563,054.25	565,908.92	(2,854.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	12/01/2018	600,000.00	745,655.77	746,646.65	(990.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,498,461.91	1,502,844.43	(4,382.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	29/05/2018	500,000.00	549,484.58	555,626.33	(6,141.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	30/05/2018	2,100,000.00	2,447,155.49	2,472,759.96	(25,604.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	30/11/2017	30/05/2018	82,700,000.00	100,556,115.74	101,796,509.11	(1,240,393.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	15/01/2018	8,890,000.00	9,771,638.05	9,794,670.11	(23,032.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	01/03/2018	4,530,000.00	5,012,559.73	5,041,096.59	(28,536.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	02/03/2018	220,000.00	243,836.52	244,799.54	(963.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 156 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas (continuación)								
Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	01/12/2017	01/03/2018	39,600,000.00	44,141,055.33	44,429,079.30	(288,023.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	26/11/2018	4,400,000.00	5,031,864.69	5,167,131.60	(135,266.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/12/2017	06/03/2018	21,400,000.00	24,073,576.08	24,235,519.72	(161,943.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	2,780,000.00	3,091,867.79	3,112,666.87	(20,799.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	04/05/2018	200,000.00	221,370.63	222,966.80	(1,596.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	05/01/2018	1,100,000.00	1,236,765.12	1,239,802.53	(3,037.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/04/2018	18,600,000.00	20,993,730.82	21,144,820.75	(151,089.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/04/2018	7,800,000.00	8,738,316.95	8,801,205.81	(62,888.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	06/02/2018	4,300,000.00	4,824,637.31	4,839,853.15	(15,215.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	549,264.23	555,632.08	(6,367.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	440,000.00	456,959.80	462,993.49	(6,033.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	10/01/2018	12,400,000.00	15,024,637.22	15,056,116.17	(31,478.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	04/06/2018	100,000.00	135,507.23	136,611.13	(1,103.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	10/01/2018	2,200,000.00	2,617,441.42	2,627,279.67	(9,838.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	890,000.00	990,289.76	994,811.49	(4,521.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	07/02/2018	12,100,000.00	14,648,911.05	14,693,852.71	(44,941.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2017	06/06/2018	1,700,000.00	1,993,250.23	2,012,839.39	(19,589.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	7,040,000.00	7,732,951.60	7,752,924.09	(19,972.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	10/01/2018	1,200,000.00	1,321,114.63	1,324,156.89	(3,042.26)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	13/03/2018	4,300,000.00	4,777,361.01	4,807,664.80	(30,303.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	360,000.00	405,543.10	404,275.63	1,267.47	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	3,590,000.00	3,986,976.94	4,014,754.10	(27,777.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	8,600,000.00	9,612,276.80	9,674,434.27	(62,157.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/06/2018	15,800,000.00	17,798,013.10	17,977,987.29	(179,974.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	17,700,000.00	20,473,758.90	20,523,680.06	(49,921.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/01/2018	300,000.00	297,716.37	298,173.70	(457.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	20,900,000.00	23,261,391.36	23,397,316.89	(135,925.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	1,100,000.00	1,271,923.11	1,279,619.52	(7,696.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	190,000.00	206,441.17	208,604.69	(2,163.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/03/2018	1,320,000.00	1,464,428.91	1,475,241.15	(10,812.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,550,647.68	2,559,801.98	(9,154.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/03/2018	2,200,000.00	2,489,412.25	2,506,238.10	(16,825.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/06/2018	5,800,000.00	6,489,431.44	6,552,364.67	(62,933.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	460,000.00	509,750.89	510,957.00	(1,206.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	1,100,000.00	1,220,079.66	1,225,079.03	(5,714.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	420,000.00	468,629.90	471,797.35	(3,167.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	620,000.00	693,280.61	697,390.23	(4,109.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 157 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas (continuación)								
Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	400,000.00	483,210.62	484,856.17	(1,645.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	13/02/2018	12,200,000.00	14,792,190.49	14,854,489.06	(62,298.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	13/12/2017	13/03/2018	6,800,000.00	7,920,443.19	7,967,393.93	(46,950.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	15/01/2018	4,400,000.00	4,893,877.39	4,907,444.90	(13,567.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	15/01/2018	16,700,000.00	18,435,100.50	18,486,208.94	(51,108.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2017	12/06/2018	4,200,000.00	4,720,239.98	4,772,866.48	(52,626.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	05/01/2018	101,000,000.00	121,345,799.34	121,016,398.49	329,400.85	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	41,500,000.00	51,142,347.06	51,750,374.81	(608,027.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/02/2018	16,600,000.00	20,135,294.82	20,203,385.51	(68,090.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/12/2017	02/01/2018	24,900,000.00	28,194,272.05	28,263,757.84	(69,485.