

Estados Financieros

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

(Puesto de Bolsa)

31 de diciembre de 2019

(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.....	9-61
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 2019, 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 2019, 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 más significativo en nuestra auditoría de los estados financieros del año terminado el 31 de diciembre de 2019. 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, que son valuadas a los precios cotizados en el mercado de valores y para aquellos instrumentos financieros que no existe un mercado de valores activo, el valor es determinado utilizando técnicas de valoración observables y no observables en el mercado aprobadas por la Superintendencia del Mercado 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 2019, se incluye en la nota 8 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 2019, 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 2019.
- 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 2019.
- 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 2019.
- 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 2019, considerando los precios transados en el mercado de estos instrumentos financieros al 31 de diciembre de 2019.

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 al 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 al 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.

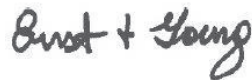
- Evaluamos la presentación global, estructura y contenido de los estados financieros, incluyendo las revelaciones, y si dichos estados financieros representan las transacciones subyacentes y eventos de manera que logren la presentación razonable.

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 2019 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 ICPARD No. 5296).



14 de mayo de 2020
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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		2019	2018
	Notas		
Activos			
Efectivo y equivalentes de efectivo	6 y 7	2,444,020,868	2,350,058,741
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	6 y 8	8,103,296,722	3,671,151,309
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	6 y 9	21,672,355	60,219,789
A costo amortizado corto plazo	6 y 10	1,177,050,623	1,237,148,708
Otras cuentas por cobrar	6 y 11	63,707,038	30,962,364
Anticipos de impuesto sobre la renta	20	68,827,475	65,692,596
Impuesto sobre la renta diferido	20	-	35,988,543
Total activos Corrientes		11,878,575,081	7,451,222,050
Inversiones en acciones	12	118,279,510	118,279,510
Mobiliario y equipos	13	5,196,610	5,006,304
Cargos diferidos	14	5,411,841	5,483,334
Otros activos		1,159,037	1,093,412
TOTAL DE ACTIVOS		12,008,622,079	7,581,084,610
Pasivos y Patrimonio			
Pasivos financieros:			
A valor razonable	6 y 15	5,031,681,145	4,143,275,233
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados	6 y 9	234,776,490	141,111,748
A costo amortizado:			
Obligaciones con bancos	6 y 16	3,001,120,757	-
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo	17	226,068,492	688,420,342
Otras cuentas por pagar	6	15,014,991	31,572,619
Cuentas por pagar a relacionadas	18	-	1,615,094
Acumulaciones y otras obligaciones por pagar	19	74,776,214	73,073,394
Total pasivos Corrientes		8,583,438,089	5,079,068,430
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo	17	1,000,000,000	600,000,000
Total Pasivos		9,583,438,089	5,679,068,430
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		1,345,183,852	822,016,042
Total de patrimonio		2,425,183,990	1,902,016,180
TOTAL DE PASIVOS Y PATRIMONIO		12,008,622,079	7,581,084,610

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 10:54 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRALES

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		<u>2019</u>	<u>2018</u>
	<u>Notas</u>		
Resultados por instrumentos financieros			
A valor razonable	8, 15 y 22	2,257,397,707	2,645,009,048
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	9 y 22	(1,321,047,110)	(2,084,642,727)
A costo amortizado	10 y 22	114,060,169	86,394,548
Total resultados por instrumentos financieros		<u>1,050,410,766</u>	<u>646,760,869</u>
Resultado por intermediación			
Comisiones por operaciones bursátiles y extrabursátiles		5,198,639	2,071,498
Gastos por comisiones y servicios		(50,227,692)	(22,234,998)
Total resultados por intermediación		<u>(45,029,053)</u>	<u>(20,163,500)</u>
Gastos por financiamiento	16 y 17	(240,912,532)	(124,449,629)
Gastos de administración y comercialización	23	(324,334,959)	(300,499,429)
Otros resultados			
Ganancia en cambio de moneda extranjera, neta	6	64,311,646	100,141,144
Resultado de inversiones en sociedades	12	7,489,709	7,794,184
Ingresos financieros	7	45,870,742	95,493,731
Otros ingresos		1,401,911	567,639
Total otros resultados		<u>119,074,008</u>	<u>203,996,698</u>
Resultado antes del impuesto sobre la renta		559,208,230	405,645,009
Impuesto sobre la renta	20	(36,040,420)	10,329,607
Utilidad neta		<u><u>523,167,810</u></u>	<u><u>415,974,616</u></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 10:54 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>



Sociedad de Valores, S. A.

Financieros

DE CAMBIOS EN EL PATRIMONIO los terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018 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 2018	900,000,000	138	180,000,000	906,041,426	1,986,041,564
del ejercicio	-	-	-	415,974,616	415,974,616
declarados	-	-	-	(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
del ejercicio	-	-	-	523,167,810	523,167,810
1 de diciembre de 2019	900,000,000	138	180,000,000	1,345,183,852	2,425,183,990

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 10:54 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE FLUJOS DE EFECTIVO

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Flujo neto originado por actividades de la operación:		
Comisiones pagadas	(45,029,054)	(20,203,000)
Ingreso neto por instrumentos financieros a valor razonable	(1,286,341,798)	4,890,419,948
Egreso neto por instrumentos financieros a derivados	(1,486,214,965)	(2,642,649,919)
Ingreso (egreso) neto por instrumentos financieros a costo amortizado	454,269,567	(509,647,115)
Gastos de administración y comercialización pagados	(356,022,093)	(251,304,846)
Intereses pagados	(214,844,040)	(108,112,988)
Impuestos pagados	(756,901)	(12,329,860)
Otros ingresos netos por actividades de la operación	49,877,514	81,829,412
Flujo neto originado por (usado en) las actividades de operación	<u>(2,885,061,770)</u>	<u>1,428,001,632</u>
Flujo neto originado por actividades de inversión:		
Dividendos y otros ingresos percibidos de inversiones en sociedades	7,489,709	7,794,184
Incorporación de propiedades, planta y equipo	(5,477,874)	779,520
Inversiones en sociedades	-	(89,893,958)
Flujo neto originado por (usado en) las actividades de inversión	<u>2,011,835</u>	<u>(81,320,254)</u>
Flujo neto originado por actividades de financiamiento:		
Ingreso (egreso) neto por pasivos financieros	2,912,700,416	(1,738,294,541)
Dividendos pagados	-	(500,000,000)
Flujo neto originado por (usado en) las actividades de financiamiento	<u>2,912,700,416</u>	<u>(2,238,294,541)</u>
Flujo neto total positivo (negativo) del año	29,650,481	(891,613,163)
Efecto de la variación por cambios en la tasa de cambio sobre el efectivo y equivalentes de efectivo	64,311,646	100,141,144
Aumento (disminución) neto en el efectivo	93,962,127	(791,472,019)
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	2,350,058,741	3,141,530,760
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	<u>2,444,020,868</u>	<u>2,350,058,741</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 10:54 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

1. Información corporativa

Naturaleza del negocio y datos generales

ALPHA Sociedad de Valores, S. A. - Puesto de Bolsa - (la Compañía) 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 del Mercado 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 69 empleados al 31 de diciembre de 2019 (2018: 66 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 2019, fueron autorizados para su emisión por la Administración en fecha 14 de mayo de 2020. Estos estados financieros deben ser presentados para su aprobación definitiva a la Asamblea de Accionistas de la Compañía. La Administración espera que sean aprobados sin modificaciones.

2. Bases para la preparación y valuación de los estados financieros

2.1 Base de preparación

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2019, 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).

2.2 Base de valuación

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2019, 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Cambios en políticas contables

Las políticas contables adoptadas por la Compañía para la preparación de sus estados financieros al 31 de diciembre de 2019 son congruentes con aquellas que fueron utilizadas para la preparación de sus estados financieros al 31 de diciembre de 2018, excepto por la aplicación de la NIIF 16 "Arrendamientos", como se indica a continuación.

La Compañía aplicó la NIIF 16 por primera vez a partir del 1ro. de enero de 2019 bajo el método modificado, por lo cual la adopción de NIIF 16 no generó los ajustes de re-expresión de las cifras de los estados financieros al 31 de diciembre y al 1ro. de enero de 2018.

La adopción de dicha norma no tuvo impacto en los estados financieros debido a que los mismos clasifican como arrendamientos con plazos inferiores a 12 meses y de bajo valor. Los cuales se continuarán contabilizando en línea recta sobre la base de la vigencia de los contratos.

Las siguientes enmiendas a las Normas Internacionales de Información Financiera entraron en vigencia a partir del 1ro. de enero de 2019. Estas enmiendas no han causado ningún efecto importante en los estados financieros de la Compañía.

Enmiendas a la NIC 28: Intereses a Largo Plazo en Asociadas y Empresas Conjuntas

Las enmiendas aclaran que una entidad aplica la NIIF 9 a las participaciones a largo plazo en una asociada o empresa conjunta a la que no se aplica el método de la participación pero que, en esencia, forma parte de la inversión neta en la asociada o empresa conjunta (intereses a largo plazo). Esta aclaración es relevante porque implica que el modelo de pérdida de crédito esperado en la NIIF 9 se aplica a dichos intereses a largo plazo.

Las enmiendas también aclararon que, al aplicar la NIIF 9, una entidad no toma en cuenta las pérdidas de la asociada o empresa conjunta, ni las pérdidas por deterioro de la inversión neta, reconocidas como ajustes a la inversión neta en la asociada o empresa conjunta que surjan de la aplicación de la NIC 28 Inversiones en Asociadas y Negocios Conjuntos.

Esta modificación no tuvo impacto en los estados financieros de la Compañía.

Enmiendas a la NIIF 9: Características de Prepago con Compensación Negativa

Conforme a la NIIF 9 Instrumentos Financieros, un instrumento de deuda puede medirse al costo amortizado o a valor razonable en otro resultado integral, siempre que los flujos de efectivo contractuales sean "únicamente pagos del principal e intereses sobre el monto principal adeudado" (el criterio "SPPI" por sus siglas en inglés) y el instrumento sea mantenido dentro del modelo de negocio apropiado para esa clasificación. Las enmiendas a la NIIF 9 aclaran que un activo financiero aprueba el criterio SPPI independientemente del evento o circunstancia que ocasione la rescisión anticipada del contrato sin tener en cuenta qué parte pague o reciba una compensación razonable por la terminación anticipada del contrato.

Esta enmienda no tuvo impacto en los estados financieros ya que no hubo cambios en el modelo de negocios de la Compañía.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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 2019, para convertir los saldos en dólares estadounidenses (USD), Euros (EUR) y guaraníes paraguayos (PYG) a pesos dominicanos fueron las siguientes:

<u>Moneda:</u>	<u>31 de diciembre de</u>	
	<u>2019</u>	<u>2018</u>
USD	52.9601	50.2762
EUR	59.4583	59.9275
PYG	<u>0.000821</u>	<u>0.000840</u>

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 equivalentes 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

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 por 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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.3 Cálculo del valor razonable (continuación)

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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

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 2019 y 2018 es de 27% de la renta neta imponible a esa fecha.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.5 Impuestos (continuación)

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 de los mismos. La tasa del ITBIS al 31 de diciembre de 2019 y 2018 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. La distribución está autorizada cuando ha sido aprobada por la Asamblea de Accionistas.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

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, y 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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

Deterioro de activos financieros (continuación)

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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.11 Pasivos financieros (continuación)

Reconocimiento inicial y valoración (continuación)

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 integrales.

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.

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, se registran al costo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

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, este importe forma parte del 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.

4.16 Arrendamientos

La Compañía evalúa al inicio del contrato si un contrato es, o contiene, un arrendamiento. Es decir, si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una consideración.

Calidad de arrendataria

La Compañía aplica un enfoque único de reconocimiento y medición para todos los arrendamientos, excepto los arrendamientos a corto plazo y los arrendamientos de activos de bajo valor. La Compañía, cuando aplique reconoce los pasivos por arrendamientos para realizar pagos por arrendamiento y activos por derecho de uso que representan el derecho a utilizar los activos subyacentes.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.16 Arrendamientos (arrendamientos)

a) Activos por derecho de uso

La Compañía reconoce los activos por derecho de uso en la fecha de inicio del arrendamiento (es decir, la fecha en que el activo subyacente está disponible para su uso). Los activos por derecho de uso se miden al costo, menos cualquier depreciación acumulada y pérdidas por deterioro, y se ajustan para cualquier nueva medición de los pasivos por arrendamiento. El costo de los activos por derecho de uso incluye el monto de los pasivos por arrendamiento reconocidos, los costos directos iniciales incurridos y los pagos de arrendamiento realizados en la fecha de inicio o antes, menos los descuentos de arrendamiento recibidos. Los activos por derecho de uso se deprecian de forma lineal durante el plazo más corto entre el arrendamiento y la vida útil estimada de los activos.

Si la propiedad del activo arrendado se transfiere a la Compañía al final del plazo del arrendamiento o el costo refleja el ejercicio de una opción de compra, la depreciación se calcula utilizando la vida útil estimada del activo. Los activos por derecho de uso también están sujetos a deterioro.

b) Pasivos por arrendamientos

En la fecha de inicio del arrendamiento, la Compañía reconoce los pasivos por arrendamiento medidos al valor presente de los pagos por arrendamiento que se realizarán durante el plazo del arrendamiento. Los pagos de arrendamiento incluyen pagos fijos (incluidos pagos fijos en sustancia) menos cualquier descuento de arrendamiento por cobrar, pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, y montos que se espera pagar bajo garantías de valor residual. Los pagos de arrendamiento también incluyen el precio de ejercicio de una opción de compra razonablemente segura para ser ejercida por la Compañía y los pagos de multas por rescindir el arrendamiento, si el plazo del arrendamiento refleja que la Compañía ejerce la opción de rescindir. Los pagos de arrendamiento variables que no dependen de un índice o una tasa se reconocen como gastos (a menos que se incurra para producir inventarios) en el período en el que ocurre el evento o condición que desencadena el pago.

Al calcular el valor presente de los pagos de arrendamiento, la Compañía utiliza su tasa de interés incremental en la fecha de inicio del arrendamiento porque la tasa de interés implícita en el arrendamiento no es fácilmente determinable. Después de la fecha de inicio, el monto de los pasivos por arrendamiento se incrementa para reflejar la acumulación de intereses y se reducen mediante los pagos de arrendamiento realizados. Además, el importe en libros de los pasivos por arrendamiento se vuelve a medir si hay una modificación, un cambio en el plazo del arrendamiento, un cambio en los pagos del arrendamiento (por ejemplo, cambios en los pagos futuros que resultan de un cambio en un índice o tasa utilizada para determinar tales pagos de arrendamiento) o un cambio en la evaluación de una opción para comprar el activo subyacente.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.16 Arrendamientos (arrendamientos)

c) Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

La Compañía aplica la exención de reconocimiento de arrendamientos con plazo de arrendamiento de 12 meses o menos desde la fecha de inicio y no contienen una opción de compra. También aplica la exención de reconocimiento de activos de bajo valor a los arrendamientos que se consideran de bajo valor. Los pagos por arrendamientos por arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor se reconocen como gastos de forma lineal durante el plazo del arrendamiento.

4.17 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 efectos más significativos sobre los importes reconocidos en los estados financieros:

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.17. Estimaciones e hipótesis contables significativas (continuación)

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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Cambios futuros en normas contables (continuación)

Enmiendas a la NIIF 3: Definición de un negocio

En octubre de 2018 el IASB publicó enmiendas a la definición de un negocio según la NIIF 3 Combinaciones de Negocios para ayudar a las entidades a determinar si un conjunto de actividades y activos adquiridos es un negocio o no. Tales enmiendas aclaran los requisitos mínimos que constituyen un negocio, eliminan la evaluación de si los participantes del mercado son capaces de reemplazar los elementos faltantes, agregan orientación para ayudar a las entidades a evaluar si un proceso adquirido es sustantivo, y sintetizan las definiciones de un negocio y de los productos capaces de ser generados por un negocio. Asimismo, introducen una prueba opcional de concentración de valor razonable. Se proporcionaron también nuevos ejemplos ilustrativos junto con las enmiendas.

Las enmiendas son efectivas para períodos anuales que comienzan el o después del 1ro. de enero de 2020, y las mismas se aplican prospectivamente a transacciones u otros eventos que ocurran en la fecha en que entran en vigencia. Se permite la adopción anticipada de las enmiendas y la misma debe ser divulgada. La Compañía se encuentra en el proceso de revisión y evaluación del posible impacto sobre los estados financieros.

Enmiendas a la NIC 1 y a la NIC 8: Definición de material

En octubre de 2018 el IASB emitió modificaciones a la NIC 1 Presentación de Estados Financieros y a la NIC 8 Políticas Contables, Cambios en las Estimaciones Contables y Errores para lograr consistencia en la definición de "materialidad" entre las normas y aclarar ciertos aspectos de su definición. La nueva definición establece que "la información es material si su omisión, inexactitud u ocultamiento puede influir razonablemente en las decisiones que toman los usuarios primarios de los estados financieros de propósito general, con base en estos, los cuales proporcionan información financiera sobre una entidad informante específica."

Las enmiendas a la definición de materialidad son efectivas para períodos anuales que comienzan el o después 1ro. de enero de 2020. Se permite la adopción anticipada de las enmiendas y la misma debe ser divulgada. La Compañía se encuentra en el proceso de revisión y evaluación del posible impacto sobre los estados financieros.

Revisiones al Marco Conceptual para la Información Financiera ("el Marco Conceptual")

El Marco Conceptual no es un estándar, y ninguno de sus conceptos está por encima de los de cualquier estándar o los requisitos de un estándar.

El IASB publicó una revisión del Marco Conceptual en marzo de 2018, el cual establece un conjunto integral de conceptos para la información financiera, el establecimiento de normas, la orientación para los preparadores en el desarrollo de políticas contables consistentes y la asistencia a otros en sus esfuerzos por comprender e interpretar las normas. El Marco Conceptual incluye algunos conceptos nuevos, proporciona definiciones actualizadas y criterios de reconocimiento para activos y pasivos, así como una nueva guía sobre medición y baja en cuentas, presentación y revelación.

Los cambios en el Marco Conceptual pueden afectar la aplicación de las NIIF en situaciones en las que no se aplica ningún estándar a una transacción o evento en particular.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Cambios futuros en normas contables (continuación)

Revisiones al Marco Conceptual para la Información Financiera ("el Marco Conceptual") (continuación)

Para los preparadores de estados financieros, el Marco Conceptual revisado entrará en vigencia para los períodos anuales que comienzan el o después del 1ro. de enero de 2020, sin embargo, se permite su adopción anticipada. La Compañía se encuentra en el proceso de revisión y evaluación del posible impacto sobre los estados financieros.

NIIF 9 Instrumentos Financieros - Modelo de negocios

La Compañía evaluará nuevamente su modelo de negocios según NIIF 9 durante el año 2020. Esta evaluación se basará principalmente en la revisión detallada de los métodos utilizados para la clasificación y reconocimiento de los instrumentos financieros con acuerdos de recompras. De conformidad con requerimientos de la Superintendencia del Mercado de Valores de la República Dominicana, a partir del 1ro. de enero de 2020, se deben contabilizar los acuerdos de recompra, bajo la consideración de no dar de baja al activo y reconociendo el pasivo de la operación.

La Compañía se encuentra en el proceso de revisión y análisis del impacto sobre los estados financieros.

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	
	2019	2018
	USD	USD
Efectivo y equivalentes de efectivo	13,237,023	21,105,217
Inversiones en instrumentos financieros:		
A valor razonable con cambios en resultados	85,474,196	30,228,497
A valor razonable instrumentos financieros derivados	107,512	239,625
A costo amortizado	4,557,287	24,607,045
Otras cuentas por cobrar	330,356	126,809
	<u>103,706,374</u>	<u>76,307,193</u>
Pasivos:		
Pasivos financieros a su valor razonable	(12,841,733)	(1,393,541)
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(767,781)	(1,198,964)
Obligaciones con bancos	(15,016,875)	-
Otras cuentas por pagar	(215,675)	(556,003)
	<u>(28,842,064)</u>	<u>(3,148,508)</u>
Posición monetaria neta activa	<u>74,864,310</u>	<u>73,158,685</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Saldos en moneda extranjera (continuación)

	<u>31 de diciembre de</u>	
	<u>2019</u>	<u>2018</u>
	<u>EUR</u>	<u>EUR</u>
Activos:		
Efectivo y equivalentes de efectivo	978	122,895
Posición monetaria neta activa	978	122,895

	<u>31 de diciembre de</u>	
	<u>2019</u>	<u>2018</u>
	<u>PYG</u>	<u>PYG</u>
Activos:		
Efectivo y equivalentes de efectivo	-	146,710
Posición monetaria neta activa	-	146,710

El resumen de los ajustes por revaluación de moneda extranjera durante el año terminado el 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2019</u> <u>PYG</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	35,241,197	3,541	735	35,245,473
Inversiones en instrumentos financieros:				
A valor razonable con cambios en resultados	107,109,155	-	-	107,109,155
A valor razonable instrumentos financieros derivados	(101,805,019)	-	-	(101,805,019)
A costo amortizado	31,066,818	-	-	31,066,818
Otros activos	10,795,998	-	-	10,795,998
Pasivos financieros:				
A costo amortizado	(597,000)	-	-	(597,000)
A valor razonable	(17,503,779)	-	-	(17,503,779)
	64,307,370	3,541	735	64,311,646

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2018</u> <u>PYG</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)
	99,430,662	701,788	8,694	100,141,144

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

7. Efectivo y equivalentes de efectivo

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

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Efectivo en caja	30,000	30,000
Efectivo en bancos (a)		
Cuentas de ahorros:		
Denominadas en monedas extranjeras	221,177,380	1,067,101,130
Cuentas corrientes:		
Denominadas en pesos dominicanos	1,652,732,819	351,790,544
Denominadas en monedas extranjeras	456,183	1,354,985
Equivalentes de efectivo:		
Denominadas en pesos dominicanos (b)	90,165,833	929,782,082
Denominadas en monedas extranjeras (c)	479,458,653	-
	<u>2,444,020,868</u>	<u>2,350,058,741</u>

(a) Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 2019, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP27,543,411 (2018: DOP42,670,373), los cuales se incluyen como parte de los ingresos financieros en los estados de resultados integrales que se acompañan.

(b) Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, corresponden a certificados de depósitos en pesos dominicanos los cuales devengan tasas de interés anual que oscilan entre 6% y 9.5% (2018: entre 4.4% y 10.75%).

(c) Al 31 de diciembre de 2019, corresponden a certificados de depósitos en dólares estadounidenses los cuales devengan tasas de interés anual de 2.55%.

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 2019, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP18,327,331 (2018: DOP52,823,358), los cuales se incluyen como parte de los ingresos financieros en los estados de resultados integrales que se acompañan.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no existen diferencias entre el valor registrado y el valor razonable de estos activos financieros.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no existen 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 2019 y 2018

(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>2019</u>	<u>2018</u>
Títulos / valores de deuda (a):		
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	4,405,075,732	1,742,871,855
Banco Central de República Dominicana	213,902,751	932,723,271
Asociación La Nacional de Ahorros y Préstamos	29,606,302	-
Asociación Cibao de Ahorros y Préstamos	499,032,975	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	249,780,338	35,282,582
Banco de Ahorro y Crédito Confisa, S. A.	-	100,690
Consorcio Energético Punta Cana Macao, S. A.	-	48,452,320
Consorcio Remix, S. A.	-	4,581,432
Consorcio Minero Dominicano, S. A.	41,351,760	147,835,256
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	71,714,752	233,953,388
Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte, S. A. (EDENORTE Dominicana, S. A.)	1,536,096,551	-
Empresa Distribuidora de Electricidad del Sur, S. A. (EDESUR Dominicana, S. A.)	74,066,359	-
Empresa Generadora de Electricidad Haina S. A.	15,835,519	20,045,290
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	402,372	-
Fideicomiso RD Vial	-	51,796,904
Petroleum Company of Trinidad and Tobago Limited	40,303,266	130,539,358
Avianca Holding	362,163,967	-
Gulfstream Petroleum Dominicana	171,702,189	-
Bonos Soberanos de Costa Rica	-	85,205,271
	<u>7,711,034,833</u>	<u>3,433,387,617</u>
Aportes en fondos y fideicomisos de inversión (b):		
Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 Días Dólar	1,701,418	1,576,497
AFI Universal - Fondo Abierto Depósito Financiero Flexible	4,103,888	3,813,460
BHD Liquidez - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	525,674	494,097
Fondo Mutuo Renta Fija BHD Plazo 30 Días	474,812	441,907
Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	207,790	195,981
Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	-	5,936,270
JMMB Fondo de Inversión Cerrado Inmobiliario	20,881,365	6,720,877
JMMB Fondo de Inversión Money Market	24,471	21,424
JMMB Fondo Mutuo Plazo 90 días	36,722	33,989
PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	21,610,044	20,444,934
PIONEER-UNITED Fondo Cerrado Nacional Renta Fija	1,030,220	972,160
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Liquidez	271,065	256,718
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual dólar	8,907,476	53,211,673
Fondo de Inversión Cerrado Libre para el Desarrollo de Infraestructuras Dominicanas	73,058,361	-
Fideicomiso De Oferta Publica De Valores Inmobiliarios FPM No 02 FP	6,391,257	-
Fideicomiso De Oferta Pública De Valores Fiduciarios G Patio 01 Fu	26,605,610	-
Fondo Cerrado De Desarrollo De Sociedades Popular	25,039,225	-
GAM - Fondo Cerrado GAM Energía	33,400,353	-
Fideicomiso De Oferta Pública De Valores Accionarios Rica 03	221,535	-
GAM - Fondo de Inversión Cerrado de Renta Fija	167,546,585	143,011,733
	<u>392,037,871</u>	<u>237,131,720</u>
Inversiones en acciones(d):		
ProShares SQQQ	224,018	631,972
	<u>224,018</u>	<u>631,972</u>
	<u>8,103,296,722</u>	<u>3,671,151,309</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

- (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 2020 y 2048. Estas inversiones de títulos / valores se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado.

Al 31 de diciembre de 2019, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP118,783,877 (2018: DOP96,035,333), 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.

Al 31 de diciembre de 2019, la Compañía posee inversiones de títulos / valores de renta fija emitidas por el Ministerio de Hacienda de República Dominicana y el Banco Central de la República Dominicana, las cuales garantizan deudas a corto plazo de la Compañía con entidades financieras nacionales por un importe aproximado de DOP3,001,000,000 (nota 16).