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	830,000.00	920,164.30	921,884.97	(1,720.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	480,000.00	532,756.29	534,194.73	(1,438.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,320,000.00	1,453,090.33	1,454,603.40	(1,513.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	420,000.00	469,176.51	471,990.16	(2,813.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	370,000.00	412,491.29	415,774.36	(3,283.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	2,110,000.00	2,343,971.18	2,355,526.24	(11,555.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1,400,000.00	1,546,005.44	1,553,606.81	(7,601.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	19/01/2018	520,000.00	580,635.19	582,076.94	(1,441.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	470,000.00	526,713.86	529,088.91	(2,375.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	11,300,000.00	13,565,647.68	13,604,111.00	(38,463.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	20/03/2018	1,500,000.00	1,723,676.41	1,734,663.79	(10,987.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	21/03/2018	2,900,000.00	3,196,675.96	3,220,103.43	(23,427.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19/12/2017	18/01/2018	26,800,000.00	32,648,902.39	32,779,839.26	(130,936.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	947,293.41	952,545.73	(5,252.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	3,100,000.00	3,413,664.46	3,424,514.65	(10,850.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8,350,000.00	9,198,837.17	9,226,163.91	(27,326.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,740,000.00	5,221,520.07	5,238,116.45	(16,596.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	140,000.00	155,109.94	155,699.72	(589.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,370,000.00	4,831,860.99	4,856,273.43	(24,412.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	13/02/2018	1,120,000.00	1,237,346.90	1,242,558.09	(5,211.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	3,610,000.00	4,008,773.42	4,027,949.45	(19,176.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,950,000.00	2,167,224.31	2,180,772.39	(13,548.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	120,000.00	134,236.19	135,844.09	(1,607.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	1,002,208.40	1,008,804.99	(6,596.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	21/03/2018	550,000.00	614,263.66	617,744.98	(3,481.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	18/01/2018	4,100,000.00	4,841,541.12	4,850,900.04	(9,358.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	21/03/2018	2,600,000.00	2,864,174.70	2,885,165.37	(20,990.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 158 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	20/12/2017	19/06/2018	16,000,000.00	18,134,207.35	18,298,561.15	(164,353.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	14/12/2018	4,200,000.00	4,618,821.65	4,734,576.78	(115,755.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	3,300,000.00	3,708,884.66	3,728,900.23	(20,015.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	20/03/2018	12,500,000.00	14,034,848.61	14,130,142.61	(95,294.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	18/06/2018	200,000.00	177,020.15	178,640.56	(1,620.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2,180,000.00	2,418,454.96	2,426,972.01	(8,517.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	3,440,000.00	3,803,851.22	3,814,752.99	(10,901.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	8,850,000.00	9,792,971.35	9,840,498.99	(47,527.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	220,000.00	245,792.39	247,257.14	(1,464.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	3,660,000.00	4,068,566.35	4,102,965.92	(34,399.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	100,000.00	154,781.08	155,326.17	(545.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/12/2017	19/06/2018	200,000.00	187,064.57	188,605.50	(1,540.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	440,000.00	486,370.45	488,066.53	(1,696.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	3,160,000.00	3,460,915.24	3,487,719.55	(26,804.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	4,730,000.00	5,275,271.03	5,306,262.30	(30,991.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	150,000.00	167,974.26	168,821.84	(847.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/02/2018	6,100,000.00	7,401,051.93	7,378,110.27	22,941.66	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	21/03/2018	61,800,000.00	75,205,079.86	75,740,595.89	(535,516.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/01/2018	630,000.00	697,746.51	696,302.88	1,443.63	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	27/03/2018	470,000.00	523,874.47	527,338.32	(3,463.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	28/03/2018	2,600,000.00	2,925,462.13	2,949,421.35	(23,959.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	180,000.00	205,252.11	206,028.43	(776.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/02/2018	3,070,000.00	3,428,930.99	3,423,295.35	5,635.64	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/03/2018	300,000.00	298,335.95	300,494.42	(2,158.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	07/02/2018	1,750,000.00	1,950,553.03	1,947,680.41	2,872.62	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	3,810,000.00	4,260,368.99	4,289,061.61	(28,692.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	460,000.00	518,880.44	522,698.30	(3,817.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	380,000.00	428,025.41	431,174.77	(3,149.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,200,000.00	1,343,825.52	1,353,713.23	(9,887.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,480,000.00	1,658,599.89	1,670,803.67	(12,203.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	28/03/2018	200,000.00	300,228.17	302,749.52	(2,521.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,963,740,000.00	2,204,069,759.81	2,218,930,640.24	(14,860,880.43)		