- (b) Corresponden a las inversiones realizadas por la Compañía mediante aportes en fondos y fideicomisos de inversión en la República Dominicana que invierten su capital en búsqueda de rentabilidad, los recursos aportados a los fondos y fideicomisos de inversión en la República Dominicana se encuentran en distintas clases de activos (monedas, instrumentos de renta fija, acciones, bienes inmobiliarios, instrumentos patrimoniales, entre otros). El valor total de un fondo y fideicomisos 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 y del fideicomiso, o cuando la cuota se traspasa de un inversionista a otro. El valor de mercado de cada fondo y fideicomisos 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 2019, publicados por la Superintendencia del Mercado de Valores de la República Dominicana:

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
A- hasta A+	5,959,502,899	3,335,617,319
BBB- hasta BBB+	130,939,662	31,847,933
Menor que BBB-	402,467,233	165,821,940
Calificaciones de riesgo no disponible a la fecha	<u>1,610,386,928</u>	<u>137,864,117</u>
	<u>8,103,296,722</u>	<u>3,671,151,309</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

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.

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

	2019			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	7,711,034,833	2,278,648,372	5,432,386,461	-
Aportes en fondos y fideicomisos de inversión	392,037,871	392,037,871	-	-
Inversiones en acciones	224,018	224,018	-	-
	<u>8,103,296,722</u>	<u>2,670,910,261</u>	<u>5,432,386,461</u>	<u>-</u>
	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>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, la Compañía producto de las ventas, rendimientos y valoraciones de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, produjeron ganancias netas por un importe ascendente a DOP2,178,388,818 (2018: DOP2,082,958,609), las cuales se incluyen dentro de los 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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	
	2019	2018
Activo:		
A valor razonable - instrumentos financieros derivados (a)	21,672,355	60,219,789
Pasivo:		
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados (b)	(234,776,490)	(141,111,748)

- (a) A continuación, se presenta el resumen 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	
	2019	2018
Personas físicas	9,122,973	24,110,039
Personas jurídicas	10,252,856	16,264,004
Intermediarios de valores	959,343	9,642,920
Inversionista institucional	282,907	1,762,667
Partes relacionadas	152,776	547,159
Instituciones financieras	901,500	7,893,000
	21,672,355	60,219,789

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:

	2019			
	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	20,377,283	-	20,377,283	-
Banco Central de República Dominicana	391,706	-	391,706	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	901,500	-	901,500	-
Gulfstream Petroleum Dominicana S. de R.L.	1,866	-	1,866	-
	21,672,355	-	21,672,355	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Instrumentos financieros derivados	2018			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
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	-
Consortio 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>

- (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	
	2019	2018
Personas físicas	(98,106,734)	(38,511,964)
Personas jurídicas	(120,090,104)	(45,779,591)
Intermediarios de valores	(4,876,956)	(7,844,727)
Inversionista institucional	(2,031,652)	(21,052,580)
Partes relacionadas	(264,790)	(15,637,590)
Instituciones financieras	(9,406,254)	(12,285,296)
	<u>(234,776,490)</u>	<u>(141,111,748)</u>

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:

Instrumentos financieros derivados	2019			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(224,362,255)	-	(224,362,255)	-
Banco Central de República Dominicana	(6,581,242)	-	(6,581,242)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(264,790)	-	(264,790)	-
Dominican Power Partners, LDC (DPP)	(3,551,774)	-	(3,551,774)	-
Gulfstream Petroleum Dominicana S. de R.L.	(16,429)	-	(16,429)	-
	<u>(234,776,490)</u>	<u>-</u>	<u>(234,776,490)</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, la Compañía producto de las valoraciones de los instrumentos financieros a su valor razonable derivados, produjeron pérdidas netas por un importe ascendente a DOP1,321,047,110 (2018: DOP2,084,642,727), 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 2019 y 2018

(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 2019 y 2018, la Compañía mantiene las siguientes transacciones de contratos de títulos valores la cantidad en forwards de títulos de valores:

Al 31 de diciembre del 2019													
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		
FWD													
Títulos DOP	1,327	7,618,201,556	(183,596,629)	268,528,722	4,558,921	-	13,144,149	1,932,868	-	(190,389,310)	(3,725,416)	15,077,017	(194,114,726)
Títulos USD	243	866,292,241	(11,228,904)	80,287,512	(178,639)	-	3,839,123	286,408	-	(13,412,617)	(1,218,957)	4,125,531	(14,631,574)
FWD Divisas													
Títulos DOP	205	35,100,000	167,890	2,416,990,000	(23,728,275)	-	2,469,807	-	(154,263)	(17,819,375)	(8,056,552)	2,469,807	(26,030,190)
Total	1.775	8.519.593.797	(194.657.643)	2.765.806.234	(19.347.994)	-	19.453.079	2.219.276	(154.263)	(221.621.303)	(13.000.925)	21.672.355	(234.776.490)

AI 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		
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)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Los contratos derivados financieros emitidos por la Compañía, fueron:

	2019		2018	
	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP
Forward	<u>(213,104,135)</u>	<u>(213,104,135)</u>	<u>(80,891,957)</u>	<u>(80,891,957)</u>

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

	2019		2018	
	USD	DOP	USD	DOP
Forward	<u>(34,967,928)</u>	<u>(178,136,208)</u>	<u>(48,231,942)</u>	<u>(32,660,015)</u>

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

	2019			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	<u>(8,497,959)</u>	<u>-</u>	<u>(33,872,048)</u>	<u>(170,734,130)</u>

	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>

Las condiciones pactadas para estos contratos, son como sigue:

	2019				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	<u>(31,535,623)</u>	<u>(76,387,581)</u>	<u>(104,470,945)</u>	<u>(709,987)</u>	<u>-</u>

	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>

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

	2019				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	<u>(107,456,080)</u>	<u>(55,767,429)</u>	<u>(49,290,207)</u>	<u>(590,422)</u>	<u>-</u>

	2018				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	<u>(25,490,528)</u>	<u>(37,300,914)</u>	<u>(18,100,515)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

10. Inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado

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

	<u>Al 31 de diciembre</u>	
	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Al 31 de diciembre de 2019, corresponde a certificado de depósito mantenido con una institución financiera local, cuyo vencimiento es mayor a tres meses a la fecha de adquisición, el cual devenga interés a una tasa anual de 4.02%.	887,683,006	-
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 transfirió la totalidad del crédito por un importe original de US\$16,914,217 equivalente a DOP850,382,575, este contrato devengaba 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. Este crédito fue cobrado en su totalidad durante el año 2019.	-	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 transfirió la totalidad del crédito por un importe original de US\$6,928,389 equivalente a DOP348,333,052, este contrato devengaba 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. Este crédito fue cobrado en su totalidad durante el año 2019.	-	357,876,423
En fecha 29 de julio de 2019, la Compañía firmó un contrato con la entidad relacionada Alpha Wealth Solutions, S. A. S., donde le realiza un préstamo por un importe original de DOP30,000,000, este contrato devenga interés de 10% anual, con vencimiento en julio de 2020, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2019, incluye intereses por cobrar por un importe de DOP8,333.	30,008,333	-
En fecha 28 de noviembre de 2019, la Compañía firmó un contrato con la entidad relacionada Milenio Acquisition, S. A., donde le realiza un préstamo por un importe original de DOP18,000,000, este contrato devenga interés de 9.8% anual, con vencimiento en noviembre de 2020, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2019, incluye intereses por cobrar por un importe de DOP4,900.	18,004,900	-
En fechas 12 de abril de 2019 y 1ro. de agosto de 2019, la Compañía firmó dos contratos con la entidad relacionada Mercado Electronico Dominicano, S. A., donde le realiza préstamos por un importe original de USD1,856,591 y USD2,700,000 equivalentes a DOP241,317,515, estos contrato devengan interés de 5.5% anual, con vencimiento en abril y agosto de 2020, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2019, incluyen intereses por cobrar por un importe de USD696 equivalentes a DOP36,868.	241,354,384 1,177,050,623	- 1,237,148,708

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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:

	31 de diciembre de	
	2019	2018
2019	-	1,237,148,708
2020	1,177,050,623	-
	1,177,050,623	1,237,148,708

Al 31 de diciembre de 2019, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP149,215 (2018: US\$764,439 equivalente a DOP38,433,081), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado en el estado de situación financiera que se acompaña.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2019, la Compañía reconoció ingresos por intereses por concepto de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado por un importe aproximado de DOP114 millones (2018: DOP86.4 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:

	Al 31 de diciembre	
	2019	2018
Interés por cobrar (a)	40,028,783	29,365,091
Cuentas por cobrar empleados	3,391,128	603,981
Anticipos a proveedores (b)	15,452,375	871,836
Cuentas por cobrar a parte relacionada	19,950	1,032
Otras	4,814,802	120,424
	63,707,038	30,962,364

(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.

(b) Corresponde principalmente a anticipos realizados para el cambio de los sistemas informáticos de la Compañía.

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

Con Atrasos sin Deterioro					
Año	Sin atraso ni deterioro	De 1 día y menos de 45 días	De 45 días y menos de 60 días	Más de 60 días	Total
2019	61,901,367	-	-	1,805,671	63,707,038
2018	29,404,591	1,555,773	-	2,000	30,962,364

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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:

	Al 31 de diciembre		Porcentaje	Porcentaje
	<u>2019</u>	<u>2018</u>	<u>2019</u>	<u>2018</u>
CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A. (a)	89,895,157	89,895,157	3.4471%	3.4471%
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>118,279,510</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 del Mercado de Valores de la República Dominicana, de conformidad con las Resoluciones No. 01 y 04, emitidas por la Superintendencia del Mercado 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 en esta sociedad, durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Saldo al inicio del año	89,895,157	1,200
Adiciones (i)	-	89,893,957
Saldo al final del año	<u>89,895,157</u>	<u>89,895,157</u>

- (i) Al 31 de diciembre de 2018, corresponde a la adquisición de 18,179 acciones dentro del capital suscrito y pagado de la sociedad CEVALDOM a razón de US\$100.94 equivalentes a DOP4,945 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 2019, los ingresos generados por estas inversiones ascendieron a DOP7,489,709 (2018: DOP7,794,184), 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 2019 y 2018

(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
<u>Costo de adquisición:</u>			
Al 1ro. de enero de 2018	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
Adiciones	3,764,296	-	3,764,296
Retiros	(5,683,395)	-	(5,683,395)
Al 31 de diciembre de 2019	8,435,203	2,180,895	10,616,098
<u>Depreciación acumulada:</u>			
Al 1ro. de enero de 2018	(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)
Gasto de depreciación	(3,104,790)	(400,770)	(3,505,560)
Retiros	5,614,965	-	5,614,965
Al 31 de diciembre de 2019	(4,671,405)	(748,083)	(5,419,488)
<u>Valor en libros:</u>			
Al 31 de diciembre de 2019	<u>3,763,798</u>	<u>1,432,812</u>	<u>5,196,610</u>
Al 31 de diciembre de 2018	<u>3,172,722</u>	<u>1,833,582</u>	<u>5,006,304</u>

Al 31 de diciembre 2019, la Compañía mantiene activos en uso totalmente depreciados con un costo de adquisición aproximado de DOP336,000 (2018: DOP6,503,000).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2018	11,106,609	9,090,993	20,197,602
Adiciones	-	2,320,027	2,320,027
Retiros	(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
Adiciones	1,722,486	3,827,196	5,549,682
Retiros	(10,338,288)	(7,354,114)	(17,692,402)
Al 31 de diciembre de 2019	2,757,896	6,685,077	9,442,973
Amortización acumulada:			
Al 1ro. de enero de 2018	(6,129,379)	(6,189,881)	(12,319,260)
Gasto de amortización	(2,274,740)	(1,901,395)	(4,176,135)
Retiros	-	772,249	772,249
Reclasificación	(379,213)	-	(379,213)
Al 31 de diciembre de 2018	(8,783,332)	(7,319,027)	(16,102,359)
Gasto de amortización	(2,301,857)	(3,068,729)	(5,370,586)
Retiros	10,338,288	7,103,525	17,441,813
Al 31 de diciembre de 2019	(746,901)	(3,284,231)	(4,031,132)
Valor en libros:			
Al 31 de diciembre de 2019	<u>2,010,995</u>	<u>3,400,846</u>	<u>5,411,841</u>
Al 31 de diciembre de 2018	<u>2,590,366</u>	<u>2,892,967</u>	<u>5,483,334</u>

Al 31 de diciembre de 2019, la Compañía mantiene programas de cómputo en uso totalmente amortizados con un costo de adquisición de aproximadamente DOP204,000 (2018: DOP570,000).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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:

	2019			
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Valor razonable
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	95,820,113	-	95,820,113
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	4,935,409,808	-	4,935,409,808
Gulfstream Petroleum Dominicana	-	451,224	-	451,224
	-	5,031,681,145	-	5,031,681,145
	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

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

	2019				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	2,130,211,184	1,066,114,550	1,835,355,411	-	5,031,681,145
	2,130,211,184	1,066,114,550	1,835,355,411	-	5,031,681,145
	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
	2,167,428,405	376,378,566	1,599,468,262	-	4,143,275,233

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, la Compañía producto los rendimientos y valoraciones de los pasivos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, produjeron ganancias netas por un importe ascendente a DOP79,008,889 (2018: DOP562,050,438), las cuales se incluyen dentro resultados integrales 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

16. Obligaciones con bancos

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

	2019	2018
<u>Banco Popular Dominicano, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 19 de noviembre de 2019, por un importe original de DOP900,000,000, el cual causa una tasa de interés de 10% anual, con vencimiento en el mes de enero del año 2020. Este préstamo esta garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8).	904,250,000	-
<u>Asociación Cibao de Ahorros y préstamos, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 29 de noviembre de 2019, por un importe original de DOP400,000,000, el cual causa una tasa de interés de 9.5% anual, con vencimiento en el mes de noviembre del año 2020. Este préstamo esta garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano (nota 8).	400,105,556	-
<u>Banco del Reservas de la República Dominicana</u>		
Préstamo adquirido en fecha 16 de octubre de 2019, por un importe original de DOP428,000,000, el cual causa una tasa de interés de 9.8% anual, con vencimiento en el mes de enero del año 2020. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8).	428,699,067	-
Préstamo adquirido en fecha 13 de diciembre de 2019, por un importe original de DOP472,000,000, el cual causa una tasa de interés de 9.8% anual, con vencimiento en el mes de febrero del año 2020. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 8).	472,770,933	-
<u>CitiBank</u>		
Préstamo adquirido en fecha 23 de diciembre de 2019, por un importe original de USD15,000,000 equivalente a DOP794,401,500, el cual causa una tasa de interés de 4.5% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2020. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano (nota 8).	795,295,201	-
	3,001,120,757	-

Al 31 de diciembre de 2019, el saldo pendiente de intereses por pagar asciende a DOP6,719,257, los cuales se incluyen como parte de este rubro, obligaciones con bancos, en los estados de situación financiera que se acompañan.

Al 31 diciembre de 2019, las obligaciones con bancos están garantizadas por 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).

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, la Compañía reconoció gastos de intereses por concepto de obligaciones con bancos por DOP123,319,250 (2018: DOP22,663,555), y se incluyen dentro de los gastos por financiamiento 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

17. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos

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

	31 de diciembre de	
	2019	2018
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo		
Bonos locales	1,226,068,492	1,288,420,342
Menos: porción corriente de bonos locales (a)	(226,068,492)	(688,420,342)
	<u>1,000,000,000</u>	<u>600,000,000</u>
	<u>1,226,068,492</u>	<u>1,288,420,342</u>

(a) Corresponde a la porción corriente de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo, las cuales incluyen los intereses por pagar al 31 de diciembre de 2019 y 2018.

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 2019, la Compañía mantiene colocado de esta emisión un importe de DOP1,000,000,000 (2018: DOP400,000,000). Los títulos devengan una tasa de interés 9% y 9.7% anual, pagaderos de manera trimestral y semestral con vencimiento 2021 y 2023.

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 del Mercado de Valores de la República Dominicana. Cada tramo es un importe de DOP200,000,000 para un total de DOP1,000,000,000.

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Tercera Resolución de fecha 25 de abril de 2017, 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 2019, la Compañía mantiene colocado un importe de DOP200,000,000 (2018: 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 del Mercado de Valores de la República Dominicana. Cada tramo es 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

17. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (continuación)

Bonos locales (continuación)

2019					
Tramos	Monto	Tasa Anual	Fecha de Emisión	Vencimiento	Calendario de Repago
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
2	200,000,000	9.5%	28/06/2018	28/06/2023	Pago al vencimiento
3	200,000,000	9.6%	25/04/2019	25/04/2021	Pago al vencimiento
4	200,000,000	9.8%	25/04/2019	25/11/2021	Pago al vencimiento
5	200,000,000	9.7%	25/04/2019	25/08/2021	Pago al vencimiento
	1,200,000,000				

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
2	200,000,000	9.5%	28/06/2018	28/06/2023	Pago al vencimiento
	1,275,000,000				

Al 31 de diciembre de 2019, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP26,068,492 (2018: DOP13,420,342), 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	
	2019	2018
Saldo al inicio del año	1,275,000,000	875,000,000
Bonos locales emitidos en el año	600,000,000	400,000,000
Bonos locales pagados en el año	(675,000,000)	-
Saldo al final del año	1,200,000,000	1,275,000,000

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, la Compañía reconoció gastos de intereses por obligaciones por instrumentos financieros emitidos DOP117,593,282 (2018: DOP101,786,074), los cuales se incluyen dentro de los gastos por financiamiento 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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.

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

		Al 31 de diciembre	
		2019	2018
Saldos:	Vínculo		
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	402,262	-
GAM - Fondo Cerrado GAM Energía	Relacionada	33,400,353	-
GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	Relacionada	167,546,585	143,011,733
		<u>201,349,200</u>	<u>143,011,733</u>
Pasivos financieros a su valor razonable:			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	-	(53,974,891)
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	145,978	-
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	-	547,159
		<u>145,978</u>	<u>547,159</u>
Pasivos a su valor razonable instrumentos financieros derivados:			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	(264,790)	(15,637,590)
Inversiones en instrumentos a su costo amortizado			
Alpha Wealth Solutions, S. A. S.	Relacionada	30,008,333	-
Milenio Acquisition, S. A.	Relacionada	18,004,900	-
Mercado Electrónico Dominicano, S. A.	Relacionada	241,354,387	-
		<u>289,367,617</u>	<u>-</u>
Cuentas por pagar a relacionadas:			
Mercado Electrónico Dominicano, S. A.	Relacionada	-	(1,437,835)
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	-	(177,259)
		<u>-</u>	<u>(1,615,094)</u>
Transacciones:			
Resultado por instrumentos financieros			
A valor razonable (Operaciones de ventas)	Relacionadas	316,982,793	503,943,337
A costo amortizado	Relacionada	13,074,951	-
		<u>330,057,744</u>	<u>503,943,337</u>
Gastos de administración y comercialización:			
Arrendamientos (nota 23)	Relacionada	(8,879,890)	(6,862,555)
Servicios generales, planificación, estrategia y soporte de tecnología (nota 23)	Relacionada	(21,973,260)	(26,965,045)
		<u>(30,853,150)</u>	<u>(33,827,600)</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

		Al 31 de diciembre	
		2019	2018
Dividendos (nota 21):	Accionistas		
Dividendos pagados		-	450,000,000
Retenciones		-	50,000,000
Total		-	500,000,000

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 2019 y 2018, no se reconoció deterioro relacionado con algunos de estos saldos.

Compensaciones al personal clave

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2019, las compensaciones al personal clave ascienden a aproximadamente DOP73.6 millones (2018: DOP66.4 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	
		2019	2018
Retenciones por pagar		6,138,494	3,588,551
Bonificación por pagar		13,099,243	12,315,782
Incentivo al personal por pagar		55,538,477	56,733,671
AFP Por pagar		-	162,684
SFS Por pagar		-	152,618
Anticipo de impuesto por pagar		-	120,088
		74,776,214	73,073,394

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 2019 y 2018 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Impuesto sobre la renta (continuación)

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.

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:

	<u>31 de diciembre</u> <u>2019</u>	<u>2018</u>
Impuesto sobre la renta:		
Activo	(51,877)	(50,063)
Diferido	(35,988,543)	10,379,670
	<u>(36,040,420)</u>	<u>10,329,607</u>

El impuesto sobre la renta del año terminado el 31 de diciembre de 2019 y 2018 se determinó sobre la base del 1% de los activos gravables como resultado que dicho importe que fue mayor al determinado sobre la base de la renta neta imponible.

Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018, la determinación del impuesto sobre el 1% de los activos se detalla a continuación:

	<u>Al 31 de diciembre de</u> <u>2019</u>	<u>2018</u>
Total activos	12,008,622,079	7,581,084,610
Activos no gravables	(12,003,434,332)	(7,576,078,306)
Total activos gravables	5,187,747	5,006,304
Tasa de impuesto sobre los activos	1%	1%
Impuesto sobre los activos	<u>51,877</u>	<u>50,063</u>

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

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Utilidad antes de impuesto sobre la renta	559,208,230	405,645,009
Diferencias permanentes (a)	(615,276,077)	(480,185,364)
Diferencias temporales (b)	10,389,645	8,609,258
Pérdida fiscal	<u>(45,678,202)</u>	<u>(65,931,097)</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018, así como el movimiento del mismo durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	Estado de Situación Financiera		Estado de Resultados	
	2019	2018	2019	2018
Impuesto sobre la renta diferido:				
Diferencia cambiaria	(1,171,749)	(1,530,497)	358,748	314,499
Otras provisiones	2,011,248	(245,348)	2,256,596	(6,198,343)
Pérdidas trasladables	14,996,311	29,115,986	(14,119,675)	13,994,151
Pérdida no realizada	(15,835,810)	8,648,402	(24,484,212)	2,269,363
Total	-	35,988,543	(35,988,543)	10,379,670

Al 31 de diciembre de 2019, una proporción del impuesto sobre la renta diferido activo generado por pérdidas trasladables ascendente a DOP19,001,410 no fue registrado por considerarse que la recuperación del mismo es incierta.

A continuación, se presenta la conciliación entre la tasa de impuesto efectiva y la tasa de impuesto oficial al 31 de diciembre de 2019 y 2018:

	2019	2018
Tasa oficial	27%	27%
Ingresos exentos Ministerio de Hacienda	(29.71%)	(31.96%)
Ganancia/pérdida no realizada	(2.83%)	2.13%
Otras partidas	11.98%	5.38%
Tasa impuesto-efectiva	6.44%	2.55%

El movimiento de los anticipos de impuesto sobre la renta para el año terminado al 31 de diciembre de 2019 y 2018, es como sigue:

	2019	2018
Saldo a favor:		
Anticipos de impuesto sobre la renta al inicio del año	65,692,596	63,921,030
Anticipos de impuesto sobre la renta pagados durante el año	3,186,756	1,821,629
Gasto de impuesto sobre la renta corriente compensado del año	(51,877)	(50,063)
Anticipos de impuesto sobre la renta al final de año	68,827,475	65,692,596

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Impuesto sobre la renta (continuación)

Al 31 de diciembre de 2019, la Compañía dispone de pérdidas trasladables las cuales pueden ser compensadas como sigue:

<u>Años a</u> <u>Compensar</u>	<u>Importe</u>
2020	40,545,145
2021	30,695,263
2022	22,781,971
2023	22,781,971
2024	9,113,136
	<u>125,917,486</u>

21. Patrimonio

Capital social suscrito y pagado

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018 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 2019 y 2018 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.

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018 el capital social suscrito y pagado esta poseído de la siguiente manera:

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

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 2019 y 2018, la reserva de capital es equivalente a dicho porcentaje.

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. El dividendo pagado por acción fue de RD\$55.55.

Utilidad por acción

La utilidad por acción de la Compañía del año 2019, asciende a DOP58.13 (2018: DOP46.22).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

21. Patrimonio (continuación)

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 del Mercado de Valores de la República Dominicana (SIMVRD) 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 2019 y 2018, 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			
	<u>2019</u>		<u>2018</u>	
	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>
Índice de patrimonio y garantías de riesgo	0.9530	0.155	0.4883	0.155
Índice de patrimonio y garantías de riesgo (Nivel 1)	0.9530	0.103	0.4846	0.103

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019									
	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	-	-	1,544,135,591	(3,049,646,524)	3,706,291,027	(108,649,373)	624,431,548	(459,164,562)	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	1,768,264,647	(3,089,311,757)	-	-	-	-	-	-
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	114,060,169	-
Ingresos por Custodia de Valores	-	(13,450,655)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ingresos (gastos) por Servicios	5,198,639	(26,205,210)	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(10,571,827)	-	-	-	-	-	-	-	-
Total	5,198,639	(50,227,692)	3,312,400,238	(6,138,958,281)	3,706,291,027	(108,649,373)	624,431,548	(459,164,562)	114,060,169	-

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	-
Gastos 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	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Gastos de administración y comercialización

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019 y 2018, la composición de los gastos de administración y comercialización, es como sigue:

	Al 31 de diciembre de	
	2019	2018
<i>Compensación al personal:</i>		
Sueldos al personal	73,492,412	63,452,268
Beneficio al personal	81,073,737	99,776,234
Aportes al plan de pensiones	5,141,996	4,482,018
Otras compensaciones al personal	10,950,230	8,445,466
	<u>170,658,375</u>	<u>176,155,986</u>
<i>Gastos operativos:</i>		
Viajes		
Promoción y publicidad	1,746,854	1,403,125
Otros gastos operativos	45,831,904	40,601,986
	<u>13,023,742</u>	<u>3,556,678</u>
	<u>60,602,500</u>	<u>45,561,789</u>
<i>Otros gastos de administración:</i>		
Servicios de relacionadas (nota 18)	21,973,260	26,965,045
Servicios de proveedores locales	29,705,089	16,586,464
Arrendamientos (nota 18 y 24)	8,879,890	6,862,555
Asesoría legal	2,404,493	2,963,372
Gastos de depreciación	3,505,560	3,362,218
Gastos de amortización	5,370,586	4,176,135
Cuotas comisiones y pagadas	6,745,026	6,358,505
Gastos de comunicaciones	40,382	36,797
Seguro	112,958	116,505
Mantenimiento y reparaciones	703,808	356,735
Otros gastos de administración	13,633,032	10,997,323
	<u>93,074,084</u>	<u>78,781,654</u>
	<u>324,334,959</u>	<u>300,499,429</u>

24. Contingencias y compromisos

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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	
	2019	2018
Contingentes		
Derechos por Contratos de Compra Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD)	9,364,508,459	8,232,515,996
Derechos por Contratos de Compra Forward de TVD con un tenor al vencimiento mayor a 365 días	2,422,939	569,917,410
Derechos por Contratos de Venta Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD)	383,482,919	
Derechos por Contratos de Compra de Divisas Implícitos	42,362,285	14,997,648
Derechos por Contratos de Venta de Divisas Implícito	2,665,682,717	1,775,088,969
Derechos por Contratos de Compra Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	180,006,373	-
Derechos por Compra Spot de Divisas	31,720,800	-
Derechos por Contratos de Compra Futuros de TVD	-	91,967,739
Derechos por Contratos de Venta Futuros de TVD	-	286,570,569
	<u>12,670,186,492</u>	<u>10,971,058,331</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

24. Contingencias y compromisos (continuación)

Encargos de confianza

Al 31 de diciembre de 2019, la Compañía refleja a valor nominal, un saldo de DOP18,481,960,327 (2018: DOP18,021,128,900) 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 DOP4,888,401,500 (2018: DOP3,918,143,000) 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 2019, la Compañía posee balance de inversiones restringidas puestas en garantías por un importe de DOP2,553,022,718. Al 31 de diciembre de 2019, la Compañía está utilizando estas líneas de crédito por un importe de DOP2,994,401,500 y posee un balance disponible de DOP1,894,000,000.

Contrato de alquiler

La Compañía mantiene un contrato de arrendamiento operativo con la relacionada Mercado Electrónico Dominicano, S. A., como arrendatario, sobre local en el que opera su oficina, 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 2019, la renta mensual es de DOP732,790 (2018: DOP729,891). Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2019, el gasto por este concepto ascendió a DOP8,879,890 (2018: DOP6,862,555) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

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 2019, los gastos por este concepto ascendieron a DOP1,140,000 (2018: DOP1,548,010), 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 2019 y 2018

(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 (2018: DOP62,000) por concepto de cuota de membresía. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018 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 integrales 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 2019, los gastos por este concepto ascendieron a DOP13,450,655 (2018: DOP10,846,715), los cuales se incluyen en el rubro de gastos y comisiones por servicios en los estados de resultados integrales que se acompañan.

La Compañía tiene el compromiso de pagar a la Superintendencia del Mercado 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-2017-41-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, planificación, estrategia y soporte de tecnología. Al 31 de diciembre de 2019, el importe a pagar mensual es de DOP1,770,274 (2018: DOP1,997,482). Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2019, el gasto por este concepto ascendió a DOP21,973,260 (2018: DOP26,965,045) 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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo crédito (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 2019, la Compañía mantiene inversiones en instrumentos financieros, invertidos en títulos y valores de deuda, fondos y fideicomisos 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 y fideicomisos 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 y guaraníes:

	Variación en el Tipo de Cambio USD	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2019	+5%	198,632,387
	-5%	(198,632,387)
31 de diciembre de 2018	+5%	183,907,034
	-5%	(183,907,034)
	Variación en el Tipo de Cambio EUR	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2019	+5%	2,909
	-5%	(2,909)
31 de diciembre de 2018	+5%	368,239
	-5%	(368,239)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019	+5%	-
	-5%	-
31 de diciembre de 2018	+5%	62
	-5%	(62)

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.

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:

	2019					
	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	-	2,130,211,184	2,901,469,961	-	-	5,031,681,145
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	96,896,636	137,879,854	-	-	234,776,490
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	28,405,479	271,901,370	1,093,093,151	-	1,393,400,000
Obligaciones con bancos	-	1,808,852,250	1,238,003,333	-	-	3,046,855,583
Otras cuentas por pagar	15,014,991	-	-	-	-	15,014,991
Acumulaciones y otras obligaciones	-	74,776,214	-	-	-	74,776,214
	<u>15,014,991</u>	<u>4,139,141,763</u>	<u>4,549,254,518</u>	<u>1,093,093,151</u>	<u>-</u>	<u>9,796,504,423</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo de liquidez (continuación)

	2018					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	-	2,167,428,405	1,975,846,828	-	-	4,143,275,233
Instrumentos financieros a 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>

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	
	2019	2018
+0.12	(28,909,504)	(14,933,956)
-0.12	<u>28,909,504</u>	<u>14,933,956</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018.

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 e instrumentos financieros emitidos y el efectivo y equivalentes de efectivo) entre la sumatoria del pasivo neto y el patrimonio.

	31 de diciembre de	
	2019	2018
Pasivos financieros a valor razonable	5,031,681,145	4,143,275,233
Instrumentos financieros derivados	234,776,490	141,111,748
Obligaciones con bancos y obligaciones por instrumentos financieros emitidos	4,227,189,249	1,288,420,342
Otras cuentas por pagar	15,014,991	31,572,619
Cuentas por pagar a relacionadas	-	1,615,094
Acumulaciones y otras obligaciones	74,776,214	73,073,394
Menos - Efectivo en caja y bancos	(2,444,020,868)	(2,350,058,741)
Pasivo neto	7,139,417,221	3,329,009,689
Patrimonio	2,425,183,990	1,902,016,180
Capital neto	9,564,601,211	5,231,025,869
	0.75	0.64

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 2019		31 de diciembre de 2018	
	Valor en libros	Valor razonable	Valor en Libros	Valor razonable
Pasivos financieros				
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	(1,226,068,492)	(1,151,313,570)	(1,288,420,342)	(1,299,397,444)
	<u>(1,226,068,492)</u>	<u>(1,151,313,570)</u>	<u>(1,288,420,342)</u>	<u>(1,299,397,444)</u>

Durante los años terminados al 31 de diciembre de 2019 y 2018, no hubo transferencia entre el nivel 1 y el nivel 2.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

28. Cambios en pasivos provenientes de actividades de financiamiento

2019					
	1ro. de enero de 2019	Flujo de efectivo		Movimiento en moneda extranjera	31 de diciembre de 2019
		Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados		
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (a)	1,275,000,000	600,000,000	(675,000,000)	-	1,200,000,000
Obligaciones con bancos (b)	-	7,184,401,500	(4,190,275,780)	275,780	2,994,401,500
	<u>1,275,000,000</u>	<u>7,784,401,500</u>	<u>(4,865,275,780)</u>	<u>275,780</u>	<u>4,194,401,500</u>
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>

(a) Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos ascendentes a DOP26,068,492 (2018: DOP13,420,342).

(b) Al 31 de diciembre de 2019, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones con bancos ascendentes a DOP6,719,257.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

29. Eventos subsecuentes

A continuación, presentamos los principales eventos subsecuentes de la Compañía:

- Durante el mes de febrero del año 2020, la Compañía vendió la inversión en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados en la entidad Avianca Holding. Al 31 de diciembre de 2019, el valor razonable de esta inversión ascendía a aproximadamente RD\$362 millones. El precio de venta no difería significativamente del valor razonable al 31 de diciembre de 2019. Avianca Holding se declaró en quiebra a principios del mes de mayo del 2020.
- El pasado 11 de marzo de 2020 la Organización Mundial de la Salud elevó la situación de emergencia de salud pública ocasionada por el brote del coronavirus (COVID-19) a pandemia internacional. La rápida evolución de los hechos, a escala nacional e internacional, supone una crisis sanitaria sin precedente que impactará en el entorno macroeconómico y en la evolución de los negocios. En el mes de marzo 2020, se indentificaron brotes en la República Dominicana. La medida en que el coronavirus afectará los resultados de las compañías en la Republica Dominicana dependerá de los desarrollos futuros, que son altamente inciertos y no se pueden predecir. En fecha 19 de marzo del 2020 mediante el Decreto No. 134-20, el gobierno de la República Dominicana declaró un estado de emergencia por 25 días. Luego en fecha 13 de abril de 2020, mediante el Decreto No. 148-20 fue extendida la emergencia nacional hasta el 30 de abril del 2020 y en fecha 30 de abril de 2020, mediante el Decreto No. 153-20, el gobierno de la República Dominicana extendió nuevamente el estado de emergencia por 17 días adicionales, hasta el 17 de mayo de 2020.

La Administración de la Compañía considera que estos acontecimientos no implican cambios o ajustes a los estados financieros al 31 de diciembre de 2019 y por el año terminado en esa fecha.

Dada la complejidad de la situación y su rápida evolución, no es practicable a la fecha de aprobación de la emisión de los estados financieros realizar de forma fiable una estimación cuantificada del potencial impacto en la Compañía. La Administración está llevando a cabo las gestiones oportunas con el objetivo de hacer frente a la situación y minimizar su impacto.

Con excepción de lo anteriormente mencionado, la Administración no tiene conocimiento de ningún otro evento posterior, ocurrido entre la fecha de los estados financieros y la fecha de su emisión, que requiera la modificación de las cifras presentadas en los estados financieros autorizados o de revelación en notas a los mismos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 1 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018:

1. Equivalentes de efectivo en DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
N/A	Banco de Ahorro y Crédito Unión, S.A.	40,000,000	40,000,000	40,000,000	-	DOP	44.44%
N/A	Banco Múltiple Caribe, S.A.	50,000,000	50,000,000	50,000,000	-	DOP	55.56%
Total		90,000,000	90,000,000	90,000,000	-	-	100%

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	4,525,000	4,525,000	4,525,000	-	USD	50.00%
N/A	Banco Popular Dominicano	4,525,000	4,525,000	4,525,000	-	USD	50.00%
Total		9,050,000	9,050,000	9,050,000			100%

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	887,583,893	887,583,893	887,583,893	-	DOP	100%
Total		887,583,893	887,583,893	887,583,893			

2. Acciones

Acciones en 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	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 2 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

2. Acciones (continuación)

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
N/A	UNIVERSAL-Fondo Abierto De Inv. Dep. Financier O Flexible	291.82	3,599,017.37	4,103,887.90	504,870.53	DOP	N/A	0.2%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Renta Fija Nacional - BHD Liquidez	387.46	473,186.68	525,673.87	52,487.19	DOP	N/A	0.3%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Renta Fija Bhd Plazo 30 Dias	366.29	418,870.88	474,812.04	55,941.16	DOP	N/A	0.3%
N/A	Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	173.61	193,721.94	207,789.50	14,067.56	DOP	N/A	0.1%
N/A	JMMB-Fondo Abierto Jmmb Money Market	18.48	23,959.35	24,471.32	511.97	DOP	N/A	0.0%
N/A	UNIVERSAL-Cuotas Fondo De Inversion Abierto Un Iversal Liquidez	242.22	264,514.92	271,064.66	6,549.74	DOP	N/A	0.2%
N/A	JMMB-Fondo Mutuo Plazo 90 Dias Jmmb	32.16	33,523.70	36,722.47	3,198.76	DOP	N/A	0.0%
D08013400122	PIONEER-Cuota Del Fondo Cerrado Inv Inmobiliaria Pioneer	16,217.00	16,286,294.82	21,610,044.44	5,323,749.62	DOP	N/A	11.4%
D08012152021	PIONEER-Cuotas Participacion Pioneer	905.00	1,100,154.20	1,030,220.33	(69,933.88)	DOP	N/A	0.6%
D08013300124	GAM-Fondo De Inversion Cerrado De Renta Fija Gam	96,493.00	146,036,257.63	167,546,585.48	21,510,327.85	DOP	N/A	67.8%
D08015900129	AFI Universal-Fondo de Inversión Cerrado Para el Desarrollo de Infraestructuras Dom.	71.00	72,526,950.67	73,058,361.00	531,410.33	DOP	N/A	0.0%
D09016800110	Fiduciaria Universa fideicomiso De Oferta Pública De Valores Accionario Rica	2,100.00	210,000.00	221,534.60	11,534.60	DOP	N/A	1.5%
D08017600123	AFI POPULAR-Fondo Cerrado de Desarrollo de Sociedades Popular	25,000.00	25,040,108.20	25,039,225.00	(883.20)	DOP	N/A	17.6%
Total		142,298.04	266,206,560.36	294,150,392.61	27,943,832.23			100%

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
US74347G4082	Proshares Ultrapro Short Qqq Split	187	7,782.94	4,229.94	3,553.00	USD	N/A	0%
D09014000119	FIDUCIARIA POPULAR -Fideicomiso De Valores Inmobiliarios Fpm No. 02 - Fp	118	126,491.21	120,680.61	(5,810.60)	USD	N/A	7%
D09015700121	FIDUCIARIA UNIVERSAL-Fideicomiso De Oferta Pública De Val Ores Fid G-Patio 01-Fu	511	506,432.40	502,370.85	(4,061.55)	USD	N/A	27%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Rf Bhd 30 Dias Usd	2,977	30,813.04	32,126.41	1,313.37	USD	N/A	2%
N/A	Fondo De Inversión Abierto Plazo Men Sual Dólar	156	165,295.37	168,192.21	2,896.84	USD	N/A	9%
D08013900121	JMMB-Jmmb Fondo De Inversion Cerrado Inmo Biliario	366	384,139.08	394,284.85	10,145.77	USD	N/A	21%
D08013800123	GAM-FONDO CERRADO DE DESARROLLO DE SOCIEDADES GAM ENERGIA	499	621,748.53	630,670.13	8,921.60	USD	N/A	34%
Total		4,814.00	1,842,702.57	1,852,555.00	9,852.43			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 3 de 104

31 de diciembre de 2019

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
DO1002217425	BCRD 10.50% 04-OCT-2024	490,000.00	-	492,343.67	N/A	DOP	OTC	0.04%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	670,000.00	-	684,488.08	N/A	DOP	OTC	0.06%
DO1002215825	BCRD 11% 14-OCT-22	220,000.00	-	225,686.12	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002249923	BCRD 13% 03-ENE-20	1,020,000.00	-	1,020,294.78	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO1002213424	BCRD 10.5% 10-ENE-20	2,240,000.00	-	2,240,696.64	N/A	DOP	OTC	0.20%
DO1002253727	BCRD 13% 07-AGO-20	54,540,000.00	-	55,661,833.26	N/A	DOP	OTC	4.91%
DO1002216427	BCRD 11% 23-JUN-23	3,240,000.00	-	3,325,289.76	N/A	DOP	OTC	0.29%
DO1002218423	NOTAS BCRD 9.50% 15 - ENE- 202	1,530,000.00	-	1,530,660.96	N/A	DOP	OTC	0.14%
DO1002216526	BCRD 10% 10-SEPT-2021	13,780,000.00	-	13,856,837.28	N/A	DOP	OTC	1.24%
DO1002219322	BCRD 10.00% 26-NOV-2021	250,000.00	-	251,350.00	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002216724	BCRD 11% 05-ENE-2024	6,120,000.00	-	6,255,239.76	N/A	DOP	OTC	0.55%
DO1002214521	BCRD 11% 15-JUL-22	300,000.00	-	307,543.80	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002215726	BCRD 11% 30-SEPT-22	300,000.00	-	307,760.40	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002216625	BCRD 11% 15-SEPT-2023	320,000.00	-	328,203.52	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002217227	BCRD 11% 17-MAY-2024	600,000.00	-	613,492.20	N/A	DOP	OTC	0.05%
DO1002219017	NOTAS BCRD 10.50% 14 -MAR-2025	80,000.00	-	79,462.08	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1002220023	NOTAS BCRD 10.00% 27-MAY-2022	1,050,000.00	-	1,054,173.75	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO1002219926	NOTAS BCRD 10.00% 18-FEB-2022	1,990,000.00	-	1,999,593.79	N/A	DOP	OTC	0.18%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	21,800,000.00	-	22,306,217.80	N/A	DOP	OTC	1.96%
DO1005205013	MHRD 10.38% 06-MAR-26	10,900,000.00	-	11,110,457.20	N/A	DOP	OTC	0.98%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	58,300,000.00	-	59,908,380.40	N/A	DOP	OTC	5.25%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	28,200,000.00	-	30,111,367.80	N/A	DOP	OTC	2.54%
DO1005206623	MHRD 10.25% 11-ENE-2024	22,300,000.00	-	22,832,234.10	N/A	DOP	OTC	2.01%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	63,500,000.00	-	70,542,594.50	N/A	DOP	OTC	5.72%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	56,100,000.00	-	58,611,372.60	N/A	DOP	OTC	5.05%
DO1005241125	MHRD 16.95% 04-FEB-22	19,900,000.00	-	22,805,002.00	N/A	DOP	OTC	1.79%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	2,000,000.00	-	2,065,942.00	N/A	DOP	OTC	0.18%
DO2015200127	COMIRDOM 12.00% 28-AGOS-2028 [	36,679,725.00	-	38,186,271.34	N/A	DOP	OTC	3.30%
DO2015200226	COMIRDOM 12.00% 18-SEP-2028	2,634,310.00	-	2,743,354.63	N/A	DOP	OTC	0.24%
DO2016300124	GULFSTREAM DOMINICANA 28-MAY-2	7,179,521.00	-	7,283,265.08	N/A	DOP	OTC	0.65%
DO2016300223	GULFSTREAM PETROLEUM DOMINICAN	162,527,308.00	-	163,946,496.45	N/A	DOP	OTC	14.63%
DO2009308811	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	15,500,000.00	-	15,499,874.45	N/A	DOP	OTC	1.40%
DO2006803921	PARVAL 10.10% 13-SEPT-2022	400,535.00	-	400,266.56	N/A	DOP	OTC	0.04%
DO2012502624	ALNAP 10.75% 08-SEP-2024 [E6]	27,894,136.00	-	28,661,531.58	N/A	DOP	OTC	2.51%
DO2003700120	ASOCIACION CIBAO 10.30% 16-MAY	486,000,000.00	-	492,724,296.00	N/A	DOP	OTC	43.76%
		1,110,555,535.00	-	1,139,973,874.34	-			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 4 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

3. Títulos valores de deuda (continuación)

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	82,000.00	-	99,747.18	N/A	USD	OTC	0.11%
USP3579EAT49	DOMREP 6.6% 28-ENE-24	8,000.00	-	8,918.48	N/A	USD	OTC	0.01%
USP3579EAY34	MH DOMREP 7.45% 30-ABR-44 [REG	10,000.00	-	12,092.86	N/A	USD	OTC	0.01%
DO1005205716	MHRD 6.00% 05-MAR-2027	1,644,000.00	-	1,801,388.34	N/A	USD	OTC	2.25%
USP3579EBY25	MH DOMREP 6.50% 15-FEB-2048	18,000.00	-	19,899.34	N/A	USD	OTC	0.02%
USP3579EAH01	MH DOMREP 7.5% 06-MAY-21	87,333.33	-	90,931.29	N/A	USD	OTC	0.12%
USP3579EBD87	MH DOMREP 5.5% 27-ENE-25	20,000.00	-	21,566.78	N/A	USD	OTC	0.03%
USP3579ECB13	DOMREP 6.00% 19-JUL-2028	29,000.00	-	32,290.83	N/A	USD	OTC	0.04%
DO1005244525	MH CDEEE 7% 31-JUL-23	74,000.00	-	79,682.90	N/A	USD	OTC	0.10%
USP3579EBV85	MH DOMREP 5.95% 25-ENE-27	5,000.00	-	5,532.65	N/A	USD	OTC	0.01%
DO1005207118	MH 6.65% 27-DIC-2026	27,700,000.00	-	27,700,000.00	N/A	USD	OTC	37.94%
DO2014304714	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E47]	1,281,895.00	-	1,342,004.34	N/A	USD	OTC	1.76%
DO2009358519	EGE HAINA 6% 13-FEB-20 [E03]	666.67	-	666.76	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2009304216	EGE HAINA 6.5% 25-FEB-25	3,000.00	-	3,195.43	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014304516	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E45]	71.00	-	74.33	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014301017	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E10]	2,400.00	-	2,542.00	N/A	USD	OTC	0.00%
USP10475AA22	BANRESERVAS 7% 01-FEB-23	4,348,000.00	-	4,589,570.53	N/A	USD	OTC	5.96%
USP90301AA32	TELECOM OF TRINIDAD & TOBAGO 8	750,000.00	-	747,514.50	N/A	USD	OTC	1.03%
DO2014800216	EDENORTE 7.00% 15-JUL-2024 ARD	28,921,241.97	-	28,914,812.24	N/A	USD	OTC	39.61%
DO2014700226	EDESUR 7.00% 15-JUL-2024 ARD	1,394,502.98	-	1,394,192.86	N/A	USD	OTC	1.91%
USP06048AB19	AVIANCA HOLDING 9.00% 10-05-20	6,631,000.00	-	6,759,641.40	N/A	USD	OTC	9.08%
Total		73,010,110.95	-	73,626,265.04	-	-	-	100%

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2019 fue de DOP52.9601 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 5 de 104

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
B00126	30-dic-19	2-ene-20	117,200,000.00	126,351,528.73	122,446,575.20	(3,904,954)	DOP	OTC
B00222	30-dic-19	2-ene-20	38,500,000.00	44,949,052.05	44,120,230.00	(828,822)	DOP	OTC
Total			155,700,000.00	171,300,580.78	166,566,805.20	(4,733,776)		

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
N/A	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
N/A	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
FX-1244	03/102/2019	13/1/2020	598,956.57	598,956.57	598,956.57	-	USD	OTC
Total			598,956.57	598,956.57	598,956.57	0.00		

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
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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

5. Contratos de Venta spot

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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2018 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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

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
N/A	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
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