e) Oro

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 159 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

7.- Contratos de compra de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 160 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

8.- Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I -Página 161 de 163

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

8.- Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I -Página 162 de 163

31 de diciembre de 2017

9. Inversiones en otras obligaciones DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
N/A	Pagares Ministerio de Hacienda MH1218	2,000,000,000.00	399,999,999.97	399,999,999.97	-	DOP	100%
Total		2,000,000,000.00	399,999,999.97	399,999,999.97	-		100%

9. Inversiones en otras obligaciones USD (*)

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
N/A	Banco Múltiple Lafise				-	USD	100%
Total					-		

10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
DO1002217029	BCRD 0% 05-ENE-2018	100,000,000.00	99,874,028.30	99,867,000.00	(7,028.30)	DOP	OTC	19.83%
DO1002235823	BCRD 15.5% 13-JUL-18	120,000,000.00	124,746,169.01	125,242,200.00	496,030.99	DOP	OTC	24.59%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	720,000.00	773,615.56	795,754.08	22,138.52	DOP	OTC	26.90%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	192,000,000.00	205,704,928.78	206,174,976.00	470,047.22	DOP	OTC	2.40%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	500,000,000.00	521,116,324.70	522,562,500.00	1,446,175.30	DOP	OTC	0.66%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	90,000,000.00	92,311,986.03	92,633,400.00	321,413.97	DOP	OTC	1.44%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	222,500,000.00	230,537,198.16	231,185,732.50	648,534.34	DOP	OTC	13.10%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	22,600,000.00	22,778,116.83	23,329,844.40	551,727.57	DOP	OTC	2.50%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	321,400,000.00	337,360,294.85	345,083,323.20	7,723,028.35	DOP	OTC	2.35%
Total		1,569,220,000.00	1,635,202,662.22	1,646,874,730.18	11,672,067.96			100.00%

En USD (*)

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total		N/A	N/A	N/A	N/A			

b) Acciones

Código ISIN	Acciones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total		N/A	N/A	N/A	N/A			



LPHA Sociedad de Valores, S. A.
Formación Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN
de diciembre de 2018 y 2017
valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1 de diciembre de 2017
0. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida
) Inversiones en otras obligaciones

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
ADA QUE REPORTAR	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total			N/A	N/A	N/A	N/A		

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas



Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

LPHA Sociedad de Valores, S. A.
formación Suplementaria

NEXO II - ESTADOS DE CARTERA EN CUSTODIA
al 31 de diciembre de 2018 y 2017
valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

TADO DE CARTERA EN CUSTODIA

continuación presentamos los estados de cartera en custodia de la Compañía al 31 de diciembre de 2018 y 2017.

Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado	Moneda de Denominación
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	2,511	1,199	1,312	4,676,019,792	194,433,945	DOP
Personas Jurídicas DOP	231	103	128	1,152,625,240	29,338,201	DOP
Clientes Profesionales DOP	127	74	53	8,711,062,328	302,220,718	DOP
Personas Físicas USD	155	-	-	19,662,785	199,252	USD
Personas Jurídicas USD	14	-	-	12,961,484	159,340	USD
Clientes Profesionales USD	13	-	-	25,523,261	277,730	USD
total Clientes	2,869	1,376	1,493	14,539,707,360	525,992,864	DOP
Total USD	182	-	-	58,147,530	636,322	USD

Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	31 de diciembre de 2017			Fruto devengado	Moneda de Denominación
		Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal		
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	2,183	969	1,214	5,244,337,148	240,409,687	DOP
Personas Físicas USD	255	35	220	1,375,012,296	48,981,305	DOP
Personas Jurídicas DOP	85	35	50	12,789,506,515	487,767,197	DOP
Personas Jurídicas USD	109	109	-	12,349,246	170,886	USD
Clientes Profesionales DOP	4	4	-	2,323,861	25,813	USD
Clientes Profesionales USD	11	11	-	13,374,894	157,281	USD
total Clientes	2,523	1,039	1,484	19,408,855,958	777,158,189	DOP
Total USD	124	124	-	28,048,001	353,979	USD

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO III - ESTADOS DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

Anexo III - Página 1 de 1

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADOS DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

A continuación presentamos los estados de otros resultados integrales, comprendidos durante los años terminados al 31 de diciembre de 2018 y 2017.

	<u>2018</u>	<u>2017</u>
Utilidad neta	415,974,616	580,949,151
Ingresos (Gastos) registrados con abono (cargo) a patrimonio		
Revalorización de propiedades, planta y equipo	0.00	0.00
Activos financieros a valor razonable por patrimonio	0.00	0.00
Participación de otros resultados integrales de inversiones en sociedades	0.00	0.00
Otros ingresos (gastos) registrados con abono (cargo) a Patrimonio		
Impuesto sobre la renta de otros resultados integrales	0.00	0.00
Operaciones descontinuadas	0.00	0.00
Total, ingresos (gastos) registrados con abono (cargo) a Patrimonio	0.00	0.00
Total de resultados integrales reconocidos del ejercicio	415,974,616	580,949,151

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas



Documento firmado digitalmente por:
Juan Barranco (26/08/2020 10:43 AST)
Santiago Adolfo Camarena Torres (26/08/2020 10:58 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/T20N-N2R3-OQ9K-ME6X>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO IV - TABLAS DE RIESGO DE LIQUIDEZ

Anexo IV - Página 1 de 2

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Tablas de riesgo de liquidez:

A continuación presentamos la determinación de los flujos de cajas estático y flujos de cajas acumulado al 31 de diciembre de 2018 y 2017.