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 7 de 104

31 de diciembre de 2018

6. - Contratos de compra forward

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	5-dic-19	2-ene-20	13,500,000.00	14,410,007.16	14,104,341.00	(305,666.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	3-oct-19	2-ene-20	700,000.00	787,973.19	763,193.20	(24,779.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	13-nov-19	2-ene-20	230,000.00	229,262.88	230,176.18	913.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	2-ene-20	7,300,000.00	7,937,885.21	7,794,786.70	(143,098.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	2-ene-20	4,700,000.00	5,007,859.25	4,910,400.20	(97,459.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	4-oct-19	2-ene-20	400,000.00	406,357.10	400,306.40	(6,050.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-oct-19	2-ene-20	100,000.00	107,130.23	100,478.30	(6,651.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	29-nov-19	2-ene-20	1,100,000.00	1,155,052.80	1,126,253.70	(28,799.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	29-nov-19	2-ene-20	3,300,000.00	3,398,971.49	3,378,761.10	(20,210.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	29-nov-19	2-ene-20	290,000.00	290,683.52	291,152.75	469.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-oct-19	2-ene-20	5,200,000.00	5,536,587.25	5,432,783.20	(103,804.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-oct-19	2-ene-20	4,900,000.00	5,148,029.66	5,119,353.40	(28,676.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	3-dic-19	2-ene-20	800,000.00	951,505.21	916,784.00	(34,721.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	3-dic-19	2-ene-20	490,000.00	498,194.95	491,947.75	(6,247.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	4-dic-19	2-ene-20	1,900,000.00	1,947,525.01	1,944,119.90	(3,405.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	1-oct-19	2-ene-20	70,000.00	74,343.39	70,334.81	(4,008.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	4-dic-19	2-ene-20	1,700,000.00	2,008,082.99	1,948,166.00	(59,916.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	1-oct-19	2-ene-20	490,000.00	492,347.24	490,375.34	(1,971.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-nov-19	2-ene-20	900,000.00	961,213.70	940,289.40	(20,924.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-nov-19	2-ene-20	430,000.00	439,833.99	432,397.68	(7,436.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-dic-19	2-ene-20	190,000.00	195,296.84	191,059.44	(4,237.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	2-ene-20	1,500,000.00	1,634,464.26	1,567,149.00	(67,315.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-oct-19	2-ene-20	540,000.00	552,074.05	543,011.04	(9,063.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	2-dic-19	2-ene-20	160,000.00	168,653.73	160,636.00	(8,017.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	2-dic-19	2-ene-20	3,300,000.00	3,414,647.97	3,376,629.30	(38,018.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-dic-19	2-ene-20	2,700,000.00	2,880,373.97	2,820,868.20	(59,505.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	4-oct-19	2-ene-20	25,900,000.00	27,027,839.06	26,501,423.90	(526,415.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-ene-19	2-ene-20	200,000.00	191,193.79	201,115.20	9,921.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-sep-19	2-ene-20	2,800,000.00	3,029,186.48	2,925,344.80	(103,841.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-jul-19	2-ene-20	270,000.00	278,133.87	271,505.52	(6,628.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-nov-19	3-ene-20	500,000.00	503,906.02	502,788.00	(1,118.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-nov-19	3-ene-20	570,000.00	569,906.36	573,178.32	3,271.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-dic-19	3-ene-20	700,000.00	778,307.35	777,634.90	(672.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	3-ene-20	100,000.00	101,602.53	100,557.60	(1,044.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-nov-19	3-ene-20	2,500,000.00	2,648,912.38	2,669,447.50	20,535.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 8 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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	5-nov-19	3-ene-20	6,900,000.00	7,591,275.33	7,665,258.30	73,982.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-ene-20	900,000.00	1,029,866.72	999,816.30	(30,050.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-dic-19	3-ene-20	400,000.00	407,846.57	402,230.40	(5,616.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	4-oct-19	3-ene-20	8,800,000.00	9,090,336.20	9,004,344.80	(85,991.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	4-oct-19	3-ene-20	2,100,000.00	2,438,948.26	2,289,579.60	(149,368.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-nov-19	3-ene-20	60,600,000.00	65,760,817.61	63,312,819.60	(2,447,998.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-oct-19	3-ene-20	31,900,000.00	34,005,818.83	33,328,035.40	(677,783.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-dic-19	3-ene-20	500,000.00	584,098.99	555,453.50	(28,645.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	3-dic-19	3-ene-20	10,800,000.00	11,220,546.90	11,057,763.60	(162,783.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	3-dic-19	3-ene-20	10,800,000.00	11,220,546.90	11,057,763.60	(162,783.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	3-ene-20	11,400,000.00	12,127,600.38	11,910,332.40	(217,267.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	3-ene-20	4,500,000.00	4,803,597.60	4,701,447.00	(102,150.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	4-dic-19	3-ene-20	2,700,000.00	3,108,304.11	3,094,146.00	(14,158.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	3-ene-20	47,700,000.00	50,735,655.68	49,835,338.20	(900,317.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	3-ene-20	1,100,000.00	1,152,716.94	1,149,242.60	(3,474.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	3-ene-20	1,100,000.00	1,151,244.07	1,149,242.60	(2,001.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	2-dic-19	3-ene-20	20,500,000.00	21,151,781.61	20,989,273.50	(162,508.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	2-dic-19	3-ene-20	1,400,000.00	1,463,487.04	1,432,509.40	(30,977.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	31-oct-19	3-ene-20	3,800,000.00	3,925,770.11	3,888,239.80	(37,530.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	26-ago-19	3-ene-20	450,000.00	460,852.30	450,344.70	(10,507.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-oct-19	3-ene-20	440,000.00	444,662.46	442,453.44	(2,209.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-oct-19	3-ene-20	21,400,000.00	22,156,809.74	21,990,383.20	(166,426.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-oct-19	3-ene-20	2,500,000.00	2,757,784.22	2,611,915.00	(145,869.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	3-ene-20	2,900,000.00	3,367,729.40	3,221,630.30	(146,099.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jul-19	3-ene-20	400,000.00	480,322.28	444,362.80	(35,959.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-nov-19	7-ene-20	700,000.00	724,471.81	731,065.21	6,593.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	5-dic-19	7-ene-20	490,000.00	497,938.99	491,802.06	(6,136.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	8-nov-19	7-ene-20	240,000.00	241,637.88	240,125.66	(1,512.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	5-dic-19	7-ene-20	140,000.00	148,166.92	140,611.31	(7,555.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	5-dic-19	7-ene-20	390,000.00	398,699.19	391,434.29	(7,264.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-dic-19	7-ene-20	3,700,000.00	3,905,525.07	3,864,201.83	(41,323.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-dic-19	7-ene-20	1,200,000.00	1,332,951.44	1,332,465.34	(486.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	7-ene-20	290,000.00	294,544.98	291,526.84	(3,018.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-nov-19	7-ene-20	47,900,000.00	50,802,804.26	50,026,769.80	(776,034.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-nov-19	7-ene-20	550,000.00	553,888.54	552,906.83	(981.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 9 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	27-dic-19	7-ene-20	23,800,000.00	25,339,697.05	24,856,724.87	(482,972.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-dic-19	7-ene-20	47,600,000.00	50,679,394.11	49,713,449.73	(965,944.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-nov-19	7-ene-20	210,000.00	212,247.35	211,105.64	(1,141.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-nov-19	7-ene-20	10,700,000.00	11,206,002.53	11,174,853.93	(31,148.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	7-ene-20	5,300,000.00	5,596,255.19	5,535,321.08	(60,934.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-oct-19	7-ene-20	12,600,000.00	14,586,808.09	14,422,875.44	(163,932.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-oct-19	7-ene-20	500,000.00	504,484.01	502,632.48	(1,851.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-oct-19	7-ene-20	900,000.00	1,028,869.12	999,349.00	(29,520.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	7-ene-20	8,000,000.00	8,497,358.87	8,355,030.98	(142,327.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	7-ene-20	1,600,000.00	1,729,745.76	1,671,006.20	(58,739.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	7-ene-20	6,300,000.00	6,725,755.82	6,579,586.90	(146,168.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	7-ene-20	1,800,000.00	1,919,715.75	1,879,881.97	(39,833.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	7-ene-20	7,200,000.00	7,679,915.07	7,519,527.88	(160,387.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	8-oct-19	7-ene-20	97,345.00	97,946.79	98,696.26	749.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-oct-19	7-ene-20	3,600,000.00	3,836,470.93	3,759,763.94	(76,706.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-oct-19	7-ene-20	490,000.00	493,392.42	492,579.83	(812.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	6-dic-19	7-ene-20	3,900,000.00	4,059,260.42	3,992,103.71	(67,156.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	6-dic-19	7-ene-20	500,000.00	513,827.82	501,838.84	(11,988.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	7-ene-20	520,000.00	528,875.60	522,737.78	(6,137.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-ago-19	7-ene-20	1,200,000.00	1,255,303.39	1,253,280.25	(2,023.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-ene-19	7-ene-20	1,200,000.00	1,132,930.18	1,253,280.25	120,350.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-jul-19	7-ene-20	240,000.00	240,830.56	241,263.59	433.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-ene-20	510,000.00	515,256.96	512,685.13	(2,571.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	7-ene-20	1,100,000.00	1,159,062.37	1,148,816.76	(10,245.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-ene-20	530,000.00	533,719.71	532,801.12	(918.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-ene-20	230,000.00	234,296.14	231,210.94	(3,085.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	7-oct-19	7-ene-20	700,000.00	793,168.24	747,077.85	(46,090.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-ene-20	320,000.00	324,905.30	321,691.24	(3,214.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-oct-19	7-ene-20	560,000.00	571,638.63	562,959.68	(8,678.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jul-19	7-ene-20	900,000.00	973,138.84	939,940.99	(33,197.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-sep-19	7-ene-20	5,100,000.00	6,044,861.01	5,553,795.78	(491,065.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-sep-19	7-ene-20	2,900,000.00	3,374,269.50	3,158,040.74	(216,228.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-jul-19	7-ene-20	4,800,000.00	5,212,750.00	5,013,018.59	(199,731.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	5-dic-19	8-ene-20	460,000.00	471,143.67	461,672.19	(9,471.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	8-ene-20	370,000.00	373,441.15	371,940.12	(1,501.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 10 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0921	7-nov-19	8-ene-20	290,000.00	292,463.32	291,513.95	(949.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	8-ene-20	220,000.00	222,963.48	221,148.51	(1,814.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-oct-19	8-ene-20	3,500,000.00	3,935,200.36	3,886,097.57	(49,102.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	6-dic-19	8-ene-20	4,700,000.00	4,906,021.82	4,827,884.33	(78,137.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	6-dic-19	8-ene-20	14,500,000.00	15,962,205.04	15,787,518.21	(174,686.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	6-dic-19	8-ene-20	1,900,000.00	1,963,412.52	1,951,697.92	(11,714.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	8-ene-20	200,000.00	206,262.43	201,048.72	(5,213.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	8-ene-20	1,800,000.00	1,918,732.89	1,879,782.40	(38,950.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-oct-19	8-ene-20	600,000.00	689,736.32	666,188.15	(23,548.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-oct-19	8-ene-20	250,000.00	252,359.77	251,305.13	(1,054.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-oct-19	8-ene-20	900,000.00	972,118.50	939,891.20	(32,227.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	8-ene-20	800,000.00	861,091.79	853,743.25	(7,348.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	28-nov-19	8-ene-20	6,700,000.00	6,893,857.38	6,857,989.54	(35,867.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	9-oct-19	8-ene-20	8,000,000.00	8,276,566.47	8,183,027.68	(93,538.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-oct-19	8-ene-20	240,000.00	246,824.90	241,252.92	(5,571.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ene-19	8-ene-20	3,700,000.00	3,569,169.55	3,864,087.38	294,917.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	8-ene-20	150,000.00	147,927.35	150,783.08	2,855.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	8-oct-19	8-ene-20	31,000,000.00	31,911,996.20	31,709,232.25	(202,763.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-jul-19	8-ene-20	900,000.00	943,592.82	939,891.20	(3,701.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-jul-19	8-ene-20	9,600,000.00	10,444,700.09	10,025,506.13	(419,193.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-jul-19	8-ene-20	7,100,000.00	7,670,888.80	7,414,697.24	(256,191.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-jul-19	8-ene-20	9,600,000.00	10,444,700.09	10,025,506.13	(419,193.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-sep-19	8-ene-20	460,000.00	465,572.92	462,412.05	(3,160.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-abr-19	8-ene-20	180,000.00	177,788.62	180,939.69	3,151.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-dic-19	8-ene-20	1,400,000.00	1,555,516.31	1,554,439.03	(1,077.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	10-dic-19	9-ene-20	700,000.00	735,843.10	746,972.84	11,129.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	10-dic-19	9-ene-20	1,700,000.00	1,884,495.27	1,850,635.56	(33,859.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	10-dic-19	9-ene-20	460,000.00	487,080.21	471,545.46	(15,534.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	10-dic-19	9-ene-20	3,300,000.00	3,672,252.55	3,592,410.21	(79,842.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	10-dic-19	9-ene-20	1,800,000.00	1,985,651.07	1,959,496.48	(26,154.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	12-dic-19	9-ene-20	800,000.00	947,132.06	915,439.30	(31,692.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	9-ene-20	2,400,000.00	2,604,264.22	2,561,049.75	(43,214.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-dic-19	9-ene-20	8,100,000.00	8,808,814.80	8,643,542.89	(165,271.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	11-dic-19	9-ene-20	26,800,000.00	29,782,150.28	29,174,725.33	(607,424.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-dic-19	9-ene-20	1,100,000.00	1,221,308.02	1,221,263.34	(44.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 11 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0923	9-dic-19	9-ene-20	420,000.00	440,369.90	430,541.51	(9,828.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	9-ene-20	190,000.00	195,372.35	190,983.45	(4,388.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	9-ene-20	4,300,000.00	4,854,624.01	4,774,029.42	(80,594.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	9-ene-20	2,900,000.00	3,306,187.57	3,219,694.26	(86,493.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	9-ene-20	1,200,000.00	1,272,882.13	1,253,121.88	(19,760.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	11-oct-19	9-ene-20	480,000.00	485,521.74	480,218.06	(5,303.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	29-nov-19	9-ene-20	92,900,000.00	96,161,840.84	95,087,304.40	(1,074,536.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-oct-19	9-ene-20	510,000.00	514,976.46	512,639.79	(2,336.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-oct-19	9-ene-20	150,000.00	157,138.79	150,640.99	(6,497.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jul-19	9-ene-20	1,100,000.00	1,269,975.79	1,221,263.34	(48,712.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-dic-19	9-ene-20	270,000.00	270,993.42	271,397.54	404.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-dic-19	10-ene-20	1,100,000.00	1,212,937.01	1,221,181.72	8,244.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-dic-19	10-ene-20	900,000.00	1,029,136.13	999,148.68	(29,987.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-nov-19	10-ene-20	4,500,000.00	4,808,445.29	4,698,958.10	(109,487.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	10-ene-20	250,000.00	258,420.83	251,290.11	(7,130.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-dic-19	10-ene-20	23,900,000.00	25,419,959.85	24,957,417.36	(462,542.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	10-ene-20	510,000.00	522,982.08	512,617.12	(10,364.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-nov-19	10-ene-20	40,600,000.00	43,588,832.52	43,324,442.10	(264,390.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-nov-19	10-ene-20	1,000,000.00	1,029,068.63	1,044,212.91	15,144.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-nov-19	10-ene-20	800,000.00	824,416.07	853,623.24	29,207.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	10-ene-20	900,000.00	990,139.06	960,326.15	(29,812.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	3-dic-19	10-ene-20	74,900,000.00	77,909,836.44	76,660,817.37	(1,249,019.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-oct-19	10-ene-20	290,000.00	295,374.88	291,488.17	(3,886.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-jul-19	10-ene-20	600,000.00	632,930.96	626,527.75	(6,403.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-jul-19	10-ene-20	9,100,000.00	9,926,363.19	9,502,337.48	(424,025.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jul-19	10-ene-20	1,300,000.00	1,402,838.71	1,357,476.78	(45,361.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jul-19	10-ene-20	2,600,000.00	2,846,751.38	2,714,953.57	(131,797.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jul-19	10-ene-20	900,000.00	942,589.39	939,791.62	(2,797.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	12-nov-19	10-ene-20	10,000,000.00	10,223,951.40	10,188,695.86	(35,255.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	12-nov-19	10-ene-20	80,100,000.00	84,158,026.20	81,983,063.71	(2,174,962.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-ene-19	10-ene-20	3,000,000.00	3,012,683.49	3,132,638.73	119,955.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	10-ene-20	900,000.00	971,743.86	939,791.62	(31,952.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	10-ene-20	4,600,000.00	4,945,799.08	4,908,333.64	(37,465.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	14-oct-19	13-ene-20	15,600,000.00	16,914,923.91	15,962,669.11	(952,254.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	8-nov-19	13-ene-20	9,688.00	10,387.09	9,817.76	(569.33)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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	23-dic-19	13-ene-20	89,700,000.00	95,598,240.95	93,659,904.61	(1,938,336.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-dic-19	13-ene-20	500,000.00	510,114.08	502,499.11	(7,614.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11-dic-19	13-ene-20	500,000.00	596,994.01	554,971.30	(42,022.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-nov-19	13-ene-20	2,200,000.00	2,395,706.71	2,296,903.22	(98,803.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	13-ene-20	27,000,000.00	28,748,250.00	28,189,266.77	(558,983.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-dic-19	13-ene-20	440,000.00	453,306.27	442,199.22	(11,107.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	13-ene-20	430,000.00	434,878.50	432,149.24	(2,729.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	14-nov-19	13-ene-20	70,000,000.00	76,794,631.58	74,683,149.14	(2,111,482.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-nov-19	13-ene-20	3,100,000.00	3,225,423.95	3,183,615.76	(41,808.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	15-oct-19	13-ene-20	18,722.00	20,054.59	18,972.75	(1,081.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-nov-19	13-ene-20	1,000,000.00	1,025,173.12	1,044,046.92	18,873.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-dic-19	13-ene-20	800,000.00	909,201.53	887,954.08	(21,247.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-dic-19	13-ene-20	8,500,000.00	8,850,799.68	8,692,647.16	(158,152.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-oct-19	13-ene-20	500,000.00	585,073.43	533,402.00	(51,671.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	13-ene-20	81,100,000.00	86,416,956.77	84,680,248.21	(1,736,708.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	14-oct-19	13-ene-20	1,400,000.00	1,539,532.51	1,493,525.60	(46,006.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	15-oct-19	13-ene-20	1,700,000.00	1,906,596.62	1,813,566.80	(93,029.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-19	13-ene-20	1,800,000.00	1,943,774.70	1,879,284.45	(64,490.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jul-19	13-ene-20	16,500,000.00	19,132,018.98	18,314,052.84	(817,966.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jul-19	13-ene-20	1,200,000.00	1,436,140.27	1,331,931.12	(104,209.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-ene-19	13-ene-20	1,100,000.00	1,068,955.59	1,148,473.43	79,517.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	13-ene-20	200,000.00	201,531.17	208,809.38	7,278.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	13-ene-20	700,000.00	735,667.73	730,860.61	(4,807.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jul-19	13-ene-20	4,300,000.00	4,913,329.99	4,772,753.16	(140,576.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	13-ene-20	1,000,000.00	1,077,465.22	1,044,046.92	(33,418.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jul-19	13-ene-20	6,500,000.00	7,521,157.56	7,214,626.88	(306,530.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	13-ene-20	2,400,000.00	2,601,261.22	2,505,712.60	(95,548.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	14-oct-19	13-ene-20	9,100,000.00	9,889,106.29	9,707,916.41	(181,189.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-oct-19	13-ene-20	900,000.00	1,017,331.62	998,948.34	(18,383.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	13-ene-20	14,600,000.00	15,582,909.11	15,243,084.99	(339,824.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-jul-19	13-ene-20	1,300,000.00	1,532,994.53	1,442,925.38	(90,069.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-jul-19	13-ene-20	500,000.00	516,228.64	522,023.46	5,794.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	14-ene-20	800,000.00	879,015.27	853,383.18	(25,632.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	14-ene-20	800,000.00	858,487.28	853,383.18	(5,104.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-dic-19	14-ene-20	120,000.00	119,342.64	120,594.45	1,251.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	14-ene-20	14,900,000.00	16,225,053.32	15,894,261.78	(330,791.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	600,000.00	613,520.09	640,037.39	26,517.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-nov-19	14-ene-20	1,700,000.00	1,954,225.10	1,886,776.26	(67,448.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	1,400,000.00	1,492,969.42	1,493,568.55	599.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	1,200,000.00	1,284,153.72	1,280,201.61	(3,952.11)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	1,500,000.00	1,647,574.82	1,600,093.47	(47,481.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	4,800,000.00	5,236,895.79	5,120,299.10	(116,596.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	900,000.00	989,772.28	960,056.08	(29,716.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-dic-19	14-ene-20	2,900,000.00	3,281,281.45	3,218,618.32	(62,663.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	4,600,000.00	4,947,257.41	4,906,953.30	(40,304.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	12,800,000.00	13,926,652.98	13,654,130.92	(272,522.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	2,700,000.00	2,969,053.86	2,880,168.24	(88,885.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	14-ene-20	10,900,000.00	11,859,970.18	11,627,345.86	(232,624.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-oct-19	14-ene-20	1,100,000.00	1,090,714.63	1,129,618.06	38,903.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-oct-19	14-ene-20	1,000,000.00	1,077,024.92	1,026,925.51	(50,099.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-oct-19	14-ene-20	1,600,000.00	1,615,079.26	1,643,080.81	28,001.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-oct-19	14-ene-20	490,000.00	491,668.59	492,427.34	758.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	14-oct-19	14-ene-20	500,000.00	519,642.84	533,364.49	13,721.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-oct-19	14-ene-20	8,600,000.00	8,841,314.59	8,794,545.37	(46,769.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jul-19	14-ene-20	1,400,000.00	1,678,103.92	1,553,815.74	(124,288.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jul-19	14-ene-20	8,300,000.00	9,591,823.16	9,211,907.61	(379,915.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-dic-19	15-ene-20	210,000.00	214,245.64	211,030.95	(3,214.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	17-dic-19	15-ene-20	17,300,000.00	20,326,795.48	19,776,988.81	(549,806.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	13-nov-19	15-ene-20	1,600,000.00	1,816,602.91	1,829,085.67	12,482.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	15-ene-20	21,500,000.00	22,827,822.63	22,441,648.35	(386,174.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-nov-19	15-ene-20	1,400,000.00	1,594,076.22	1,553,711.84	(40,364.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-oct-19	15-ene-20	5,700,000.00	6,134,157.38	6,079,927.53	(54,229.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-dic-19	15-ene-20	1,000,000.00	1,120,558.10	1,109,794.17	(10,763.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-oct-19	15-ene-20	900,000.00	1,011,769.23	959,988.56	(51,780.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-oct-19	15-ene-20	420,000.00	424,365.71	422,061.90	(2,303.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-oct-19	15-ene-20	3,000,000.00	3,233,452.64	3,199,961.86	(33,490.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-ago-19	15-ene-20	1,000,000.00	1,078,771.50	1,043,754.10	(35,017.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	16-dic-19	15-ene-20	1,400,000.00	1,471,995.22	1,437,629.46	(34,365.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	15-ene-20	3,200,000.00	3,508,148.93	3,413,292.65	(94,856.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	15-ene-20	3,600,000.00	3,952,960.71	3,839,954.23	(113,006.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	15-ene-20	900,000.00	970,903.83	939,378.69	(31,525.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	15-ene-20	4,500,000.00	4,822,437.33	4,696,893.44	(125,543.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-19	15-ene-20	10,400,000.00	11,125,908.79	10,855,042.62	(270,866.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	15-ene-20	1,800,000.00	1,940,730.91	1,878,757.38	(61,973.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	15-ene-20	19,200,000.00	20,327,775.79	20,040,913.87	(286,861.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jul-19	15-ene-20	18,300,000.00	19,864,198.56	19,100,699.99	(763,498.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	15-ene-20	700,000.00	716,729.60	730,627.87	13,898.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-abr-19	15-ene-20	38,000,000.00	39,864,219.58	39,664,308.71	(199,910.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jul-19	15-ene-20	3,200,000.00	3,466,807.47	3,340,013.11	(126,794.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	16-ene-20	1,800,000.00	1,974,599.74	1,919,842.06	(54,757.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 14 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	17-dic-19	16-ene-20	1,700,000.00	1,761,838.24	1,745,612.47	(16,225.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	17-dic-19	16-ene-20	900,000.00	972,388.86	920,282.33	(52,106.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	16-ene-20	11,400,000.00	12,343,741.08	12,158,999.71	(184,741.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	16-ene-20	240,000.00	243,173.45	241,167.56	(2,005.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	16-ene-20	300,000.00	310,230.75	301,473.31	(8,757.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	16-ene-20	2,500,000.00	2,764,860.63	2,666,447.30	(98,413.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	16-ene-20	31,100,000.00	35,746,323.02	35,547,044.35	(199,278.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	16-ene-20	800,000.00	944,838.37	914,393.42	(30,444.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	16-ene-20	6,200,000.00	7,119,744.50	7,086,549.04	(33,195.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-dic-19	16-ene-20	600,000.00	678,870.82	665,831.97	(13,038.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-dic-19	16-ene-20	7,000,000.00	7,289,841.56	7,157,751.44	(132,090.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-dic-19	16-ene-20	8,900,000.00	9,264,414.66	9,100,569.68	(163,844.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-dic-19	16-ene-20	330,000.00	340,654.77	331,605.39	(9,049.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	16-dic-19	16-ene-20	280,000.00	293,722.48	281,104.78	(12,617.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-dic-19	16-ene-20	10,600,000.00	10,978,335.39	10,838,880.75	(139,454.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-oct-19	16-ene-20	600,000.00	666,652.41	639,947.35	(26,705.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	18-oct-19	16-ene-20	600,000.00	655,884.31	616,098.52	(39,785.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-oct-19	16-ene-20	21,800,000.00	22,849,604.38	22,753,379.88	(96,224.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-oct-19	16-ene-20	60,000.00	59,169.83	60,291.89	1,122.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	16-ene-20	3,400,000.00	3,693,358.56	3,626,368.33	(66,990.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-oct-19	16-ene-20	530,000.00	528,028.78	532,602.85	4,574.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	16-ene-20	1,500,000.00	1,550,348.63	1,565,529.92	15,181.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	16-ene-20	9,100,000.00	9,701,137.55	9,497,548.17	(203,589.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-oct-19	16-ene-20	320,000.00	325,500.95	321,556.74	(3,944.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-dic-19	17-ene-20	900,000.00	959,314.22	939,257.21	(20,057.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-dic-19	17-ene-20	1,600,000.00	1,777,058.07	1,706,406.22	(70,651.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-dic-19	17-ene-20	22,700,000.00	24,699,920.57	24,209,638.27	(490,282.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-dic-19	17-ene-20	12,400,000.00	13,427,279.32	13,224,648.22	(202,631.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-dic-19	17-ene-20	5,500,000.00	5,928,102.78	5,865,771.39	(62,331.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	21-oct-19	17-ene-20	2,900,000.00	3,009,141.62	2,965,230.00	(43,911.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	17-ene-20	900,000.00	993,968.53	959,853.50	(34,115.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-nov-19	17-ene-20	600,000.00	635,043.86	639,902.33	4,858.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-nov-19	17-ene-20	1,400,000.00	1,590,127.72	1,553,504.03	(36,623.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	18-dic-19	17-ene-20	92,600,000.00	108,745,449.72	105,823,744.50	(2,921,705.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	17-ene-20	1,800,000.00	1,926,064.00	1,878,514.42	(47,549.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	17-ene-20	5,700,000.00	6,248,691.12	6,079,072.17	(169,618.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	17-ene-20	9,700,000.00	10,564,585.30	10,345,087.72	(219,497.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	17-ene-20	5,400,000.00	5,922,759.94	5,759,121.00	(163,638.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	17-ene-20	8,200,000.00	8,866,111.03	8,745,331.89	(120,779.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	17-ene-20	2,700,000.00	2,964,600.04	2,879,560.50	(85,039.54)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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	21-oct-19	17-ene-20	900,000.00	1,006,639.72	998,681.16	(7,958.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	17-ene-20	900,000.00	1,037,612.89	1,028,524.51	(9,088.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	17-ene-20	390,000.00	393,218.58	391,927.82	(1,290.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	18-nov-19	17-ene-20	71,800,000.00	75,220,410.09	73,132,801.61	(2,087,608.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	17-ene-20	430,000.00	434,659.68	432,072.75	(2,586.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	17-ene-20	7,300,000.00	7,906,449.30	7,785,478.39	(120,970.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	17-ene-20	520,000.00	522,697.78	522,506.58	(191.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-nov-19	17-ene-20	1,300,000.00	1,379,219.72	1,442,539.46	63,319.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-sep-19	17-ene-20	27,500,000.00	29,510,962.81	28,699,525.89	(811,436.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-jul-19	17-ene-20	5,300,000.00	5,773,794.37	5,531,181.35	(242,613.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	22-jul-19	17-ene-20	480,000.00	512,663.90	482,248.57	(30,415.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-oct-19	17-ene-20	1,000,000.00	1,096,539.90	1,109,645.74	13,105.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-jul-19	20-ene-20	240,000.00	244,981.89	241,124.85	(3,857.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-jul-19	20-ene-20	470,000.00	480,283.43	472,202.84	(8,080.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-jul-19	20-ene-20	340,000.00	346,321.21	341,593.54	(4,727.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jul-19	20-ene-20	1,200,000.00	1,266,676.01	1,252,099.96	(14,576.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jul-19	20-ene-20	1,400,000.00	1,481,780.81	1,460,783.29	(20,997.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-jul-19	20-ene-20	2,400,000.00	2,580,882.46	2,504,199.93	(76,682.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	18-dic-19	20-ene-20	900,000.00	1,005,055.21	920,623.25	(84,431.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	18-dic-19	20-ene-20	28,300,000.00	29,124,840.59	28,932,919.58	(191,921.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-dic-19	20-ene-20	600,000.00	661,449.72	665,692.31	4,242.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-dic-19	20-ene-20	410,000.00	418,713.24	411,921.63	(6,791.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	5-dic-19	20-ene-20	46,300,000.00	49,865,843.87	48,494,855.53	(1,370,988.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-dic-19	20-ene-20	480,000.00	490,762.76	482,249.71	(8,513.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	20-ene-20	900,000.00	987,234.47	959,650.89	(27,583.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-19	20-ene-20	480,000.00	486,266.70	482,249.71	(4,016.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-nov-19	20-ene-20	500,000.00	591,208.17	554,711.53	(36,496.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	20-ene-20	6,800,000.00	7,217,156.39	7,095,233.13	(121,923.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	22-oct-19	20-ene-20	2,600,000.00	2,853,405.51	2,772,324.80	(81,080.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	22-oct-19	20-ene-20	10,800,000.00	11,111,612.91	11,041,538.21	(70,074.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	10,200,000.00	11,081,592.77	10,876,043.44	(205,549.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	10,200,000.00	11,081,592.77	10,876,043.44	(205,549.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	9,700,000.00	10,556,567.92	10,342,904.06	(213,663.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	7,300,000.00	7,898,165.35	7,783,835.01	(114,330.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	5,100,000.00	5,540,797.93	5,438,021.72	(102,776.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	10,200,000.00	11,081,592.77	10,876,043.44	(205,549.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	700,000.00	719,983.88	746,395.14	26,411.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-dic-19	20-ene-20	70,000.00	73,649.38	70,251.48	(3,397.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	21-oct-19	20-ene-20	170,000.00	180,251.23	170,610.75	(9,640.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-oct-19	20-ene-20	1,800,000.00	1,898,515.09	1,919,301.78	20,786.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 16 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	4,900,000.00	5,340,765.66	5,224,765.97	(115,999.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-dic-19	20-ene-20	46,500,000.00	49,552,225.56	48,518,873.64	(1,033,351.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	20-ene-20	9,100,000.00	9,876,333.05	9,703,136.80	(173,196.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-dic-19	20-ene-20	290,000.00	291,548.18	291,359.20	(188.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-oct-19	20-ene-20	2,000,000.00	2,079,685.79	2,086,833.27	7,147.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-oct-19	20-ene-20	1,000,000.00	1,133,045.57	1,109,423.05	(23,622.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jul-19	20-ene-20	7,300,000.00	7,966,971.55	7,616,941.45	(350,030.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jul-19	20-ene-20	7,800,000.00	8,416,880.56	8,138,649.77	(278,230.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jul-19	20-ene-20	1,800,000.00	1,979,481.40	1,878,149.95	(101,331.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	20-dic-19	22-ene-20	14,400,000.00	16,466,737.42	16,442,945.24	(23,792.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	22-ene-19	22-ene-20	1,100,000.00	1,298,798.88	1,186,386.94	(112,411.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	23-jul-19	22-ene-20	51,600,000.00	58,422,259.43	53,245,786.78	(5,176,472.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	23-sep-19	22-ene-20	1,700,000.00	1,914,499.99	1,812,418.74	(102,081.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jul-19	22-ene-20	1,500,000.00	1,591,462.29	1,564,922.45	(26,539.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jul-19	22-ene-20	230,000.00	235,293.21	231,057.52	(4,235.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jul-19	22-ene-20	1,000,000.00	1,043,731.79	1,043,281.63	(450.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-jul-19	22-ene-20	280,000.00	287,492.02	281,287.42	(6,204.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jul-19	22-ene-20	2,100,000.00	2,230,823.27	2,190,891.42	(39,931.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	20-dic-19	22-ene-20	290,000.00	287,830.13	289,872.89	2,042.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-dic-19	22-ene-20	700,000.00	788,882.90	776,492.21	(12,390.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20-dic-19	22-ene-20	15,500,000.00	16,010,179.81	15,845,324.72	(164,855.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	20-dic-19	22-ene-20	24,000,000.00	27,614,014.42	27,404,908.74	(209,105.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	22-ene-20	900,000.00	996,121.49	959,515.81	(36,605.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	22-ene-20	39,900,000.00	42,508,947.55	41,626,937.06	(882,010.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-dic-19	22-ene-20	900,000.00	1,023,780.58	998,347.12	(25,433.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	22-ene-20	1,400,000.00	1,549,030.68	1,492,580.14	(56,450.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	22-ene-20	5,400,000.00	5,918,180.44	5,757,094.83	(161,085.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	22-ene-20	15,900,000.00	17,261,083.43	16,951,445.89	(309,637.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	22-ene-20	15,900,000.00	17,261,083.43	16,951,445.89	(309,637.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-nov-19	22-ene-20	1,000,000.00	1,086,152.46	1,066,128.67	(20,023.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-oct-19	22-ene-20	3,300,000.00	3,485,807.84	3,442,829.38	(42,978.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-oct-19	22-ene-20	3,200,000.00	3,517,409.27	3,549,678.66	32,269.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-oct-19	22-ene-20	510,000.00	512,235.02	512,344.93	109.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-oct-19	22-ene-20	1,000,000.00	1,048,078.83	1,043,281.63	(4,797.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-oct-19	22-ene-20	250,000.00	256,839.87	251,149.48	(5,690.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-oct-19	22-ene-20	530,000.00	529,263.57	532,521.21	3,257.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-oct-19	22-ene-20	9,000,000.00	9,556,092.81	9,389,534.68	(166,558.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	22-ene-20	2,300,000.00	2,465,525.37	2,452,095.95	(13,429.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-dic-19	22-ene-20	600,000.00	678,328.96	665,564.75	(12,764.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	22-ene-20	4,500,000.00	4,937,303.34	4,797,579.03	(139,724.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 17 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0124	6-nov-19	22-ene-20	22,400,000.00	23,206,422.40	22,911,156.69	(295,265.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	22-ene-20	2,500,000.00	2,823,832.19	2,854,677.99	30,845.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19-dic-19	22-ene-20	1,900,000.00	1,956,021.52	1,950,439.18	(5,582.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19-dic-19	22-ene-20	700,000.00	759,649.15	718,582.86	(41,066.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	22-ene-20	480,000.00	489,683.90	482,207.00	(7,476.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	22-ene-20	900,000.00	987,460.67	959,515.81	(27,944.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	22-ene-20	900,000.00	987,460.67	959,515.81	(27,944.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	22-ene-20	17,400,000.00	18,880,388.99	18,550,638.90	(329,750.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	1-nov-19	22-ene-20	23,000,000.00	23,682,203.00	23,524,848.39	(157,354.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-19	22-ene-20	340,000.00	347,025.15	341,563.29	(5,461.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	25-oct-19	23-ene-20	3,500,000.00	3,826,016.26	3,731,187.67	(94,828.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-oct-19	23-ene-20	4,600,000.00	5,052,985.12	5,102,321.57	49,336.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-oct-19	23-ene-20	120,000.00	124,025.95	120,554.39	(3,471.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ene-19	23-ene-20	500,000.00	476,579.99	521,640.47	45,060.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	25-nov-19	24-ene-20	220,000.00	229,246.90	220,737.97	(8,508.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	16,400,000.00	18,232,711.37	17,908,439.86	(324,271.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	9,100,000.00	9,847,128.62	9,700,404.92	(146,723.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	9,900,000.00	10,798,045.82	10,553,187.77	(244,858.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	9,500,000.00	10,350,375.13	10,126,796.35	(223,578.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-dic-19	24-ene-20	4,300,000.00	4,837,167.82	4,769,242.21	(67,925.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	10,900,000.00	11,834,664.03	11,619,166.33	(215,497.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	3,800,000.00	4,131,054.95	4,050,718.54	(80,336.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	26-dic-19	24-ene-20	5,700,000.00	5,863,710.26	5,850,778.09	(12,932.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	26-dic-19	24-ene-20	3,800,000.00	3,906,279.90	3,900,518.73	(5,761.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	9,400,000.00	10,237,137.39	10,021,905.54	(215,231.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	65,400,000.00	71,014,786.25	69,726,874.74	(1,287,911.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	4,700,000.00	5,053,004.72	5,010,952.77	(42,051.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-ene-20	1,500,000.00	1,661,275.72	1,599,240.25	(62,035.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	24-ene-20	2,700,000.00	2,956,394.91	2,878,142.12	(78,252.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	10-dic-19	24-ene-20	9,900,000.00	10,767,146.95	10,553,187.77	(213,959.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	24-ene-20	17,200,000.00	18,691,107.87	18,334,831.28	(356,276.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-oct-19	24-ene-20	420,000.00	427,870.00	421,893.75	(5,976.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	26-nov-19	24-ene-20	29,200,000.00	30,422,937.30	29,733,069.56	(689,867.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-jul-19	24-ene-20	8,600,000.00	9,282,283.90	8,971,060.86	(311,223.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-jul-19	24-ene-20	200,000.00	209,191.29	200,901.78	(8,289.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-jul-19	24-ene-20	230,808.22	239,808.22	231,037.05	(8,771.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	24-ene-20	49,400,000.00	48,733,003.18	51,533,164.98	2,800,161.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-ene-19	24-ene-20	700,000.00	685,145.09	730,202.63	45,057.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	24-ene-20	50,800,000.00	50,202,234.37	52,993,619.05	2,791,384.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	27-nov-19	27-ene-20	19,100,000.00	22,071,895.63	21,791,903.93	(279,991.70)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BO0222	25-nov-19	27-ene-20	900,000.00	1,061,713.53	1,026,843.64	(34,869.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	27-dic-19	27-ene-20	42,700,000.00	50,084,807.07	48,718,026.07	(1,366,781.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	27-ene-20	14,000,000.00	15,268,782.63	14,923,409.34	(345,373.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	27-ene-20	1,800,000.00	1,970,323.64	1,918,724.06	(51,599.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	27-ene-20	5,400,000.00	5,907,403.78	5,756,172.17	(151,231.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	27-dic-19	27-ene-20	3,800,000.00	3,907,458.29	3,899,979.27	(7,479.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	27-ene-20	900,000.00	985,789.19	959,178.04	(26,611.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	27-ene-20	900,000.00	955,383.72	959,178.04	3,794.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	26-dic-19	27-ene-20	460,000.00	484,725.95	471,051.27	(13,674.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-nov-19	27-ene-20	23,400,000.00	24,754,906.80	24,406,727.92	(348,178.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-oct-19	27-ene-20	340,000.00	344,481.55	341,487.64	(2,993.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	28-oct-19	27-ene-20	4,300,000.00	4,775,067.73	4,768,284.36	(6,783.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	27-ene-20	490,000.00	492,071.34	492,143.95	72.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	29-oct-19	27-ene-20	11,700,000.00	12,026,172.99	11,958,159.64	(68,013.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-oct-19	27-ene-20	600,000.00	656,749.70	665,342.00	8,592.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-oct-19	27-ene-20	4,100,000.00	4,572,816.04	4,546,503.69	(26,312.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-oct-19	27-ene-20	300,000.00	301,005.50	301,312.62	307.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-jul-19	27-ene-20	1,200,000.00	1,315,173.77	1,251,532.87	(63,640.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	27-ene-20	2,300,000.00	2,460,298.96	2,451,232.76	(9,066.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	28-nov-19	27-ene-20	540,000.00	547,579.34	541,527.21	(6,052.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	27-ene-20	270,000.00	274,295.27	271,181.36	(3,113.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-oct-19	27-ene-20	1,400,000.00	1,479,945.04	1,460,121.68	(19,823.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-jul-19	27-ene-20	210,000.00	208,780.36	210,918.83	2,138.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-jul-19	27-ene-20	4,700,000.00	5,134,340.63	4,901,837.07	(232,503.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12-dic-19	28-ene-20	1,000,000.00	1,037,024.40	1,026,263.01	(10,761.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	27-dic-19	28-ene-20	470,000.00	482,557.41	471,792.63	(10,764.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-nov-19	28-ene-20	1,500,000.00	1,559,403.55	1,539,394.52	(20,009.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-nov-19	28-ene-20	2,300,000.00	2,494,159.68	2,451,060.10	(43,099.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	29-nov-19	28-ene-20	1,700,000.00	1,781,177.26	1,811,653.12	30,475.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	28-ene-20	1,000,000.00	1,045,576.01	1,065,890.36	20,314.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	28-ene-20	490,000.00	491,740.15	492,122.14	381.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28-oct-19	28-ene-20	5,300,000.00	5,687,465.92	5,648,095.01	(39,370.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	29-oct-19	28-ene-20	1,900,000.00	1,924,037.95	1,941,842.01	17,804.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	28-oct-19	28-ene-20	110,042.00	114,415.02	111,381.63	(3,033.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	28-ene-20	260,000.00	262,072.92	261,147.11	(925.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	28-oct-19	28-ene-20	8,300,000.00	8,921,059.22	8,487,030.64	(434,028.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	28-oct-19	28-ene-20	9,100,000.00	9,826,222.12	9,305,057.69	(521,164.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29-oct-19	28-ene-20	38,000,000.00	41,971,218.12	41,233,429.77	(737,788.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29-oct-19	28-ene-20	14,900,000.00	16,447,173.54	16,167,844.83	(279,328.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29-oct-19	28-ene-20	11,500,000.00	12,654,907.28	12,478,537.96	(176,369.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 19 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0224	28-oct-19	28-ene-20	210,000.00	223,563.50	214,199.68	(9,363.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	29-nov-19	28-ene-20	1,500,000.00	1,616,177.56	1,598,517.45	(17,660.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-oct-19	28-ene-20	25,300,000.00	29,521,046.36	27,452,783.50	(2,068,262.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-oct-19	28-ene-20	2,800,000.00	3,124,338.20	3,104,721.43	(19,616.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	30-oct-19	28-ene-20	12,600,000.00	12,895,306.39	12,877,478.57	(17,827.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28-nov-19	28-ene-20	2,300,000.00	2,525,881.53	2,451,060.10	(74,821.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-oct-19	28-ene-20	3,700,000.00	3,868,978.47	3,858,643.18	(10,335.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	28-ene-20	200,000.00	205,222.49	200,866.18	(4,356.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-ago-19	28-ene-20	350,000.00	361,829.03	351,515.81	(10,313.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-ago-19	28-ene-20	900,000.00	985,875.32	938,588.88	(47,286.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-ago-19	28-ene-20	1,800,000.00	1,971,750.66	1,877,177.76	(94,572.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-ago-19	28-ene-20	4,000,000.00	4,340,916.88	4,171,506.14	(169,410.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-jul-19	28-ene-20	2,200,000.00	2,388,997.88	2,294,328.37	(94,669.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-jul-19	28-ene-20	1,000,000.00	1,071,438.30	1,042,876.53	(28,561.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-jul-19	28-ene-20	550,000.00	560,722.79	552,381.99	(8,340.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	28-ene-20	3,800,000.00	4,188,091.30	4,050,383.36	(137,707.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	29-ene-20	9,000,000.00	9,744,562.40	9,590,429.07	(154,133.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	29-ene-20	2,700,000.00	2,952,843.48	2,877,128.72	(75,714.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	29-ene-20	900,000.00	984,938.69	959,042.91	(25,895.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-oct-19	29-ene-20	2,700,000.00	3,009,561.45	2,993,638.01	(15,923.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-oct-19	29-ene-20	2,400,000.00	2,643,984.40	2,661,011.56	17,027.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-oct-19	29-ene-20	24,760,000.00	24,956,024.63	24,871,331.08	(84,693.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-oct-19	29-ene-20	12,000,000.00	12,561,119.22	12,513,708.08	(47,411.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	30-dic-19	29-ene-20	91,900,000.00	100,194,276.00	93,966,481.62	(6,227,794.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-oct-19	29-ene-20	600,000.00	686,100.17	665,252.89	(20,847.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-oct-19	29-ene-20	240,000.00	246,035.49	241,028.73	(5,006.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0320	1-nov-19	29-ene-20	38,610,000.00	38,881,746.13	38,768,031.76	(113,714.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	1-nov-19	29-ene-20	15,740,000.00	16,071,668.73	16,024,959.89	(46,708.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	29-ene-20	14,270,000.00	14,379,379.88	14,334,163.76	(45,216.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	29-nov-19	29-ene-20	490,000.00	499,753.41	491,344.18	(8,409.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0224	12-ago-19	29-ene-20	530,000.00	561,390.97	540,568.43	(20,822.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	1-nov-19	29-ene-20	18,050,000.00	18,428,363.97	18,376,780.56	(51,583.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	1-nov-19	29-ene-20	3,470,000.00	3,545,824.28	3,532,821.53	(13,002.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	1-nov-19	29-ene-20	540,000.00	546,814.76	549,776.26	2,961.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-oct-19	29-ene-20	14,200,000.00	16,722,280.10	15,405,651.74	(1,316,628.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-oct-19	29-ene-20	2,400,000.00	2,676,864.19	2,661,011.56	(15,852.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-oct-19	29-ene-20	160,000.00	156,809.22	160,685.82	3,876.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-oct-19	29-ene-20	9,600,000.00	10,182,168.09	10,010,966.46	(171,201.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-oct-19	29-ene-20	9,200,000.00	9,714,360.34	9,593,842.86	(120,517.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	29-ene-20	2,300,000.00	2,304,987.02	2,398,460.71	93,473.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 20 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	2-ago-19	29-ene-20	500,000.00	594,475.62	521,404.50	(73,071.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	5,000,000.00	5,465,641.25	5,327,640.77	(138,000.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	5,700,000.00	6,153,240.29	6,073,510.47	(79,729.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-dic-19	30-ene-20	58,200,000.00	62,035,045.72	60,687,553.90	(1,347,491.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	4,500,000.00	4,924,115.28	4,794,876.69	(129,238.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	7,000,000.00	7,634,388.11	7,458,697.07	(175,691.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	17,700,000.00	19,202,716.19	18,859,848.32	(342,867.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	4,600,000.00	4,970,455.34	4,901,429.51	(69,025.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	30-dic-19	30-ene-20	2,760,000.00	2,818,589.41	2,770,328.46	(48,260.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-nov-19	30-ene-20	200,000.00	203,298.45	200,865.76	(2,432.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	30-ene-20	170,000.00	168,765.56	170,735.89	1,970.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	30-ene-20	490,000.00	492,042.16	492,185.00	142.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-oct-19	30-ene-20	5,900,000.00	6,467,144.53	6,541,215.26	74,070.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30-dic-19	30-ene-20	3,600,000.00	3,939,294.27	3,835,901.35	(103,392.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	31-ene-20	800,000.00	871,537.69	834,215.41	(37,322.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	31-ene-20	8,100,000.00	8,710,266.01	8,632,877.20	(77,388.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	3-dic-19	31-ene-20	49,800,000.00	51,783,461.25	51,105,628.49	(677,832.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-dic-19	31-ene-20	600,000.00	689,159.27	665,226.94	(23,932.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	1-nov-19	31-ene-20	900,000.00	974,820.55	928,398.11	(46,422.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-ago-19	31-ene-20	3,300,000.00	3,665,822.61	3,441,138.57	(224,684.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	31-ene-20	5,900,000.00	6,335,716.25	6,152,338.65	(183,377.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-ago-19	31-ene-20	4,300,000.00	4,728,509.38	4,483,907.83	(244,601.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-ago-19	31-ene-20	700,000.00	796,507.21	729,938.48	(66,568.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-ago-19	31-ene-20	2,700,000.00	2,999,563.22	2,815,477.01	(184,086.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-ago-19	31-ene-20	3,100,000.00	3,401,721.41	3,232,584.72	(169,136.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	5-ago-19	31-ene-20	210,000.00	232,883.90	215,046.62	(17,837.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-sep-19	31-ene-20	4,300,000.00	4,595,134.54	4,483,907.83	(111,226.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-ago-19	3-feb-20	900,000.00	984,487.25	938,318.28	(46,168.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-ago-19	3-feb-20	490,000.00	502,638.87	492,042.25	(10,596.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	12-ago-19	3-feb-20	2,700,000.00	3,131,355.39	3,077,330.79	(54,024.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-nov-19	3-feb-20	44,300,000.00	50,741,386.24	50,491,019.97	(250,366.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-nov-19	3-feb-20	45,200,000.00	51,880,334.80	51,516,796.90	(363,537.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-feb-20	3,500,000.00	3,910,066.83	3,879,746.23	(30,320.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-feb-20	1,300,000.00	1,419,901.81	1,441,048.60	21,146.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-feb-20	3,800,000.00	4,260,134.74	4,212,295.91	(47,838.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-nov-19	3-feb-20	800,000.00	810,527.02	820,867.84	10,340.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-feb-20	1,800,000.00	1,977,226.93	1,995,298.06	18,071.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-dic-19	3-feb-20	21,500,000.00	22,818,330.45	22,417,509.91	(400,820.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	6-nov-19	3-feb-20	83,300,000.00	85,736,086.86	84,792,997.20	(943,089.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	3-feb-20	1,300,000.00	1,467,633.61	1,441,048.60	(26,585.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 21 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	5-nov-19	3-feb-20	1,900,000.00	2,074,041.88	2,106,147.96	32,106.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-nov-19	3-feb-20	3,000,000.00	3,040,561.43	3,078,254.41	37,692.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-ago-19	3-feb-20	8,000,000.00	8,521,121.07	8,340,606.92	(180,514.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-ago-19	3-feb-20	2,700,000.00	2,952,768.55	2,814,954.84	(137,813.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-ago-19	3-feb-20	600,000.00	666,114.33	665,099.35	(1,014.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-dic-19	3-feb-20	22,900,000.00	24,314,084.64	23,874,987.32	(439,097.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,105,566.70	1,065,439.83	(40,126.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,105,566.70	1,065,439.83	(40,126.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,105,566.70	1,065,439.83	(40,126.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-feb-20	700,000.00	737,202.58	745,735.69	8,533.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	1-nov-19	3-feb-20	1,700,000.00	1,712,213.84	1,744,344.17	32,130.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	6-dic-19	3-feb-20	2,300,000.00	2,668,464.79	2,621,429.93	(47,034.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-ago-19	3-feb-20	500,000.00	509,551.69	502,083.93	(7,467.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-nov-19	3-feb-20	1,900,000.00	2,073,357.33	2,106,147.96	32,790.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	3-feb-20	520,000.00	534,830.03	522,167.29	(12,662.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-dic-19	3-feb-20	500,000.00	583,297.57	554,249.46	(29,048.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	3-dic-19	3-feb-20	4,200,000.00	4,865,495.42	4,786,959.00	(78,536.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-ago-19	3-feb-20	470,000.00	477,440.93	471,958.90	(5,482.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-ago-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,045,737.80	1,042,575.87	(3,161.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-ago-19	3-feb-20	470,000.00	477,332.71	471,958.90	(5,373.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ago-19	4-feb-20	1,000,000.00	1,055,274.48	1,042,511.39	(12,763.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-ago-19	4-feb-20	500,000.00	572,810.04	554,214.02	(18,596.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	4-feb-20	6,100,000.00	6,839,979.56	6,761,411.02	(78,568.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-dic-19	4-feb-20	25,400,000.00	26,899,593.90	26,482,378.88	(417,215.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	5-dic-19	4-feb-20	600,000.00	620,132.20	613,099.02	(7,033.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-dic-19	4-feb-20	1,500,000.00	1,563,747.58	1,539,060.89	(24,686.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	16,500,000.00	17,286,270.71	17,203,120.14	(83,150.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	18,300,000.00	19,167,333.62	19,079,824.15	(87,509.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	48,600,000.00	50,801,569.31	50,671,008.40	(130,560.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	4-feb-20	1,000,000.00	1,098,706.39	1,065,530.32	(33,176.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	4-feb-20	270,000.00	273,651.27	271,114.13	(2,537.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	4-feb-20	300,000.00	299,153.89	301,237.92	2,084.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	4-feb-20	560,000.00	568,689.76	562,452.93	(6,236.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	4-feb-20	240,000.00	245,272.57	240,990.33	(4,282.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	4-dic-19	4-feb-20	2,000,000.00	2,060,863.14	2,043,663.41	(17,199.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-dic-19	4-feb-20	900,000.00	1,024,099.20	997,686.58	(26,412.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-oct-19	4-feb-20	2,800,000.00	3,091,520.71	3,103,598.50	12,077.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	4-feb-20	21,700,000.00	23,031,073.85	22,624,709.51	(406,364.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	4-feb-20	220,000.00	224,634.09	220,907.81	(3,726.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	4-feb-20	800,000.00	841,516.90	852,211.85	10,694.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 22 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BO0621	6-dic-19	4-feb-20	1,300,000.00	1,413,747.53	1,409,080.17	(4,667.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	4-feb-20	220,000.00	217,543.14	220,963.65	3,420.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-dic-19	4-feb-20	170,000.00	168,835.39	170,701.49	1,866.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	4-feb-20	3,000,000.00	3,255,402.83	3,195,794.43	(59,608.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	4-feb-20	900,000.00	989,099.52	958,738.33	(30,361.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	4-feb-20	26,200,000.00	27,806,859.62	27,316,469.55	(490,390.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	4-feb-20	4,800,000.00	5,195,793.14	5,004,054.69	(191,738.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ago-19	4-feb-20	3,600,000.00	3,936,999.96	3,753,041.01	(183,958.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-ago-19	4-feb-20	470,000.00	477,313.21	471,939.40	(5,373.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-ago-19	4-feb-20	1,200,000.00	1,426,369.08	1,330,113.64	(96,255.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-ago-19	4-feb-20	1,400,000.00	1,647,964.48	1,551,799.25	(96,165.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ago-19	4-feb-20	700,000.00	767,650.58	729,757.98	(37,892.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-nov-19	5-feb-20	900,000.00	966,105.84	938,202.23	(27,903.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	7-nov-19	5-feb-20	700,000.00	757,051.06	745,635.04	(11,416.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-nov-19	5-feb-20	900,000.00	1,034,867.32	997,521.43	(37,345.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-nov-19	5-feb-20	500,000.00	508,452.93	502,042.46	(6,410.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-nov-19	5-feb-20	6,500,000.00	7,338,405.80	7,204,321.43	(134,084.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-nov-19	5-feb-20	1,000,000.00	1,061,424.75	1,042,446.92	(18,977.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-nov-19	5-feb-20	3,700,000.00	4,211,465.10	4,100,921.43	(110,543.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	6-nov-19	5-feb-20	190,000.00	197,554.13	190,522.31	(7,031.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-nov-19	5-feb-20	230,000.00	228,488.96	230,939.53	2,450.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	5-feb-20	3,100,000.00	3,348,366.71	3,302,098.04	(46,268.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	5-feb-20	1,900,000.00	2,062,272.01	2,023,866.54	(38,405.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	5-feb-20	330,000.00	341,466.61	331,348.02	(10,118.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	5-feb-20	3,000,000.00	3,282,528.64	3,195,578.75	(86,949.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ago-19	5-feb-20	900,000.00	983,735.97	938,202.23	(45,533.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	9-ago-19	5-feb-20	530,000.00	550,462.53	529,663.03	(20,799.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ago-19	5-feb-20	900,000.00	1,034,557.99	938,202.23	(96,355.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ago-19	5-feb-20	4,800,000.00	5,229,585.70	5,003,745.20	(225,840.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ago-19	5-feb-20	600,000.00	624,610.91	625,468.15	857.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-ago-19	5-feb-20	420,000.00	431,370.61	421,715.67	(9,654.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-ago-19	5-feb-20	1,200,000.00	1,425,650.40	1,330,028.57	(95,621.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-ago-19	5-feb-20	510,000.00	522,604.48	512,083.31	(10,521.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-nov-19	6-feb-20	800,000.00	908,147.47	886,724.27	(21,423.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-dic-19	6-feb-20	1,000,000.00	1,004,178.48	1,025,952.17	21,773.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-nov-19	6-feb-20	160,000.00	162,581.21	160,646.95	(1,934.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-dic-19	6-feb-20	800,000.00	921,406.28	886,629.00	(34,777.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	6-feb-20	2,100,000.00	2,323,994.69	2,236,754.14	(87,240.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-feb-20	11,200,000.00	11,742,178.29	11,674,683.31	(67,494.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-feb-20	2,700,000.00	2,897,515.30	2,814,432.58	(83,082.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 23 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	8-nov-19	6-feb-20	600,000.00	615,444.87	610,680.57	(4,764.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	8-nov-19	6-feb-20	530,000.00	550,884.81	531,483.55	(19,401.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-feb-20	9,100,000.00	9,642,355.66	9,485,680.19	(156,675.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-ago-19	7-feb-20	3,700,000.00	4,105,545.26	3,856,576.44	(248,968.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-ago-19	7-feb-20	4,500,000.00	4,926,539.44	4,690,430.80	(236,108.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-nov-19	7-feb-20	2,100,000.00	2,228,373.20	2,188,867.71	(39,505.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	7-feb-20	600,000.00	672,203.88	625,390.77	(46,813.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-nov-19	7-feb-20	700,000.00	781,679.16	775,750.74	(5,928.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	7-feb-20	900,000.00	1,032,483.32	997,393.81	(35,089.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	10-dic-19	7-feb-20	460,000.00	503,245.56	470,427.81	(32,817.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	9-dic-19	10-feb-20	2,000,000.00	2,196,707.47	2,129,666.78	(67,040.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	10-feb-20	9,000,000.00	9,572,838.38	9,379,120.41	(193,717.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-nov-19	10-feb-20	1,700,000.00	1,953,606.52	1,883,604.47	(70,002.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-nov-19	10-feb-20	400,000.00	406,453.09	401,551.00	(4,902.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-nov-19	10-feb-20	400,000.00	402,732.71	401,551.00	(1,181.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	11-nov-19	10-feb-20	1,000,000.00	1,062,592.52	1,021,593.54	(40,998.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-nov-19	10-feb-20	3,700,000.00	3,979,805.36	3,939,883.55	(39,921.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-ago-19	10-feb-20	330,000.00	333,302.07	331,279.57	(2,022.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-nov-19	10-feb-20	1,400,000.00	1,481,898.67	1,490,766.75	8,868.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-ago-19	10-feb-20	1,000,000.00	1,069,642.89	1,042,124.49	(27,518.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-ago-19	10-feb-20	370,000.00	381,816.29	371,434.67	(10,381.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-ago-19	10-feb-20	800,000.00	902,201.51	833,699.59	(68,501.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-ago-19	10-feb-20	900,000.00	982,615.32	937,912.04	(44,703.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	10-feb-20	260,000.00	262,620.58	261,039.11	(1,581.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	10-feb-20	1,300,000.00	1,399,572.55	1,354,761.84	(44,810.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-nov-19	10-feb-20	4,600,000.00	4,977,349.26	4,898,233.60	(79,115.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-nov-19	10-feb-20	2,100,000.00	2,288,609.60	2,236,150.12	(52,459.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	13-nov-19	11-feb-20	17,100,000.00	17,752,015.47	17,540,002.01	(212,013.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	13-nov-19	11-feb-20	64,560,000.00	65,663,225.48	64,492,307.45	(1,170,918.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-dic-19	11-feb-20	900,000.00	949,086.73	937,854.00	(11,232.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	11-dic-19	11-feb-20	13,500,000.00	14,899,869.93	14,615,561.56	(284,308.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	11-feb-20	423,049.50	423,049.50	421,662.37	(1,387.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	9-dic-19	11-feb-20	600,000.00	641,755.98	638,856.89	(2,899.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	11-feb-20	2,300,000.00	2,402,042.62	2,396,737.99	(5,304.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-dic-19	11-feb-20	2,900,000.00	3,104,636.73	3,087,808.28	(16,828.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	11-dic-19	11-feb-20	410,000.00	452,864.46	419,187.46	(33,677.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	11-feb-20	1,500,000.00	1,594,968.00	1,563,089.99	(31,878.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-dic-19	11-feb-20	500,000.00	582,170.05	553,965.86	(28,204.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-nov-19	11-feb-20	3,300,000.00	3,582,968.72	3,513,712.88	(69,255.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	12-dic-19	11-feb-20	900,000.00	986,474.29	974,370.77	(12,103.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 24 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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-nov-19	11-feb-20	2,500,000.00	2,754,063.43	2,769,829.29	15,765.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ago-19	11-feb-20	1,100,000.00	1,221,090.42	1,146,265.99	(74,824.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ago-19	11-feb-20	1,500,000.00	1,676,978.84	1,563,089.99	(113,888.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ago-19	11-feb-20	1,000,000.00	1,081,468.61	1,042,059.99	(39,408.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ago-19	11-feb-20	4,800,000.00	5,161,895.30	5,002,476.10	(159,419.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	11-feb-20	400,000.00	409,785.94	401,534.40	(8,251.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-oct-19	11-feb-20	340,000.00	346,632.74	341,304.24	(5,328.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-nov-19	11-feb-20	290,000.00	298,167.80	291,112.44	(7,055.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-nov-19	11-feb-20	1,000,000.00	1,102,952.34	1,064,761.48	(38,190.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	11-feb-20	4,100,000.00	4,339,231.84	4,272,445.98	(66,785.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	13-nov-19	11-feb-20	8,200,000.00	10,181,773.37	9,327,141.40	(854,631.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-feb-20	5,500,000.00	5,934,593.39	5,855,792.57	(78,800.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-feb-20	1,100,000.00	1,187,732.04	1,171,158.51	(16,573.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	12-feb-20	1,600,000.00	1,748,932.76	1,703,503.29	(45,429.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	12-dic-19	12-feb-20	300,000.00	331,922.69	306,702.98	(25,219.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-dic-19	12-feb-20	600,000.00	657,000.05	625,197.30	(31,802.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-nov-19	12-feb-20	9,300,000.00	9,697,776.99	9,690,558.12	(7,218.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	12-feb-20	10,800,000.00	11,751,459.78	11,498,647.24	(252,812.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-ago-19	12-feb-20	700,000.00	797,674.55	775,502.56	(22,171.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12-dic-19	13-feb-20	700,000.00	732,428.64	717,949.88	(14,478.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-dic-19	13-feb-20	1,000,000.00	1,121,158.77	1,107,789.88	(13,368.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	15-nov-19	13-feb-20	7,200,000.00	7,746,638.13	7,667,655.00	(78,983.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-nov-19	13-feb-20	600,000.00	676,688.62	625,158.60	(51,530.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	14-nov-19	13-feb-20	2,500,000.00	2,561,931.55	2,564,106.72	2,175.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	15-nov-19	13-feb-20	900,000.00	993,847.58	958,155.87	(35,691.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-nov-19	13-feb-20	23,300,000.00	24,826,004.25	24,276,992.18	(549,012.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	13-feb-20	1,400,000.00	1,466,107.92	1,458,793.28	(7,314.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	13-feb-20	7,400,000.00	7,474,112.48	7,710,764.47	236,651.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	17-dic-19	14-feb-20	1,700,000.00	2,115,104.30	1,932,640.63	(182,463.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-nov-19	14-feb-20	4,800,000.00	5,017,809.76	5,000,959.15	(16,850.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	14-feb-20	10,900,000.00	11,641,048.58	11,356,344.74	(284,703.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-dic-19	14-feb-20	250,000.00	258,550.34	250,960.58	(7,589.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-ago-19	14-feb-20	2,400,000.00	2,602,050.24	2,500,479.58	(101,570.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-ago-19	14-feb-20	3,500,000.00	3,932,252.75	3,646,532.71	(285,720.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	19-ago-19	14-feb-20	1,200,000.00	1,432,942.09	1,226,232.17	(206,709.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-ago-19	14-feb-20	1,200,000.00	1,311,681.65	1,250,239.79	(61,441.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-dic-19	14-feb-20	19,800,000.00	21,012,613.97	20,631,557.49	(381,056.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-nov-19	17-feb-20	480,000.00	489,257.26	481,721.74	(7,535.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-ago-19	17-feb-20	2,300,000.00	2,448,071.20	2,395,847.80	(52,223.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	17-feb-20	22,600,000.00	24,062,846.25	23,541,808.80	(521,037.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 25 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	19-nov-19	17-feb-20	22,600,000.00	24,062,846.25	23,541,808.80	(521,037.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	17-feb-20	3,200,000.00	3,366,892.75	3,333,353.46	(33,539.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-nov-19	17-feb-20	1,000,000.00	1,091,948.25	1,064,329.92	(27,618.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-nov-19	17-feb-20	290,000.00	293,466.45	291,040.22	(2,426.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-nov-19	17-feb-20	35,300,000.00	37,528,230.46	36,771,055.34	(757,175.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-nov-19	17-feb-20	35,300,000.00	37,528,230.46	36,771,055.34	(757,175.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-dic-19	17-feb-20	3,400,000.00	3,565,646.62	3,541,688.05	(23,958.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	17-feb-20	1,800,000.00	1,998,105.89	1,915,793.85	(82,312.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-ago-19	17-feb-20	900,000.00	1,004,775.74	922,919.26	(81,856.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-ago-19	17-feb-20	270,000.00	276,158.14	271,006.18	(5,151.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-ago-19	17-feb-20	1,400,000.00	1,634,799.68	1,550,508.62	(84,291.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-ago-19	17-feb-20	474,950.25	474,950.25	471,685.87	(3,264.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-ago-19	17-feb-20	2,700,000.00	2,970,742.20	2,812,516.98	(158,225.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-nov-19	18-feb-20	600,000.00	742,838.21	664,461.13	(78,377.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-nov-19	18-feb-20	130,000.00	135,546.31	130,460.91	(5,085.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	18-dic-19	18-feb-20	4,700,000.00	4,846,723.65	4,799,997.12	(46,726.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-nov-19	18-feb-20	2,900,000.00	3,151,329.48	3,086,348.14	(64,981.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-nov-19	18-feb-20	480,000.00	489,552.11	481,701.81	(7,850.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-dic-19	18-feb-20	600,000.00	630,270.67	624,965.06	(5,305.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-dic-19	18-feb-20	190,000.00	195,658.02	190,673.63	(4,984.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	18-feb-20	3,700,000.00	3,960,871.94	3,939,134.12	(21,737.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	18-feb-20	1,400,000.00	1,496,198.96	1,489,961.17	(6,237.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-nov-19	18-feb-20	290,000.00	297,840.44	291,028.18	(6,812.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-nov-19	18-feb-20	6,000,000.00	6,372,204.53	6,249,650.63	(122,553.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	18-feb-20	1,700,000.00	1,778,696.36	1,809,872.43	31,176.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-nov-19	18-feb-20	220,000.00	225,953.33	220,780.00	(5,173.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	18-nov-19	18-feb-20	10,900,000.00	11,221,687.38	11,131,908.22	(89,779.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	18-feb-20	1,000,000.00	1,049,301.10	1,064,630.84	15,329.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	18-nov-19	18-feb-20	1,200,000.00	1,278,936.74	1,230,505.96	(48,430.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	18-feb-20	260,000.00	266,179.88	260,921.82	(5,258.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	18-feb-20	1,200,000.00	1,239,578.02	1,249,930.13	10,352.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	18-feb-20	1,105,200.29	1,105,200.29	1,064,257.98	(40,942.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	18-feb-20	1,700,000.00	1,814,422.07	1,770,734.34	(43,687.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	20-nov-19	18-feb-20	16,900,000.00	19,864,377.90	18,274,993.37	(1,589,384.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	20-nov-19	18-feb-20	530,000.00	558,743.70	542,118.26	(16,625.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	20-nov-19	18-feb-20	310,000.00	335,154.80	309,581.21	(25,573.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-nov-19	18-feb-20	8,100,000.00	8,657,494.76	8,437,028.35	(220,466.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	18-feb-20	4,800,000.00	5,224,065.92	5,108,438.29	(115,627.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-oct-19	18-feb-20	700,000.00	784,271.40	775,204.65	(9,066.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-ago-19	18-feb-20	1,200,000.00	1,369,209.18	1,328,922.27	(40,286.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 26 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0921	19-ago-19	19-feb-20	440,000.00	454,671.07	441,541.73	(13,129.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ago-19	19-feb-20	10,900,000.00	11,756,312.59	11,352,828.69	(403,483.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	23-ago-19	19-feb-20	1,000,000.00	1,048,369.00	1,025,377.42	(22,991.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	23-ago-19	19-feb-20	240,000.00	248,433.07	240,826.95	(7,606.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-dic-19	19-feb-20	510,000.00	520,904.59	511,787.00	(9,117.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-dic-19	19-feb-20	700,000.00	787,467.50	775,155.00	(12,312.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-nov-19	19-feb-20	800,000.00	813,714.40	851,348.83	37,634.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-nov-19	19-feb-20	8,500,000.00	9,084,592.66	8,853,123.29	(231,469.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-nov-19	19-feb-20	1,200,000.00	1,289,442.41	1,277,023.24	(12,419.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-nov-19	19-feb-20	100,000.00	107,179.61	100,195.68	(6,983.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-19	20-feb-20	260,000.00	263,657.42	260,938.82	(2,718.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	22-nov-19	20-feb-20	3,300,000.00	3,575,414.46	3,511,576.50	(63,837.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	22-nov-19	20-feb-20	4,400,000.00	4,813,026.09	4,682,102.00	(130,924.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	4-dic-19	20-feb-20	148,400,000.00	159,417,889.54	155,182,779.05	(4,235,110.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	22-nov-19	20-feb-20	460,000.00	487,467.77	470,465.70	(17,002.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-nov-19	20-feb-20	460,000.00	510,909.28	461,592.70	(49,316.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-nov-19	20-feb-20	540,000.00	555,657.03	541,869.70	(13,787.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	13-nov-19	21-feb-20	230,000.00	236,852.90	230,510.59	(6,342.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	23-dic-19	21-feb-20	900,000.00	984,598.98	957,637.93	(26,961.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	23-dic-19	21-feb-20	4,700,000.00	5,096,475.67	5,002,859.06	(93,616.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ago-19	24-feb-20	14,500,000.00	15,697,478.92	15,097,708.31	(599,770.