	Al 31 de diciembre de 2018								Total Bands	Total 30 días
	1- Hasta 6	2- de 7 a 15	3- de 16 a 30	4- de 31 a 60	5- de 61 a 90	6- de 91 a 180	7- de 181 a 360	8- Más de 360		
Efectivo y Equivalente de Efectivo	1,501,082,632	-	-	-	-	-	-	-	1,501,082,632	1,501,082,632
Instrumento Financiero de Cartera Propia Disponible	3,261,038,479	-	-	-	-	2,117,442	130,539,358	277,259,548	3,670,954,827	3,261,038,479
Inversiones a Costo Amortizado	-	-	879,272,285	357,876,423	-	848,976,109	-	-	2,086,124,817	879,272,285
Instrumento Financiero de Cartera Propia Comprometida	-	-	-	-	-	-	-	196,482	196,482	-
Contratos Derivados	6,510,750	7,641,089	11,636,226	7,800,251	18,369,924	8,260,424	1,125	-	60,219,789	25,788,065
Impuestos por Cobrar	-	-	-	-	-	-	65,692,596	-	65,692,596	-
Impuestos Diferidos	-	-	-	-	-	-	35,988,543	-	35,988,543	-
Activos Intangibles	-	-	-	-	-	-	-	2,892,967	2,892,967	-
Otras Cuentas por Cobrar	194,325	11,324,259	174,575	7,830,295	8,630,569	1,321,740	10,786	1,000,000	30,486,549	11,693,159
Inversiones en Sociedades	-	-	-	-	-	-	-	118,279,510	118,279,510	-
Propiedades de Planta y Equipo	-	-	-	-	-	-	-	7,596,671	7,596,671	-
Otros Activos	-	-	908,068	-	-	-	93,412	567,747	1,569,227	908,068
Total de Activos	4,768,826,186	18,965,348	891,991,154	373,506,969	27,000,493	860,675,715	232,325,820	407,792,925	7,581,084,610	5,679,782,688
Pasivos Financieros a Valor Razonable	222,723,022	754,581,499	1,189,648,776	376,378,566	370,295,859	1,122,780,527	100,834,904	6,032,080	4,143,275,233	2,166,953,297
Instrumentos Financieros Derivados	6,080,321	15,553,590	28,817,443	17,925,015	63,006,401	8,828,862	748,645	151,471	141,111,748	50,451,354
Operaciones de Financiamientos	-	-	-	1,034,589	-	687,385,753	-	600,000,000	1,288,420,342	-
Otras Cuentas por Pagar	-	35,653	7,913,960	-	-	-	-	-	33,187,713	33,187,713
Otros Pasivos	315,302	-	12,315,780	-	-	56,733,673	-	-	69,364,755	12,631,082
Impuestos por Pagar	-	-	3,708,639	-	-	-	-	-	3,708,639	3,708,639
Total Pasivos	254,356,745	770,170,742	1,242,404,598	395,338,170	433,302,260	1,875,728,815	101,583,549	606,183,551	5,679,068,430	2,266,932,085
Flujo de caja estático	4,514,469,441	(751,205,394)	(350,413,444)	(21,831,201)	(406,301,767)	(1,015,053,100)	130,742,271	(198,390,626)	1,902,016,180	3,412,850,603
Flujo de caja acumulado	4,514,469,441	3,763,264,047	3,412,850,603	3,391,019,402	2,984,717,635	1,969,664,535	2,100,406,806	1,902,016,180		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO IV - TABLAS DE RIESGO DE LIQUIDEZ

Anexo IV - Página 2 de 2

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Tablas de riesgo de liquidez: (continuación):