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	27-ago-19	24-feb-20	440,000.00	477,817.00	440,736.47	(37,080.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-ago-19	24-feb-20	1,300,000.00	1,441,960.43	1,382,974.16	(58,986.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-ago-19	24-feb-20	1,000,000.00	1,076,088.58	1,041,221.26	(34,867.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-ago-19	24-feb-20	2,800,000.00	3,069,436.24	2,915,419.54	(154,016.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	27-ago-19	24-feb-20	1,800,000.00	2,055,675.43	1,838,545.51	(217,129.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	24-feb-20	490,000.00	498,369.92	491,693.69	(6,676.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	24-feb-20	280,000.00	281,039.05	280,922.96	(116.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	24-feb-20	4,600,000.00	4,948,550.87	4,893,600.87	(54,950.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-nov-19	24-feb-20	1,200,000.00	1,236,771.44	1,249,465.52	12,694.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-nov-19	24-feb-20	31,100,000.00	33,052,471.43	32,381,981.27	(670,490.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	26-nov-19	24-feb-20	63,200,000.00	65,626,880.00	64,553,375.63	(1,073,504.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-nov-19	24-feb-20	2,100,000.00	2,208,347.14	2,186,564.65	(21,782.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ago-19	25-feb-20	7,000,000.00	7,540,265.42	7,288,097.06	(252,168.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-dic-19	25-feb-20	480,000.00	484,503.68	481,562.27	(2,941.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	25-feb-20	900,000.00	983,056.88	957,378.88	(25,678.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	25-feb-20	900,000.00	996,804.59	996,244.70	(559.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	25-feb-20	160,000.00	166,836.53	160,520.76	(6,315.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	25-nov-19	25-feb-20	700,000.00	715,229.24	744,628.02	29,398.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-nov-19	25-feb-20	240,000.00	244,373.77	240,781.14	(3,592.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 27 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0322	25-nov-19	25-feb-20	5,800,000.00	5,989,133.51	5,921,789.12	(67,344.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-nov-19	25-feb-20	1,500,000.00	1,669,530.88	1,660,407.83	(9,123.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-nov-19	25-feb-20	2,000,000.00	2,183,948.70	2,213,877.10	29,928.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-nov-19	25-feb-20	5,200,000.00	5,620,955.90	5,531,522.43	(89,433.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-ago-19	26-feb-20	9,100,000.00	9,786,771.15	9,473,938.82	(312,832.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-ago-19	26-feb-20	3,600,000.00	3,914,453.42	3,747,931.84	(166,521.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-ago-19	26-feb-20	1,600,000.00	1,786,907.12	1,665,747.49	(121,159.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-ago-19	26-feb-20	1,700,000.00	1,841,735.49	1,769,856.70	(71,878.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-ago-19	26-feb-20	3,600,000.00	3,915,943.83	3,747,931.84	(168,011.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-oct-19	26-feb-20	480,000.00	479,078.47	481,622.07	2,543.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-ago-19	26-feb-20	500,000.00	565,123.88	553,433.79	(11,690.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-ago-19	26-feb-20	250,000.00	248,524.02	250,844.83	2,320.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-ago-19	26-feb-20	1,700,000.00	1,831,743.41	1,769,856.70	(61,886.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-nov-19	26-feb-20	2,400,000.00	2,493,834.50	2,498,621.23	4,786.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-ago-19	26-feb-20	900,000.00	997,640.29	936,982.96	(60,657.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	26-feb-20	600,000.00	628,315.52	624,655.31	(3,660.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-feb-19	26-feb-20	1,000,000.00	1,078,023.38	1,041,092.18	(36,931.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	26-feb-20	1,800,000.00	2,009,286.59	1,992,361.65	(16,924.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	26-feb-20	700,000.00	776,942.73	774,936.30	(2,006.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	26-feb-20	600,000.00	685,531.21	638,470.11	(47,061.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	26-feb-20	360,000.00	368,675.46	361,156.75	(7,518.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-dic-19	26-feb-20	1,000,000.00	1,094,088.02	1,106,867.58	12,779.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	26-nov-19	26-feb-20	900,000.00	1,013,490.13	919,192.48	(94,297.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-nov-19	28-feb-20	190,000.00	196,962.63	190,594.72	(6,367.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28-nov-19	28-feb-20	900,000.00	990,696.18	957,184.57	(33,511.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28-nov-19	28-feb-20	1,700,000.00	1,882,668.38	1,808,015.29	(74,653.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-ago-19	28-feb-20	7,300,000.00	7,832,888.31	7,599,030.49	(233,857.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ago-19	28-feb-20	9,100,000.00	9,793,075.48	9,472,764.04	(320,311.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-ago-19	28-feb-20	2,400,000.00	2,573,460.41	2,498,726.01	(74,734.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	27-nov-19	28-feb-20	170,000.00	176,797.89	170,246.04	(6,551.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-nov-19	28-feb-20	360,000.00	365,137.25	361,126.83	(4,010.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-nov-19	28-feb-20	1,200,000.00	1,341,935.44	1,328,070.77	(13,864.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-sep-19	2-mar-20	370,000.00	379,396.75	371,354.37	(8,042.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	3-dic-19	2-mar-20	500,000.00	630,452.43	567,055.89	(63,396.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	2-mar-20	2,500,000.00	2,714,593.57	2,660,019.00	(54,574.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	2-dic-19	2-mar-20	520,000.00	530,702.56	521,127.37	(9,575.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	2-mar-20	3,400,000.00	3,664,973.39	3,619,235.54	(45,737.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	2-mar-20	3,400,000.00	3,649,860.22	3,540,852.48	(109,007.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-sep-19	2-mar-20	4,700,000.00	5,102,357.60	4,894,707.84	(207,649.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-sep-19	2-mar-20	500,000.00	543,302.55	532,003.80	(11,298.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 28 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	19-nov-19	2-mar-20	1,800,000.00	1,924,941.59	1,874,568.96	(50,372.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-dic-19	2-mar-20	290,000.00	292,607.08	291,061.54	(1,545.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	2-mar-20	1,000,000.00	1,105,677.33	1,041,427.20	(64,250.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	2-mar-20	6,800,000.00	7,366,135.89	7,235,251.67	(130,884.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	2-mar-20	1,100,000.00	1,186,523.73	1,170,408.36	(16,115.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-nov-19	2-mar-20	3,400,000.00	3,649,765.19	3,540,852.48	(108,912.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-dic-19	2-mar-20	4,800,000.00	5,098,201.68	4,999,723.07	(98,478.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	3-mar-20	480,000.00	487,705.96	481,742.15	(5,963.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	3-mar-20	900,000.00	1,008,068.43	957,985.06	(50,083.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	3-mar-20	3,500,000.00	3,755,571.28	3,723,813.30	(31,757.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-dic-19	3-mar-20	150,000.00	157,530.92	150,544.42	(6,986.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	3-mar-20	440,000.00	447,647.21	441,596.97	(6,050.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	3-mar-20	600,000.00	633,244.13	638,483.45	5,239.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	3-mar-20	800,000.00	888,509.60	851,542.28	(36,967.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-dic-19	3-mar-20	1,900,000.00	1,988,028.62	1,940,658.75	(47,369.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	3-dic-19	3-mar-20	120,000.00	127,605.19	120,225.89	(7,379.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	3-mar-20	240,000.00	243,852.98	240,871.07	(2,981.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	3-mar-20	3,700,000.00	3,951,237.07	3,936,602.64	(14,634.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-sep-19	3-mar-20	21,000,000.00	22,437,487.80	21,872,717.75	(564,770.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	5-sep-19	3-mar-20	300,000.00	318,125.22	301,076.92	(17,048.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-dic-19	3-mar-20	290,000.00	298,744.79	291,052.55	(7,692.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-mar-20	4,300,000.00	4,602,470.81	4,574,970.63	(27,500.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-dic-19	3-mar-20	450,000.00	457,524.14	451,633.26	(5,890.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	3-mar-20	1,100,000.00	1,174,350.83	1,170,341.32	(4,009.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	4-mar-20	4,600,000.00	5,026,657.04	4,896,123.42	(130,533.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-mar-19	4-mar-20	900,000.00	978,754.12	937,187.35	(41,566.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-sep-19	4-mar-20	2,900,000.00	3,125,480.13	3,019,825.91	(105,654.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	5-dic-19	4-mar-20	6,400,000.00	6,916,318.59	6,808,868.57	(107,450.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-dic-19	4-mar-20	480,000.00	487,332.31	481,727.26	(5,605.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	5-dic-19	4-mar-20	25,600,000.00	27,810,646.78	27,631,379.74	(179,267.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-dic-19	4-mar-20	1,000,000.00	1,053,783.17	1,041,319.28	(12,463.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-dic-19	4-mar-20	16,600,000.00	17,517,917.92	17,289,016.22	(228,901.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-dic-19	4-mar-20	250,000.00	256,245.87	250,946.35	(5,299.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-dic-19	4-mar-20	310,000.00	311,638.94	311,115.52	(523.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	6-sep-19	4-mar-20	2,800,000.00	3,319,365.92	3,022,182.16	(297,183.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-dic-19	5-mar-20	1,500,000.00	1,588,534.15	1,538,117.62	(50,416.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-dic-19	5-mar-20	900,000.00	915,808.83	922,870.57	7,061.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	5-dic-19	5-mar-20	160,000.00	163,032.66	160,332.89	(2,699.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	5-mar-20	1,100,000.00	1,140,373.94	1,170,207.24	29,833.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-dic-19	5-mar-20	3,100,000.00	3,341,192.83	3,297,856.78	(43,336.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 29 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	6-dic-19	5-mar-20	7,500,000.00	7,992,519.85	7,809,489.86	(183,029.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	5-mar-20	500,000.00	506,240.49	501,783.73	(4,456.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-sep-19	5-mar-20	5,600,000.00	6,034,699.35	5,831,085.76	(203,613.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	9-sep-19	6-mar-20	8,500,000.00	10,506,716.45	9,633,441.81	(873,274.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-sep-19	6-mar-20	500,000.00	519,470.24	501,864.66	(17,605.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-dic-19	6-mar-20	310,000.00	315,348.19	311,156.09	(4,192.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-dic-19	6-mar-20	700,000.00	775,253.17	774,253.05	(1,000.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-dic-19	6-mar-20	600,000.00	693,157.64	663,645.47	(29,512.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-nov-19	6-mar-20	360,000.00	361,137.09	361,273.12	136.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-sep-19	9-mar-20	1,380,000.00	1,421,840.77	1,384,751.88	(37,088.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-sep-19	9-mar-20	180,000.00	190,234.40	180,288.98	(9,945.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0124	11-sep-19	9-mar-20	290,000.00	318,203.19	295,312.31	(22,890.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-sep-19	9-mar-20	1,000,000.00	1,079,327.47	1,041,049.42	(38,278.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	9-mar-20	100,000.00	101,247.58	100,344.34	(903.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	9-mar-20	420,000.00	429,271.70	421,530.97	(7,740.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-sep-19	9-mar-20	1,700,000.00	1,853,865.37	1,769,784.01	(84,081.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-sep-19	10-mar-20	500,000.00	592,979.50	552,891.25	(40,088.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	10-mar-20	1,900,000.00	2,066,800.88	1,977,891.33	(88,909.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	10-mar-20	700,000.00	815,197.50	774,047.74	(41,149.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-dic-19	10-mar-20	50,700,000.00	52,726,732.50	51,788,734.51	(937,997.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-dic-19	10-mar-20	69,900,000.00	72,765,690.30	71,401,036.34	(1,364,653.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	10-dic-19	10-mar-20	8,900,000.00	9,554,804.72	9,303,890.42	(250,914.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	10-mar-20	24,400,000.00	25,725,925.77	25,405,305.33	(320,620.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	10-mar-20	3,600,000.00	3,826,509.38	3,747,583.58	(78,925.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	9-dic-19	10-mar-20	3,500,000.00	3,804,755.48	3,722,319.92	(82,435.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	11-dic-19	10-mar-20	17,000,000.00	17,588,030.19	17,429,153.82	(158,876.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	9-dic-19	10-mar-20	1,000,000.00	1,037,976.37	1,063,519.98	25,543.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-sep-19	11-mar-20	1,600,000.00	1,757,531.78	1,665,506.32	(92,025.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	11-mar-20	1,000,000.00	1,039,276.49	1,063,459.01	24,182.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	12-dic-19	11-mar-20	900,000.00	982,275.44	970,340.24	(11,935.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-dic-19	11-mar-20	240,000.00	255,151.22	240,363.14	(14,788.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	12-dic-19	11-mar-20	2,600,000.00	3,048,216.39	2,944,211.35	(104,005.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-dic-19	11-mar-20	190,000.00	188,322.13	190,522.25	2,200.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	10-dic-19	11-mar-20	1,800,000.00	1,905,493.96	1,914,226.22	8,732.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-mar-19	12-mar-20	270,000.00	271,586.13	270,704.29	(881.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	12-mar-20	2,890,000.00	3,081,771.83	2,898,698.16	(183,073.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	13-dic-19	12-mar-20	98,121.00	99,019.02	99,012.24	(6.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	12-mar-20	900,000.00	956,478.79	936,798.72	(19,680.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	12-mar-20	1,500,000.00	1,594,336.84	1,561,331.20	(33,005.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	12-mar-20	1,700,000.00	1,879,239.16	1,807,776.66	(71,462.50)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0921	13-dic-19	12-mar-20	480,000.00	493,224.02	481,203.94	(12,020.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-dic-19	12-mar-20	9,500,000.00	10,086,132.93	9,888,430.91	(197,702.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-dic-19	12-mar-20	900,000.00	1,028,002.52	995,072.24	(32,930.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-mar-20	900,000.00	986,782.96	957,058.23	(29,724.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	12-dic-19	12-mar-20	270,000.00	297,445.73	275,724.70	(21,721.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	27-dic-19	13-mar-20	510,000.00	539,497.97	521,370.42	(18,127.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	16-mar-20	1,100,000.00	1,169,080.62	1,169,469.53	388.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-dic-19	16-mar-20	15,400,000.00	16,306,756.47	16,029,783.01	(276,973.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-sep-19	16-mar-20	5,700,000.00	6,073,460.92	5,931,827.41	(141,633.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	13-dic-19	16-mar-20	110,100,000.00	119,566,885.38	117,117,371.20	(2,449,514.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-sep-19	16-mar-20	360,000.00	368,213.69	360,841.43	(7,372.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-sep-19	16-mar-20	600,000.00	612,283.22	624,402.88	12,119.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	16-mar-20	2,200,000.00	2,405,839.93	2,338,939.05	(66,900.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-sep-19	16-mar-20	300,000.00	302,628.89	300,701.19	(1,927.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-sep-19	16-mar-20	230,000.00	237,716.00	230,537.58	(7,178.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-sep-19	16-mar-20	8,900,000.00	10,297,815.68	9,467,253.44	(830,562.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	16-dic-19	16-mar-20	280,000.00	296,149.75	280,513.95	(15,635.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-sep-19	16-mar-20	5,600,000.00	6,032,720.58	5,827,760.26	(204,960.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-dic-19	17-mar-20	600,000.00	690,537.04	663,161.45	(27,375.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	17-dic-19	17-mar-20	230,000.00	244,348.32	230,413.25	(13,935.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-sep-19	17-mar-20	1,100,000.00	1,190,186.78	1,144,679.22	(45,507.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-sep-19	17-mar-20	3,600,000.00	3,896,018.88	3,746,222.89	(149,795.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-sep-19	17-mar-20	2,400,000.00	2,524,794.32	2,497,481.93	(27,312.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19-sep-19	17-mar-20	13,900,000.00	15,332,038.73	14,247,638.68	(1,084,400.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-dic-19	17-mar-20	900,000.00	1,028,403.94	994,742.18	(33,661.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	17-mar-20	2,200,000.00	2,352,656.72	2,338,804.87	(13,851.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	16-dic-19	17-mar-20	118,910.00	119,908.73	119,945.68	36.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	17-mar-20	1,400,000.00	1,507,723.59	1,488,330.37	(19,393.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-dic-19	17-mar-20	510,000.00	523,735.62	511,170.22	(12,565.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	18-dic-19	17-mar-20	309,231.00	320,443.68	312,092.04	(8,351.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-dic-19	17-mar-20	6,400,000.00	7,252,886.14	7,073,722.15	(179,163.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-dic-19	17-mar-20	38,100,000.00	40,255,478.16	39,656,155.92	(599,322.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-dic-19	17-mar-20	540,000.00	547,262.65	541,239.06	(6,023.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-sep-19	18-mar-20	2,700,000.00	2,913,814.64	2,809,521.34	(104,293.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-sep-19	18-mar-20	570,000.00	580,978.21	571,407.54	(9,570.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-sep-19	18-mar-20	4,200,000.00	4,483,807.03	4,370,366.53	(113,440.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-sep-19	18-mar-20	7,200,000.00	8,039,614.17	7,379,830.77	(659,783.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19-dic-19	18-mar-20	7,600,000.00	9,320,708.52	8,595,972.57	(724,735.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-dic-19	18-mar-20	560,000.00	585,617.13	560,984.47	(24,632.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-dic-19	18-mar-20	7,800,000.00	8,497,417.00	8,291,650.62	(205,766.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 31 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0124	26-dic-19	25-mar-20	92,600,000.00	96,228,808.80	94,541,014.46	(1,687,794.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	26-dic-19	25-mar-20	2,500,000.00	2,579,425.57	2,561,855.33	(17,570.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-sep-19	25-mar-20	2,100,000.00	2,230,177.20	2,184,389.13	(45,788.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-sep-19	25-mar-20	1,400,000.00	1,454,741.90	1,456,259.42	1,517.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-dic-19	26-mar-20	370,000.00	378,433.26	370,706.62	(7,726.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	800,000.00	884,640.54	850,035.25	(34,605.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	1,400,000.00	1,505,090.85	1,487,561.68	(17,529.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-dic-19	26-mar-20	9,900,000.00	10,485,433.69	10,297,299.52	(188,134.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-dic-19	26-mar-20	1,400,000.00	1,541,325.13	1,546,452.23	5,127.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	26-dic-19	26-mar-20	1,600,000.00	1,613,696.36	1,639,533.84	25,837.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	26-mar-20	1,700,000.00	1,929,511.02	1,877,834.85	(51,676.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	1,000,000.00	1,102,130.81	1,063,204.41	(38,926.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	900,000.00	921,395.19	956,883.97	35,488.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	27-dic-19	26-mar-20	200,000.00	205,813.68	200,585.77	(5,227.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	700,000.00	737,290.92	744,243.09	6,952.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	6,700,000.00	7,382,650.44	7,123,469.57	(259,180.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	26-mar-20	9,900,000.00	10,811,169.09	10,519,186.19	(291,982.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-dic-19	26-mar-20	9,000,000.00	9,527,349.63	9,361,181.38	(166,168.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	27-mar-20	7,200,000.00	7,554,596.47	7,490,402.93	(64,193.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-abr-19	27-mar-20	1,600,000.00	1,605,894.61	1,664,328.75	58,434.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	30-sep-19	27-mar-20	10,700,000.00	12,001,669.28	10,964,024.30	(1,037,644.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-sep-19	27-mar-20	570,000.00	580,373.76	571,064.19	(9,309.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-dic-19	27-mar-20	700,000.00	767,266.91	728,503.12	(38,763.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-sep-19	27-mar-20	25,700,000.00	27,321,734.15	26,736,577.12	(585,157.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-dic-19	30-mar-20	480,000.00	483,862.54	480,834.56	(3,027.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-sep-19	30-mar-20	9,000,000.00	9,699,776.00	9,359,235.77	(340,540.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	29-nov-19	30-mar-20	1,900,000.00	1,920,798.82	1,946,691.98	25,893.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	30-mar-20	700,000.00	782,738.88	773,020.61	(9,718.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-abr-19	30-mar-20	2,400,000.00	2,454,673.46	2,496,433.50	41,760.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	30-mar-20	3,600,000.00	3,792,489.16	3,744,650.25	(47,838.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	1-oct-19	30-mar-20	190,000.00	198,703.26	190,170.63	(8,532.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	30-mar-20	1,400,000.00	1,450,072.92	1,455,881.12	5,808.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-oct-19	30-mar-20	490,000.00	497,511.21	490,851.95	(6,659.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-oct-19	1-abr-20	1,100,000.00	1,160,882.87	1,144,215.65	(16,667.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	3-abr-20	8,900,000.00	9,554,766.88	9,256,857.76	(297,909.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-abr-19	3-abr-20	500,000.00	565,293.71	510,521.91	(54,771.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-oct-19	3-abr-20	450,000.00	456,180.16	450,993.41	(5,186.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-oct-19	3-abr-20	500,000.00	589,174.93	552,218.87	(36,956.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-oct-19	6-abr-20	490,000.00	492,363.99	490,895.70	(1,468.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-oct-19	6-abr-20	1,100,000.00	1,159,578.23	1,143,941.53	(15,636.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 32 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0524	9-oct-19	6-abr-20	27,200,000.00	30,889,347.14	28,914,873.85	(1,974,473.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-oct-19	6-abr-20	2,200,000.00	2,386,291.79	2,287,883.06	(98,408.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-oct-19	6-abr-20	1,600,000.00	1,693,161.54	1,663,914.95	(29,246.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-oct-19	6-abr-20	2,100,000.00	2,225,525.10	2,183,888.38	(41,636.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-nov-19	7-abr-20	5,400,000.00	6,049,002.21	5,619,357.37	(429,644.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-oct-19	7-abr-20	390,000.00	392,706.86	390,697.77	(2,009.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	10-oct-19	7-abr-20	24,800,000.00	28,476,939.47	26,634,851.72	(1,842,087.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-oct-19	8-abr-20	3,400,000.00	3,523,663.49	3,536,475.80	12,812.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	12-dic-19	8-abr-20	900,000.00	978,060.60	966,437.76	(11,622.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-oct-19	8-abr-20	700,000.00	811,009.58	743,530.56	(67,479.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-oct-19	8-abr-20	2,900,000.00	3,021,949.61	3,016,405.83	(5,543.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	10-abr-20	9,000,000.00	9,275,111.91	9,360,416.48	85,304.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	13-abr-20	2,400,000.00	2,511,773.38	2,495,034.76	(16,738.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-dic-19	13-abr-20	390,000.00	393,992.51	390,606.95	(3,385.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	13-abr-20	900,000.00	968,017.31	935,638.04	(32,379.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-19	13-abr-20	13,700,000.00	14,570,625.04	14,242,490.10	(328,134.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,530,967.54	360,494.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,530,967.54	360,494.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,530,967.54	360,494.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	14-oct-19	13-abr-20	600,000.00	675,351.25	637,141.88	(38,209.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-oct-19	14-abr-20	340,000.00	341,743.65	340,515.94	(1,227.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-19	14-abr-20	900,000.00	968,210.16	935,593.15	(32,617.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-oct-19	14-abr-20	530,000.00	533,093.88	530,804.26	(2,289.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	14-abr-20	3,700,000.00	3,862,317.25	3,846,327.39	(15,989.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-oct-19	14-abr-20	900,000.00	969,693.73	935,593.15	(34,100.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-oct-19	14-abr-20	520,000.00	524,360.54	520,789.09	(3,571.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-oct-19	15-abr-20	260,000.00	275,603.89	260,578.01	(15,025.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-oct-19	15-abr-20	3,600,000.00	3,886,697.01	3,742,193.03	(144,503.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	16-abr-20	8,200,000.00	8,716,440.72	8,523,475.10	(192,965.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-oct-19	16-abr-20	3,500,000.00	3,657,717.22	3,638,068.64	(19,648.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	16-abr-20	1,800,000.00	1,937,315.07	1,871,006.73	(66,308.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-oct-19	17-abr-20	900,000.00	967,453.10	935,458.47	(31,994.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	20-dic-19	17-abr-20	140,000.00	153,243.49	139,951.01	(13,292.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	17-abr-20	310,000.00	307,587.82	310,434.31	2,846.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	17-abr-20	1,400,000.00	1,527,964.94	1,455,157.62	(72,807.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-oct-19	20-abr-20	490,000.00	490,999.67	490,629.39	(370.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-oct-19	20-abr-20	4,600,000.00	4,825,992.68	4,780,543.66	(45,449.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	20-abr-20	270,000.00	278,466.29	270,557.54	(7,908.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	22-oct-19	21-abr-20	3,100,000.00	3,335,038.60	3,159,024.94	(176,013.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-oct-19	21-abr-20	5,500,000.00	5,797,229.96	5,715,592.97	(81,636.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 33 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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	23-oct-19	22-abr-20	2,100,000.00	2,220,009.17	2,182,212.52	(37,796.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-oct-19	22-abr-20	260,000.00	255,368.89	260,396.39	5,027.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	23-abr-19	22-abr-20	1,100,000.00	1,212,071.03	1,125,109.27	(86,961.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-nov-19	22-abr-20	5,000,000.00	5,541,916.72	5,199,937.05	(341,979.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-oct-19	23-abr-20	2,300,000.00	2,414,617.41	2,389,927.50	(24,689.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	23-oct-19	23-abr-20	900,000.00	986,528.77	955,202.49	(31,326.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-oct-19	24-abr-20	7,700,000.00	8,085,107.79	8,000,677.33	(84,430.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-oct-19	24-abr-20	2,100,000.00	2,300,339.34	2,316,275.06	15,935.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-oct-19	24-abr-20	700,000.00	773,128.88	772,091.69	(1,037.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	24-abr-20	1,300,000.00	1,442,683.28	1,433,884.56	(8,798.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-dic-19	24-abr-20	190,000.00	193,882.11	190,214.52	(3,667.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-oct-19	24-abr-20	1,800,000.00	1,879,950.08	1,870,288.21	(9,661.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-dic-19	24-abr-20	190,000.00	194,338.28	190,214.52	(4,123.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	30-oct-19	27-abr-20	800,000.00	832,641.02	815,053.07	(17,587.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-oct-19	28-abr-20	300,000.00	300,345.45	300,292.08	(53.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-oct-19	28-abr-20	1,900,000.00	2,017,576.17	1,973,813.73	(43,762.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-oct-19	29-abr-20	1,800,000.00	1,926,995.19	1,984,756.93	57,761.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-nov-19	29-abr-20	700,000.00	720,586.18	771,849.92	51,263.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	1-nov-19	30-abr-20	700,000.00	755,309.13	742,657.28	(12,651.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	1-nov-19	30-abr-20	1,800,000.00	1,890,805.71	1,909,690.14	18,884.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-oct-19	30-abr-20	1,900,000.00	1,923,171.28	1,973,624.00	50,452.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-nov-19	30-abr-20	4,600,000.00	4,817,283.59	4,778,247.59	(39,036.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	9-may-19	4-may-20	150,000.00	154,085.57	149,695.25	(4,390.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	4-may-20	500,000.00	500,016.08	500,370.17	354.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-may-20	900,000.00	963,880.98	934,694.75	(29,186.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-nov-19	5-may-20	480,000.00	487,644.97	480,336.69	(7,308.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	5-may-20	190,000.00	196,237.19	190,133.27	(6,103.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-nov-19	5-may-20	190,000.00	195,989.24	190,133.27	(5,855.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	5-may-20	2,700,000.00	2,887,836.59	2,803,949.39	(83,887.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-nov-19	5-may-20	2,700,000.00	2,890,840.70	2,803,949.39	(86,891.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-nov-19	5-may-20	800,000.00	816,197.60	830,799.82	14,602.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-nov-19	5-may-20	16,300,000.00	16,977,993.11	16,927,546.31	(50,446.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-nov-19	6-may-20	2,500,000.00	2,698,294.61	2,555,591.74	(142,702.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-may-20	14,700,000.00	15,063,000.48	15,270,769.28	207,768.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-may-20	4,600,000.00	4,804,192.33	4,776,869.19	(27,323.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-may-20	3,100,000.00	3,246,857.88	3,219,194.45	(27,663.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-19	6-may-20	2,200,000.00	2,309,086.63	2,284,589.61	(24,497.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-nov-19	8-may-20	160,000.00	156,796.43	160,151.82	3,355.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11-nov-19	8-may-20	900,000.00	996,496.17	991,818.75	(4,677.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	8-may-20	18,400,000.00	19,269,807.47	19,105,638.37	(164,169.10)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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	11-nov-19	8-may-20	25,300,000.00	26,495,985.29	26,270,252.76	(225,732.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	8-may-20	25,300,000.00	26,495,985.29	26,270,252.76	(225,732.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	8-may-20	2,100,000.00	2,177,887.97	2,180,534.81	2,646.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-nov-19	8-may-20	700,000.00	723,153.11	726,844.94	3,691.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-may-19	11-may-20	53,200,000.00	54,928,681.41	55,253,167.09	324,485.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	11-may-20	2,100,000.00	2,210,491.44	2,180,220.04	(30,271.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	12-dic-19	11-may-20	800,000.00	999,640.38	897,054.90	(102,585.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	11-may-20	13,800,000.00	14,443,855.92	14,327,160.25	(116,695.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	11-may-20	3,100,000.00	3,302,751.34	3,218,420.06	(84,331.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	11-may-20	2,800,000.00	2,873,340.20	2,906,960.05	33,619.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	11-may-20	240,000.00	244,864.06	240,112.33	(4,751.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	11-may-20	490,059.64	489,059.64	490,229.34	1,169.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	11-may-20	240,000.00	244,864.06	240,112.33	(4,751.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-nov-19	11-may-20	450,000.00	462,441.50	450,210.61	(12,230.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-nov-19	11-may-20	250,000.00	255,230.28	250,117.01	(5,113.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	11-may-20	490,059.64	489,059.64	490,229.34	1,169.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-nov-19	12-may-20	6,500,000.00	6,926,286.96	6,747,975.30	(178,311.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-nov-19	12-may-20	4,800,000.00	5,005,947.53	4,983,120.23	(22,827.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	14-may-20	4,600,000.00	5,207,039.38	4,724,526.73	(482,512.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	14-may-20	24,300,000.00	25,139,731.51	25,234,399.53	94,668.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	14-may-20	2,700,000.00	2,868,610.79	2,802,735.25	(65,875.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-nov-19	15-may-20	7,700,000.00	8,169,602.42	7,992,600.86	(177,001.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-may-19	15-may-20	480,000.00	485,309.09	480,149.93	(5,159.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	18-may-20	20,800,000.00	22,157,163.58	21,587,283.05	(569,880.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	24-may-19	18-may-20	5,200,000.00	6,311,635.91	5,579,729.74	(731,906.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	19-nov-19	18-may-20	38,400,000.00	44,021,146.50	40,979,356.20	(3,041,790.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	18-may-20	9,000,000.00	9,906,947.48	9,349,991.19	(556,956.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-nov-19	18-may-20	250,000.00	254,949.76	250,048.89	(4,900.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-nov-19	18-may-20	14,900,000.00	15,901,539.33	15,463,967.19	(437,572.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-nov-19	18-may-20	900,000.00	960,137.15	934,065.13	(26,072.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	19-may-20	11,000,000.00	11,870,280.23	11,415,801.66	(454,478.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	19-nov-19	19-may-20	6,300,000.00	6,830,225.36	6,423,872.30	(406,353.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-nov-19	19-may-20	240,000.00	244,220.40	240,037.59	(4,182.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	20-nov-19	19-may-20	320,000.00	339,894.73	318,946.99	(20,947.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	20-nov-19	19-may-20	250,000.00	267,821.26	249,177.34	(18,643.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-nov-19	20-may-20	530,000.00	538,947.17	530,062.38	(8,884.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-nov-19	20-may-20	13,500,000.00	14,323,669.37	14,009,627.06	(314,042.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-nov-19	21-may-20	9,500,000.00	10,075,996.74	9,858,151.43	(217,845.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-may-19	22-may-20	2,000,000.00	2,128,509.73	2,075,300.29	(53,209.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-may-19	22-may-20	800,000.00	883,290.40	880,842.26	(2,448.14)	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 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0921	25-nov-19	22-may-20	240,000.00	243,905.57	240,009.55	(3,896.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-nov-19	22-may-20	490,000.00	497,218.42	490,019.50	(7,198.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-nov-19	22-may-20	2,300,000.00	2,445,410.79	2,386,595.33	(58,815.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-nov-19	22-may-20	600,000.00	679,219.10	660,631.70	(18,587.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-nov-19	22-may-20	480,000.00	488,168.67	480,019.10	(8,149.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-nov-19	25-may-20	20,000,000.00	21,164,515.20	20,750,002.13	(414,513.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-may-19	25-may-20	480,000.00	487,591.04	479,963.01	(7,628.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-nov-19	25-may-20	2,300,000.00	2,392,775.91	2,386,250.25	(6,525.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	31-may-19	25-may-20	90,000.00	96,778.40	89,713.67	(7,064.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-nov-19	26-may-20	18,100,000.00	19,204,768.25	18,777,846.58	(426,921.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-nov-19	26-may-20	900,000.00	972,389.98	933,705.08	(38,684.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-nov-19	27-may-20	90,000.00	88,928.07	89,986.05	1,057.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-nov-19	27-may-20	1,100,000.00	1,147,955.74	1,141,140.07	(6,815.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	28-may-20	1,000,000.00	1,110,801.27	1,100,637.76	(10,163.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	28-may-20	1,000,000.00	1,110,801.27	1,100,637.76	(10,163.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	2-dic-19	29-may-20	5,222,415.68	5,222,415.68	4,807,209.57	(415,206.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	29-may-20	1,100,000.00	1,190,964.85	1,141,030.01	(49,934.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	29-may-20	18,900,000.00	20,008,120.11	19,604,970.15	(403,149.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	29-may-20	1,100,000.00	1,198,883.77	1,141,030.01	(57,853.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-dic-19	29-may-20	34,900,000.00	38,982,932.90	36,936,345.29	(2,046,587.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	1-jun-20	290,000.00	291,976.36	289,898.55	(2,077.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-jun-19	1-jun-20	1,100,000.00	1,223,374.79	1,210,924.67	(12,450.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-dic-19	1-jun-20	25,200,000.00	26,770,261.35	25,641,248.73	(1,129,012.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-dic-19	2-jun-20	1,400,000.00	1,536,846.02	1,479,741.76	(57,104.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-dic-19	2-jun-20	700,000.00	748,636.03	726,292.74	(22,343.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	3-jun-20	270,000.00	268,494.08	270,003.32	1,509.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-dic-19	3-jun-20	500,000.00	506,812.37	499,786.09	(7,026.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-jun-19	3-jun-20	140,000.00	143,512.53	139,546.60	(3,965.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-dic-19	3-jun-20	500,000.00	509,156.63	499,786.09	(9,370.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	3-jun-20	13,500,000.00	14,378,561.55	14,000,172.40	(378,389.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	3-jun-20	18,000,000.00	19,171,415.40	18,666,896.54	(504,518.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	9-dic-19	5-jun-20	600,000.00	668,988.92	634,048.09	(34,940.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	10-dic-19	5-jun-20	1,800,000.00	1,969,166.13	1,902,144.26	(67,021.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	5-jun-20	1,600,000.00	1,774,411.50	1,760,134.60	(14,276.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-dic-19	8-jun-20	20,700,000.00	22,028,032.31	21,461,750.08	(566,282.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-dic-19	8-jun-20	18,000,000.00	19,154,810.69	18,662,391.38	(492,419.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-dic-19	8-jun-20	800,000.00	828,459.70	829,439.62	979.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-dic-19	8-jun-20	450,000.00	455,035.28	449,719.75	(5,315.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-dic-19	8-jun-20	1,800,000.00	1,968,444.79	1,901,763.34	(66,681.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-dic-19	8-jun-20	7,600,000.00	8,124,512.86	7,879,676.36	(244,836.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 36 de 104

31 de diciembre de 2019

6. - 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
MH0322	10-dic-19	8-jun-20	67,100,000.00	71,830,904.69	68,257,379.48	(3,573,525.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-dic-19	8-jun-20	75,000,000.00	80,120,743.80	76,429,619.57	(3,691,124.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-dic-19	8-jun-20	1,400,000.00	1,471,909.08	1,479,149.26	7,240.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-dic-19	9-jun-20	2,300,000.00	2,489,466.54	2,384,523.74	(104,942.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-dic-19	9-jun-20	100,000.00	102,151.45	99,933.82	(2,217.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-dic-19	9-jun-20	3,600,000.00	3,868,727.74	3,732,298.03	(136,429.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	11-dic-19	9-jun-20	420,000.00	460,049.96	427,138.45	(32,911.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	9-jun-20	1,200,000.00	1,337,041.16	1,319,768.66	(17,272.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	9-jun-20	19,600,000.00	20,485,002.13	20,329,754.53	(155,247.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-dic-19	10-jun-20	380,000.00	389,449.04	379,733.70	(9,715.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	11-dic-19	10-jun-20	900,000.00	1,026,607.32	918,685.74	(107,921.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-dic-19	10-jun-20	600,000.00	676,010.86	659,842.79	(16,168.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-dic-19	10-jun-20	3,100,000.00	3,338,550.48	3,213,768.08	(124,782.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-dic-19	10-jun-20	500,000.00	585,386.55	518,349.69	(67,036.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-jun-20	1,300,000.00	1,403,910.09	1,373,128.87	(30,781.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-jun-20	1,400,000.00	1,468,972.15	1,478,754.17	9,782.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-dic-19	12-jun-20	800,000.00	904,877.36	879,679.60	(25,197.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-dic-19	12-jun-20	260,000.00	263,027.22	259,918.82	(3,108.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-dic-19	12-jun-20	380,000.00	389,239.78	379,704.05	(9,535.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-dic-19	12-jun-20	800,000.00	849,343.58	845,002.38	(4,341.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-dic-19	15-jun-20	480,000.00	485,416.32	479,569.97	(5,846.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	15-jun-20	7,500,000.00	7,819,496.48	7,777,129.28	(42,367.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	15-jun-20	480,000.00	479,293.03	479,569.97	276.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	15-jun-20	580,000.00	571,891.90	579,756.16	7,864.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	16-jun-20	300,000.00	304,351.43	299,863.05	(4,488.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	16-jun-20	1,100,000.00	1,184,932.58	1,161,567.79	(23,364.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	16-jun-20	1,100,000.00	1,176,065.19	1,161,567.79	(14,497.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0224	19-dic-19	16-jun-20	22,610,000.00	25,174,281.27	22,896,324.68	(2,277,956.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-dic-19	16-jun-20	2,900,000.00	3,054,290.28	3,005,556.76	(48,733.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-dic-19	16-jun-20	18,000,000.00	19,112,023.69	18,655,179.90	(456,843.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	17-dic-19	16-jun-20	24,600,000.00	26,813,081.09	25,063,004.57	(1,750,076.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	16-jun-20	270,000.00	269,088.69	269,876.75	788.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-dic-19	17-jun-20	2,000,000.00	2,145,231.04	2,111,800.28	(33,430.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-dic-19	17-jun-20	900,000.00	1,020,042.62	989,327.92	(30,714.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-19	17-jun-20	380,000.00	388,333.34	379,629.90	(8,703.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-dic-19	17-jun-20	230,000.00	228,860.01	229,775.99	915.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-dic-19	19-jun-20	6,700,000.00	7,158,565.56	6,942,865.54	(215,700.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	28-jun-19	22-jun-20	5,400,000.00	6,135,627.72	5,468,155.62	(667,472.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	23-jun-20	450,000.00	461,303.64	449,456.31	(11,847.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-dic-19	23-jun-20	45,300,000.00	51,716,187.63	47,871,960.48	(3,844,227.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 37 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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	26-dic-19	23-jun-20	600,000.00	622,208.68	659,302.56	37,093.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-dic-19	23-jun-20	900,000.00	999,049.69	988,953.85	(10,095.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	24-jun-20	5,500,000.00	6,297,486.39	5,811,923.13	(485,563.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	27-dic-19	24-jun-20	450,000.00	475,369.21	449,761.53	(25,607.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	24-jun-20	23,500,000.00	26,593,080.38	24,832,762.46	(1,760,317.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-dic-19	24-jun-20	1,800,000.00	2,046,847.82	1,977,782.98	(69,064.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-dic-19	24-jun-20	1,200,000.00	1,330,120.04	1,266,487.23	(63,632.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-dic-19	25-jun-20	250,000.00	253,139.91	249,804.69	(3,335.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-dic-19	26-jun-20	3,400,000.00	3,845,734.55	3,735,341.12	(110,393.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-dic-19	29-jun-20	240,000.00	241,484.50	239,179.94	(2,304.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	30-dic-19	29-jun-20	9,400,000.00	10,156,945.85	9,535,835.12	(621,110.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-jul-19	1-jul-20	400,000.00	480,241.58	438,431.36	(41,810.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-jul-19	2-jul-20	400,000.00	475,286.62	438,398.82	(36,887.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jul-19	2-jul-20	700,000.00	795,966.38	767,603.74	(28,362.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	8-jul-19	2-jul-20	170,000.00	167,111.72	168,855.14	1,743.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	5-jul-19	6-jul-20	370,000.00	423,767.12	363,364.12	(60,403.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	5-jul-19	7-jul-20	250,000.00	285,751.85	245,501.39	(40,250.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jul-19	20-jul-20	5,200,000.00	5,630,421.56	5,355,372.40	(275,049.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-oct-19	20-jul-20	8,200,000.00	8,660,389.28	8,445,010.33	(215,378.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-jul-19	24-jul-20	9,000,000.00	9,799,680.92	9,266,249.17	(533,431.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-ago-19	27-jul-20	2,600,000.00	2,859,043.33	2,676,339.01	(182,704.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	5-ago-19	30-jul-20	900,000.00	1,032,770.57	911,305.52	(121,465.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-ago-19	31-jul-20	900,000.00	1,087,858.66	984,272.84	(103,585.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ago-19	3-ago-20	5,400,000.00	5,913,886.87	5,555,751.42	(358,135.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-ago-19	13-ago-20	3,300,000.00	3,596,894.30	3,392,737.12	(204,157.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-ago-19	13-ago-20	240,000.00	241,861.87	238,795.66	(3,066.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-ago-19	14-ago-20	490,000.00	494,257.02	487,197.87	(7,059.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ago-19	17-ago-20	7,200,000.00	7,790,197.70	7,400,201.71	(389,995.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-ago-19	20-ago-20	350,000.00	341,935.24	348,128.28	6,193.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-ago-19	20-ago-20	340,000.00	346,038.68	337,953.42	(8,085.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-ago-19	24-ago-20	280,000.00	283,475.54	278,258.43	(5,217.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ago-19	28-ago-20	2,100,000.00	2,176,122.50	2,158,141.28	(17,981.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-ago-19	28-ago-20	550,000.00	564,336.42	546,468.74	(17,867.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-sep-19	7-sep-20	1,800,000.00	1,932,810.98	1,847,248.31	(85,562.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-sep-19	7-sep-20	520,000.00	515,450.67	516,778.11	1,327.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-sep-19	9-sep-20	130,000.00	134,011.48	129,087.07	(4,924.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-sep-19	10-sep-20	1,300,000.00	1,409,932.36	1,361,109.27	(48,823.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-sep-19	16-sep-20	900,000.00	1,044,262.94	977,607.28	(66,655.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-sep-19	16-sep-20	430,000.00	442,962.29	425,548.41	(17,413.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-sep-19	18-sep-20	1,900,000.00	2,084,402.77	1,948,322.86	(136,079.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 38 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6. - 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
BC0921	27-sep-19	21-sep-20	490,000.00	496,680.95	484,776.20	(11,904.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	25-sep-20	2,500,000.00	2,526,456.15	2,564,237.11	37,780.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-oct-19	28-sep-20	230,000.00	234,556.62	227,448.72	(7,107.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-oct-19	28-sep-20	250,000.00	249,992.03	247,414.38	(2,577.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-oct-19	28-sep-20	2,400,000.00	2,446,921.42	2,461,155.32	14,233.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	1-oct-20	1,300,000.00	1,397,909.14	1,331,808.74	(66,100.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	1-oct-20	620,000.00	607,748.87	613,478.36	5,729.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-oct-19	5-oct-20	1,800,000.00	1,915,773.53	1,843,508.32	(72,265.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-oct-19	5-oct-20	10,000,000.00	10,583,696.98	10,241,712.88	(341,984.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-oct-19	9-oct-20	500,000.00	561,616.03	522,740.05	(38,875.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-oct-19	12-oct-20	4,600,000.00	4,792,761.05	4,708,796.74	(83,964.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-19	15-oct-20	4,700,000.00	4,907,111.16	4,810,114.59	(96,996.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	20-oct-20	480,000.00	475,758.49	474,023.88	(1,734.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	26-oct-20	550,000.00	552,749.08	542,948.57	(9,800.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-oct-19	27-oct-20	1,300,000.00	1,406,096.69	1,407,014.68	917.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	6-nov-20	252,800.00	252,800.25	246,624.91	(6,175.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-nov-19	6-nov-20	11,100,000.00	12,044,707.64	11,596,066.42	(448,641.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-nov-19	11-nov-20	900,000.00	1,004,433.55	972,797.99	(31,635.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	12-nov-20	1,200,000.00	1,239,926.82	1,225,617.08	(14,309.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	13-nov-20	310,000.00	298,768.79	305,955.22	7,186.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-nov-19	13-nov-20	380,000.00	389,802.32	374,705.45	(15,096.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-nov-19	18-nov-20	900,000.00	1,005,715.44	972,196.19	(33,519.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	18-nov-20	6,300,000.00	6,639,613.39	6,431,678.22	(207,935.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20-nov-19	19-nov-20	1,500,000.00	1,643,606.48	1,505,318.65	(138,287.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-nov-19	27-nov-20	280,000.00	286,075.57	275,856.35	(10,219.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-dic-19	27-nov-20	1,500,000.00	1,557,440.00	1,555,760.92	(1,679.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-dic-19	1-dic-20	500,000.00	504,324.18	492,476.89	(11,847.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	3-dic-19	2-dic-20	90,000.00	97,768.27	88,076.43	(9,691.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-dic-19	9-dic-20	700,000.00	762,137.20	754,747.72	(7,389.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	10-dic-19	9-dic-20	1,300,000.00	1,363,921.92	1,345,587.81	(18,334.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-19	11-dic-20	25,300,000.00	26,730,206.37	25,785,497.11	(944,709.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-19	14-dic-20	510,000.00	513,286.94	501,916.10	(11,370.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-dic-19	14-dic-20	19,700,000.00	21,615,913.99	19,792,789.78	(1,823,124.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	20-dic-19	14-dic-20	130,000.00	131,030.10	127,099.64	(3,930.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-dic-19	15-dic-20	140,000.00	140,347.50	137,772.22	(2,575.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	16-dic-19	15-dic-20	100,000.00	106,103.44	97,761.14	(8,342.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-dic-19	16-dic-20	700,000.00	695,929.17	724,791.39	28,862.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	21-dic-20	480,000.00	481,498.43	472,183.58	(9,314.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	27-dic-19	23-dic-20	250,000.00	248,008.84	244,494.77	(3,514.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	10-oct-19	29-sep-21	90,000.00	84,846.83	85,371.81	524.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			7,618,201,556.00	8,170,245,558.27	7,986,648,928.94	(183,596,629.34)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 39 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- Contratos de compra forward (continuación)