	<u>2017</u>								Total Bands	Total 30 días
	<u>1- Hasta 6</u>	<u>2- de 7 a 15</u>	<u>3- de 16 a 30</u>	<u>4- de 31 a 60</u>	<u>5- de 61 a 90</u>	<u>6- de 91 a 180</u>	<u>7- de 181 a 360</u>	<u>8- Más de 360</u>		
Efectivo y equivalentes de efectivo	2,050,852,717	-	-	-	-	-	-	-	2,050,852,717	2,050,852,717
Certificado financiero	1,090,678,043	-	-	-	-	-	-	-	1,090,678,043	1,090,678,043
Inversiones en instrumentos financieros:										
A valor razonable con cambios en resultados disponible	2,947,948,362	-	-	-	-	-	1,253,053	703,244,601	3,652,446,016	2,947,948,362
A valor razonable con cambios en resultados comprometida	1,714,138,717	-	-	-	-	-	-	-	1,714,138,717	1,714,138,717
A valor razonable instrumentos financieros derivados	1,863,172	25,730,305	11,583,104	6,920,371	13,982,557	26,870	-	-	60,106,379	39,176,581
A costo amortizado								401,066,667	401,066,667	-
Otras Cuentas por Cobrar	65,582,578	8,893,136	114,699	11,663,139	44,842,249	13,349,714	131,597		144,577,112	74,590,413
Total	7,871,063,589	34,623,441	11,697,803	18,583,510	58,824,806	13,376,584	1,384,650	1,104,311,268	9,113,865,651	7,917,384,833
Pasivos financieros:										
A valor razonable	(250,719,085)	(679,945,145)	(1,086,923,150)	(833,201,433)	(249,857,051)	(476,935,021)	(47,263,726)	-	(3,624,844,611)	(2,017,587,380)
A Valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(42,462,100)	(162,105,178)	(190,613,105)	(155,531,093)	(264,762,005)	(7,272,444)	(798,846)	-	(823,544,771)	(395,180,383)
A costo amortizado:										
Obligaciones con bancos			(4,878,889)		-		(1,860,241,252)	-	(1,865,120,141)	(4,878,889)
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos				(1,015,068)	-	(11,767,672)	-	(875,000,000)	(887,782,740)	
Otras cuentas por pagar	(553,926)	(5,880,305)	(931,805)	-	-	-	-	-	(7,366,036)	(7,366,036)
Cuentas por pagar a relacionadas	-	(2,224,156)	-	-	-	-	-	-	(2,224,156)	(2,224,156)
Acumulaciones y otras obligaciones	-	-	(9,907,048)	-	(40,705,840)	-	-	-	(50,612,888)	(9,907,048)
Total	(293,735,111)	(850,154,784)	(1,293,253,997)	(989,747,594)	(555,324,896)	(495,975,137)	(1,908,303,824)	(875,000,000)	(7,261,495,343)	(2,437,143,892)
Flujo de caja estático	7,577,328,478	(815,531,343)	(1,281,556,194)	(971,164,084)	(496,500,090)	(482,598,553)	(1,906,919,174)	283,860,134	1,055,338,772	10,305,776,468
Flujo de caja acumulado	7,577,328,478	6,761,797,134	5,480,240,941	4,509,076,857	4,012,576,767	3,529,978,214	1,623,059,040	1,339,198,906		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 1 de 3

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas

A continuación presentamos otras notas informativas requeridas por la Superintendencia Valores de la República Dominicana:

Deudores por intermediación

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la Compañía no mantenía saldos en las cuentas de deudores por intermediación.

Cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la compañía no mantenía cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia.

Propiedad de Inversión

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la compañía no mantenía propiedades de inversión.

Arrendamientos

La Compañía mantiene un contrato de arrendamiento operativo con una relacionada con vencimiento el 28 de junio de 2020.

Acreedores por intermediación

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la Compañía no mantenía cuenta por pagar a acreedores por intermediación.

Cuentas por pagar por operaciones de cartera propia

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la Compañía no mantenía saldo en la cuenta por pagar por operaciones de cartera propia.

Hechos relevantes

El siguiente es un listado de los hechos relevantes ocurridos desde 1ro. de enero de 2018 al 31 de diciembre de 2018.

Fecha	Descripción de Hecho Relevante
29/11/2018	Notificación que el 28/11/18 suscribió un Contrato de Línea de Crédito con Citibank N.A.
02/11/2018	Informe Representante de la masa de obligacionistas de los Bonos Corporativos por DOP1,000MM (SIVEM-098) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a septiembre de 2018.
02/11/2018	Informe Representante de la masa de obligacionistas de los Bonos Corporativos por DOP1,000MM (SIVEM-119) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a septiembre de 2018.
19/10/2018	Ratificación Calificación de Riesgo, A- perspectivas estables, a ALPHA SOCIEDAD VALORES, S.A y los Programas de Bonos Corporativos SIVEM-098 y SIVEM-119, a octubre 2018 por Feller Rate.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 2 de 3

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas (continuación)

Hechos relevantes (continuación)

Fecha	Descripción de Hecho Relevante
14/09/2018	Notificación que el 13/09/18 adquirió un crédito de la Corporación de Empresas Eléctricas Estatales (CDEE) por un valor de USD\$6,951,166.88, en virtud del Contrato de Cesión de Créditos suscrito entre Alpha y Dominican Power Partners.
29/08/2018	Notificación que el 28/08/18 suscribió un Contrato de Línea de Crédito con Garantía Prendaria con Citibank N.A., Sucursal Rep. Dom., por un monto de USD\$10,000,000.00.
06/08/2018	Informe Representante de la masa de obligacionistas de los Bonos Corporativos por DOP1,000MM (SIVEM-098) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a junio de 2018.
06/08/2018	Informe Representante de la masa de obligacionistas de los Bonos Corporativos por DOP1,000MM (SIVEM-119) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a junio de 2018.
02/08/2018	Notificación que adquirió un crédito de la Corporación de Empresas Eléctricas Estatales (CDEE) por un valor de USD\$16,921,631.82, en virtud del Contrato de Cesión de Créditos suscrito entre Alpha y Dominican Power Partners.
27/07/2018	Aprobación de la Asamblea Ordinaria de Accionistas de fecha 26/07/18 la distribución de dividendos por RD\$500,000,000.
20/07/2018	Cambios en la Calificación de Riesgo de BBB+ a A- y la perspectiva de positivas a estables, a ALPHA SOCIEDAD VALORES, S.A y al Programa de Bonos Corporativos SIVEM-098 a julio 2018 por Feller Rate.
19/07/2018	Finalización de la colocación en el Mercado Primario de la 1ra y 2da emisión del programa de emisiones de Bonos Corporativos SIVEM-119.
19/06/2018	Aviso de Colocación Primaria de la Primera y Segunda Emisión del Programa de Emisiones de Bonos Corporativos SIVEM-119 de Alpha Sociedad de Valores, S.A. Puesto de Bolsa. a publicar en fecha 27/11/2017.
19/06/2018	La fecha de inicio del período Colocación de la Primera y Segunda Emisión del Programa de Emisiones de Bonos Corporativos SIVEM-119, de Alpha Sociedad de Valores, S.A. Puesto de Bolsa. es el 28-06-2018.
08/05/2018	Informe Representante de la masa de obligacionistas de los Bonos Corporativo por DOP1,000MM (SIVEM-098) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a marzo de 2018.
1/05/2018	Alpha Sociedad de Valores, S.A., publicó la convocatoria de su Asamblea General Ordinaria Anual de Accionistas a celebrarse el 16 de mayo del 2018.
20/04/2018	Ratificación de Calificación de Riesgo de BBB+ perspectivas positivas a; ALPHA SOCIEDAD VALORES, S.A y al Programa de Bonos Corporativos SIVEM-098 a abril 2018 por Feller Rate.
07/02/2018	Informe de Representante de Obligacionistas de los Bonos Corporativo por DOP1,000MM (SIVEM-098) de Alpha Sociedad de Valores, S.A., a diciembre de 2017.
22/01/2018	Ratificación de Calificación de Riesgo de BBB+ perspectiva estable a; ALPHA SOCIEDAD VALORES, S.A y al Programa de Bonos Corporativos SIVEM-098 a enero 2018 por Feller Rate.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 3 de 3

31 de diciembre de 2018 y 2017

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas (continuación)

Hechos posteriores

A juicio de la Administración entre el 31 de diciembre de 2018 y la fecha de presentación de estos estados financieros, no existen hechos posteriores significativos que afecten los estados financieros de la Compañía.

Otras revelaciones importantes

A juicio de la administración, a la fecha de presentación de estos estados financieros, no existen otras revelaciones importantes que afecten a los estados financieros de la Compañía.

Inversiones, transacciones y operaciones activas o pasivas no previstas en la Ley del Mercado de Valores, o en Normas y Resoluciones emanadas de la Superintendencia de Valores de la República Dominicana

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, la Compañía no ha realizado inversiones, transacciones y operaciones activas o pasivas no previstas en la Ley del Mercado de Valores, o en Normas y Resoluciones emanadas de la Superintendencia de Valores de la República Dominicana.

Estados financieros ajustados por inflación

Al 31 de diciembre de 2018 y 31 de diciembre de 2017, los estados financieros no se presentan ajustados por inflación, debido a que para tales años dicho índice no alcanzó más de un dígito y no implica cambios importantes para ser revelados.