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
B00327	30-oct-19	2-ene-20	17,000.00	18,117.68	18,627.50	509.82	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	3-ene-20	78,000.00	84,432.03	85,467.33	1,035.30	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	7-ene-20	8,000.00	8,883.55	8,761.56	(121.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-nov-19	7-ene-20	47,000.00	51,400.31	51,475.68	75.37	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-nov-19	7-ene-20	70,000.00	78,853.94	76,663.62	(2,190.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	7-ene-20	70,000.00	76,300.18	76,663.62	363.44	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	7-ene-20	6,000.00	7,012.47	6,571.36	(441.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	7-ene-20	24,000.00	26,537.68	26,284.67	(253.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-dic-19	7-ene-20	9,000.00	9,845.54	9,856.75	11.21	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-jul-19	7-ene-20	9,000.00	9,697.20	9,856.75	159.55	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	8-ene-20	24,000.00	26,649.03	26,282.82	(366.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	8-ene-20	11,000.00	12,542.34	12,046.70	(495.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-dic-19	8-ene-20	263,000.00	295,519.45	288,015.88	(7,503.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	10-dic-19	9-ene-20	8,000.00	8,853.24	8,760.66	(92.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	9-ene-20	25,000.00	27,610.04	27,376.01	(234.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	9-ene-20	6,000.00	6,607.53	6,570.49	(37.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-dic-19	9-ene-20	50,000.00	56,197.37	54,752.01	(1,445.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-ene-19	9-ene-20	356,000.00	407,223.94	389,849.21	(17,374.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	10-jul-19	9-ene-20	287,000.00	311,551.71	314,276.54	2,724.83	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4727	23-dic-19	10-ene-20	1,360,451.00	1,490,253.81	1,423,188.72	(67,065.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	22-oct-19	10-ene-20	100,000.00	108,213.40	109,496.30	1,282.90	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	10-ene-20	75,000.00	83,761.02	82,122.23	(1,638.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	10-ene-20	8,000.00	8,972.39	8,759.70	(212.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-dic-19	10-ene-20	26,000.00	29,540.66	28,469.04	(1,071.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-nov-19	10-ene-20	18,000.00	19,870.69	19,709.33	(161.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-nov-19	10-ene-20	9,000.00	9,916.51	9,854.67	(61.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-jul-19	10-ene-20	44,000.00	48,547.49	48,178.37	(369.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	14-oct-19	13-ene-20	472,666.67	496,892.77	491,392.10	(5,500.68)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	28-nov-19	13-ene-20	176,000.00	196,842.55	192,672.72	(4,169.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-oct-19	13-ene-20	9,000.00	10,089.41	9,852.58	(236.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-dic-19	14-ene-20	9,000.00	9,835.22	9,851.89	16.67	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-dic-19	14-ene-20	21,000.00	23,608.99	22,987.74	(621.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	18-dic-19	15-ene-20	57,000.00	64,053.05	62,390.89	(1,662.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-sep-19	15-ene-20	254,000.00	275,269.89	278,022.55	2,752.66	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-jul-19	15-ene-20	45,000.00	48,525.47	49,255.96	730.49	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-dic-19	16-ene-20	15,000.00	17,148.72	16,418.61	(730.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-dic-19	16-ene-20	174,000.00	194,517.78	190,455.91	(4,061.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	16-dic-19	16-ene-20	9,000.00	9,878.44	9,850.50	(27.94)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	18-oct-19	16-ene-20	87,000.00	94,363.26	95,221.48	858.22	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	18-oct-19	16-ene-20	31,000.00	33,737.78	33,929.49	191.71	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	18-oct-19	16-ene-20	66,000.00	71,099.06	72,236.98	1,137.92	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-dic-19	17-ene-20	35,000.00	39,443.29	38,304.79	(1,138.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-nov-19	17-ene-20	15,000.00	17,027.71	16,416.34	(611.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	21-oct-19	17-ene-20	92,000.00	99,688.90	100,686.88	997.98	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	22-jul-19	17-ene-20	75,000.00	82,475.90	82,081.69	(394.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-dic-19	20-ene-20	18,000.00	19,750.17	19,695.44	(54.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 40 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- 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
B00327	21-nov-19	20-ene-20	255,000.00	285,663.72	279,018.69	(6,645.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	6-dic-19	20-ene-20	476,666.67	495,016.35	495,144.66	128.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-dic-19	20-ene-20	28,000.00	31,765.92	30,639.95	(1,125.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-jul-19	22-ene-20	113,000.00	121,250.05	123,626.13	2,376.08	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-jul-19	22-ene-20	12,000.00	12,587.24	13,128.44	541.20	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-dic-19	22-ene-20	9,000.00	10,032.45	9,846.33	(186.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	21-nov-19	22-ene-20	45,000.00	50,292.31	49,231.64	(1,060.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-dic-19	22-ene-20	26,000.00	29,510.94	28,447.61	(1,063.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	22-nov-19	23-ene-20	9,000.00	10,147.44	9,845.63	(301.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-oct-19	23-ene-20	46,000.00	49,319.50	50,322.13	1,002.63	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-nov-19	24-ene-20	22,000.00	25,219.24	24,065.41	(1,153.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-dic-19	27-ene-20	17,000.00	18,801.13	18,592.06	(209.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-nov-19	27-ene-20	40,000.00	44,329.49	43,746.02	(583.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-nov-19	27-ene-20	51,000.00	57,334.05	55,776.17	(1,557.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-nov-19	27-ene-20	276,000.00	308,724.87	301,847.52	(6,877.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-nov-19	27-ene-20	88,000.00	98,452.07	96,241.24	(2,210.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-oct-19	27-ene-20	106,000.00	115,623.09	115,926.95	303.86	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	28-nov-19	27-ene-20	57,000.00	64,078.53	62,338.08	(1,740.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	28-nov-19	27-ene-20	32,000.00	35,629.95	34,996.81	(633.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-nov-19	28-ene-20	26,000.00	29,030.61	28,432.90	(597.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-oct-19	28-ene-20	10,000.00	10,413.83	10,935.73	521.90	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-oct-19	29-ene-20	20,000.00	21,635.26	21,869.92	234.66	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	31-oct-19	29-ene-20	9,000.00	9,857.97	9,841.46	(16.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-dic-19	29-ene-20	125,000.00	139,611.13	136,687.00	(2,924.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	2-ago-19	29-ene-20	12,000.00	12,967.61	13,121.95	154.34	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	1-nov-19	30-ene-20	48,000.00	52,023.36	52,484.10	460.74	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	1-nov-19	30-ene-20	49,000.00	52,731.99	53,577.52	845.53	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-oct-19	30-ene-20	8,000.00	9,012.48	8,748.47	(264.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	31-oct-19	31-ene-20	34,000.00	36,309.33	37,181.95	872.62	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-ago-19	31-ene-20	41,000.00	44,563.27	44,837.05	273.78	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-ago-19	31-ene-20	18,000.00	20,035.43	19,684.56	(350.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-ago-19	3-feb-20	56,000.00	60,189.30	61,229.21	1,039.91	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	2-ago-19	3-feb-20	39,000.00	42,124.01	42,641.77	517.76	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	3-feb-20	141,000.00	152,516.48	154,188.73	1,672.26	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	3-feb-20	91,000.00	98,542.60	99,497.46	954.86	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-ago-19	3-feb-20	78,000.00	84,853.84	85,283.54	429.70	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	4-feb-20	179,000.00	193,738.38	195,702.38	1,964.00	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	4-feb-20	111,000.00	121,093.52	121,357.34	263.82	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	8-ago-19	4-feb-20	45,000.00	48,377.56	49,198.92	821.36	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	5-feb-20	94,000.00	104,764.49	102,764.57	(1,999.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	5-feb-20	39,000.00	41,885.27	42,636.36	751.09	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	5-feb-20	10,000.00	10,338.17	10,932.40	594.23	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-nov-19	5-feb-20	9,000.00	10,049.96	9,839.16	(210.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-ago-19	5-feb-20	12,000.00	12,881.24	13,118.88	237.64	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-ago-19	5-feb-20	27,000.00	29,115.77	29,517.48	401.71	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-nov-19	6-feb-20	9,000.00	10,012.27	9,838.54	(173.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 41 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- 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
B00327	6-nov-19	6-feb-20	8,000.00	8,946.94	8,745.37	(201.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	6-feb-20	27,000.00	29,766.40	29,515.61	(250.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-ago-19	7-feb-20	18,000.00	19,906.76	19,675.83	(230.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	7-feb-20	10,000.00	10,954.75	10,931.01	(23.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	7-feb-20	23,000.00	25,838.00	25,141.33	(696.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-nov-19	10-feb-20	74,000.00	82,358.10	80,874.12	(1,483.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	10-feb-20	21,000.00	23,065.84	22,950.76	(115.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-ago-19	10-feb-20	27,000.00	29,581.90	29,508.12	(73.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-ago-19	10-feb-20	11,000.00	11,866.39	12,021.83	155.44	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-ago-19	10-feb-20	61,000.00	67,865.16	66,666.50	(1,198.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-ago-19	10-feb-20	220,000.00	245,818.95	240,436.57	(5,382.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-nov-19	10-feb-20	53,000.00	59,161.99	57,923.35	(1,238.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-dic-19	11-feb-20	63,000.00	70,518.25	68,847.92	(1,670.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	11-feb-20	35,000.00	39,727.67	38,248.85	(1,478.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-nov-19	11-feb-20	182,000.00	203,915.81	198,894.00	(5,021.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-dic-19	11-feb-20	9,000.00	10,095.88	9,837.18	(258.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-dic-19	11-feb-20	9,000.00	10,095.88	9,837.18	(258.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	11-feb-20	42,000.00	46,503.65	45,898.61	(605.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-nov-19	11-feb-20	9,000.00	9,857.60	9,835.42	(22.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-dic-19	12-feb-20	27,000.00	29,756.76	29,504.38	(252.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-nov-19	12-feb-20	9,000.00	10,015.13	9,834.79	(180.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	12-feb-20	131,000.00	146,655.90	143,150.88	(3,505.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-nov-19	13-feb-20	20,000.00	21,850.16	21,853.71	3.55	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-nov-19	13-feb-20	55,000.00	62,010.45	60,097.70	(1,912.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-ago-19	14-feb-20	13,000.00	14,536.46	14,204.01	(332.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-ago-19	14-feb-20	23,000.00	25,869.01	25,130.17	(738.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-dic-19	17-feb-20	35,000.00	39,267.31	38,234.29	(1,033.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-ago-19	17-feb-20	10,000.00	11,011.48	10,924.08	(87.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-nov-19	18-feb-20	5,000.00	5,477.29	5,461.69	(15.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-nov-19	18-feb-20	15,000.00	16,728.43	16,385.08	(343.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	18-dic-19	18-feb-20	9,000.00	9,860.48	9,831.05	(29.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-ago-19	19-feb-20	18,000.00	20,043.43	19,660.85	(382.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-ago-19	19-feb-20	18,000.00	19,387.33	19,660.85	273.52	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-ago-19	19-feb-20	71,000.00	78,490.54	77,551.14	(939.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	21-nov-19	19-feb-20	18,000.00	19,910.43	19,660.85	(249.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-nov-19	19-feb-20	59,000.00	65,725.78	64,443.90	(1,281.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-nov-19	19-feb-20	57,000.00	63,435.54	62,259.36	(1,176.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	22-nov-19	20-feb-20	248,666.67	257,678.01	257,514.94	(163.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	22-nov-19	20-feb-20	18,000.00	19,802.14	19,659.60	(142.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-ago-19	20-feb-20	9,000.00	9,668.27	9,829.80	161.53	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-nov-19	25-feb-20	92,000.00	103,113.22	100,450.53	(2,662.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-nov-19	25-feb-20	176,000.00	196,858.55	192,212.23	(4,646.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	27-nov-19	25-feb-20	289,333.33	299,487.43	299,463.44	(23.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	25-feb-20	11,000.00	12,078.51	12,010.39	(68.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	25-feb-20	18,000.00	20,249.25	19,658.07	(591.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-ago-19	26-feb-20	31,000.00	33,979.11	33,845.31	(133.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 42 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- 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
B00327	30-ago-19	26-feb-20	67,000.00	72,351.64	73,149.54	797.90	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-ago-19	26-feb-20	31,000.00	34,270.31	33,845.31	(425.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-dic-19	26-feb-20	27,000.00	29,910.99	29,478.17	(432.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-nov-19	28-feb-20	35,000.00	38,653.12	38,207.59	(445.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-dic-19	28-feb-20	18,000.00	19,587.68	19,649.62	61.94	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	3-sep-19	2-mar-20	102,000.00	110,332.73	111,292.83	960.10	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	3-sep-19	2-mar-20	102,000.00	110,332.73	111,292.83	960.10	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	3-sep-19	2-mar-20	102,000.00	110,324.12	111,292.83	968.71	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	4-sep-19	2-mar-20	243,000.00	263,259.50	265,138.81	1,879.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-sep-19	4-mar-20	32,000.00	34,652.01	34,910.62	258.61	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-dic-19	4-mar-20	20,000.00	22,368.70	21,819.14	(549.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-dic-19	10-mar-20	40,000.00	45,665.06	43,626.34	(2,038.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	10-mar-20	63,000.00	70,058.20	68,691.43	(1,366.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	10-mar-20	91,000.00	101,509.84	99,220.96	(2,288.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-sep-19	11-mar-20	46,000.00	49,451.05	50,152.10	701.05	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	16-sep-19	16-mar-20	23,000.00	25,113.60	25,067.19	(46.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-sep-19	16-mar-20	11,000.00	11,844.41	11,988.65	144.24	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-sep-19	18-mar-20	137,000.00	148,012.63	149,292.11	1,279.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-dic-19	18-mar-20	16,000.00	17,507.88	17,435.57	(72.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-sep-19	18-mar-20	274,000.00	304,222.76	298,681.45	(5,541.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-dic-19	19-mar-20	9,000.00	10,051.64	9,810.05	(241.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-dic-19	19-mar-20	13,000.00	15,058.93	14,170.07	(888.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-oct-19	20-mar-20	18,000.00	19,699.03	19,612.25	(86.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-sep-19	20-mar-20	137,000.00	148,138.16	149,270.98	1,132.82	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-dic-19	25-mar-20	31,000.00	34,438.80	33,764.70	(674.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00521	26-dic-19	25-mar-20	492,666.67	503,980.61	507,970.52	3,989.91	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-dic-19	26-mar-20	20,000.00	22,307.15	21,782.13	(525.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-dic-19	30-mar-20	45,000.00	50,177.10	49,014.36	(1,162.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-oct-19	6-abr-20	37,000.00	40,406.08	40,308.43	(97.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	10-oct-19	7-abr-20	69,000.00	74,919.62	75,165.29	245.67	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	11-oct-19	8-abr-20	81,000.00	87,299.64	88,232.23	932.59	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-oct-19	13-abr-20	17,000.00	17,961.26	18,512.34	551.08	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-oct-19	14-abr-20	127,000.00	137,716.89	138,289.76	572.87	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-oct-19	22-abr-20	7,000.00	7,356.89	7,618.62	261.73	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-ago-19	22-abr-20	6,000.00	6,600.17	6,533.34	(66.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-oct-19	22-abr-20	64,000.00	68,702.20	69,655.95	953.75	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-oct-19	23-abr-20	9,000.00	9,833.73	9,794.78	(38.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-oct-19	24-abr-20	71,000.00	76,917.46	77,265.32	347.86	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	28-oct-19	24-abr-20	130,000.00	140,124.91	141,471.71	1,346.80	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-oct-19	27-abr-20	93,000.00	99,805.78	101,188.50	1,382.72	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-oct-19	27-abr-20	39,000.00	42,537.81	42,433.89	(103.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-oct-19	28-abr-20	109,000.00	117,716.09	118,590.16	874.07	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	30-oct-19	30-abr-20	5,000.00	5,918.69	5,439.26	(479.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-nov-19	4-may-20	46,000.00	51,278.22	50,029.23	(1,248.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	5-may-20	39,000.00	41,779.25	42,413.54	634.29	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	7-nov-19	5-may-20	114,000.00	126,745.46	123,978.05	(2,767.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	6-nov-19	6-may-20	13,000.00	13,636.84	14,137.00	500.16	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 43 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- 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
B00327	8-nov-19	6-may-20	11,000.00	12,418.74	11,962.08	(456.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-nov-19	11-may-20	45,000.00	49,682.31	48,921.10	(761.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	11-may-20	21,000.00	23,398.38	22,829.85	(568.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	11-may-20	63,000.00	69,741.50	68,489.54	(1,251.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-nov-19	18-may-20	33,000.00	36,854.13	35,860.41	(993.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	21-nov-19	19-may-20	135,000.00	150,524.92	146,692.88	(3,832.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	22-may-20	89,000.00	99,760.42	96,691.23	(3,069.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	28-nov-19	26-may-20	35,000.00	39,171.51	38,015.51	(1,156.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	4-dic-19	2-jun-20	26,000.00	29,439.98	28,228.22	(1,211.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-dic-19	2-jun-20	31,000.00	34,168.86	33,656.73	(512.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-dic-19	8-jun-20	101,000.00	112,716.65	109,616.27	(3,100.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	17-dic-19	15-jun-20	27,000.00	30,224.05	29,291.03	(933.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-dic-19	17-jun-20	19,000.00	20,527.19	20,609.73	82.54	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-dic-19	23-jun-20	49,000.00	54,436.39	53,132.23	(1,304.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-dic-19	24-jun-20	176,000.00	195,294.34	190,830.80	(4,463.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	4-jul-19	26-jun-20	20,000.00	23,295.72	21,699.07	(1,596.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	2-jul-19	1-jul-20	11,000.00	12,302.38	11,931.09	(371.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-ago-19	22-jul-20	9,000.00	10,112.94	9,758.80	(354.15)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-ago-19	3-ago-20	18,000.00	19,483.82	19,487.55	3.73	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-ago-19	4-ago-20	122,000.00	131,693.41	132,074.90	381.49	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-ago-19	11-ago-20	142,000.00	152,921.49	153,666.17	744.68	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-ago-19	12-ago-20	24,000.00	26,145.65	25,970.29	(175.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	14-ago-19	13-ago-20	35,000.00	39,303.53	37,871.21	(1,432.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	21-ago-19	14-ago-20	11,000.00	11,487.87	11,901.71	413.84	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-ago-19	14-ago-20	13,000.00	14,407.47	14,065.66	(341.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-ago-19	21-ago-20	135,000.00	145,670.85	146,009.10	338.25	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	2-sep-19	27-ago-20	80,000.00	86,214.28	86,494.76	280.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	29-ago-19	28-ago-20	6,000.00	6,618.50	6,486.74	(131.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	3-sep-19	3-sep-20	50,000.00	53,501.66	54,037.97	536.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-sep-19	3-sep-20	47,000.00	51,030.17	50,795.69	(234.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	10-sep-19	4-sep-20	27,000.00	29,460.02	29,178.86	(281.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	9-sep-19	8-sep-20	133,000.00	142,814.76	143,603.68	788.92	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	16-sep-19	10-sep-20	38,000.00	41,096.02	41,024.79	(71.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-sep-19	11-sep-20	37,000.00	39,233.32	39,942.83	709.51	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-sep-19	18-sep-20	91,000.00	97,930.59	98,197.24	266.65	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	23-sep-19	22-sep-20	14,000.00	15,249.33	15,103.70	(145.63)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-sep-19	25-sep-20	91,000.00	97,965.62	98,156.70	191.08	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	1-oct-19	30-sep-20	28,000.00	30,184.61	30,193.15	8.54	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	15-oct-19	9-oct-20	55,000.00	58,770.98	59,276.47	505.49	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	27-dic-19	9-oct-20	109,000.00	119,856.12	117,475.18	(2,380.94)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-dic-19	9-oct-20	18,000.00	20,025.82	19,399.57	(626.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	22-oct-19	21-oct-20	18,000.00	19,680.84	19,385.82	(295.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	5-nov-19	5-nov-20	9,000.00	9,830.90	9,684.31	(146.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	12-nov-19	11-nov-20	45,000.00	49,896.00	48,404.38	(1,491.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	24-nov-20	53,000.00	58,872.69	56,965.72	(1,906.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	25-nov-19	25-nov-20	102,000.00	113,232.55	109,625.64	(3,606.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-dic-19	7-dic-20	94,000.00	103,350.56	100,955.70	(2,394.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 44 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

6.- 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
B00327	19-dic-19	18-dic-20	45,000.00	49,283.63	48,298.32	(985.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	19-dic-19	18-dic-20	49,000.00	53,387.09	52,591.50	(795.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	20-dic-19	21-dic-20	7,000.00	7,885.54	7,511.73	(373.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	26-dic-19	28-dic-20	9,000.00	9,669.43	9,686.14	16.71	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	8-nov-19	28-oct-21	229,000.00	251,039.65	241,777.81	(9,261.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00327	13-nov-19	2-nov-21	45,000.00	49,393.85	47,497.33	(1,896.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
			16,357,451.01	17,869,601.71	17,657,576.06	212,025.65		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2019 fue de DOP52.9601 por USD1.00.

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
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 Negociación
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 Negociación
B00126	4-dic-19	2-mar-20	4,800,000.00	5,166,653.87	5,188,565.55	21,911.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00222	23-dic-19	22-ene-20	30,300,000.00	37,195,631.25	37,341,609.21	145,977.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			35,100,000.00	42,362,285.12	42,530,174.76	167,889.64		

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
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 45 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

7. 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
MH0332	27-dic-19	10-ene-20	50,000,000.00	56,057,828.50	55,512,259.93	545,568.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
GS0529	8-nov-19	13-ene-20	18,722.00	20,054.59	18,974.49	1,080.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	13-ene-20	1,000,000.00	1,025,173.16	1,044,146.09	(18,972.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-oct-19	16-ene-20	320,000.00	325,500.92	321,593.72	3,907.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-oct-19	17-ene-20	430,000.00	434,659.69	432,125.55	2,534.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-dic-19	20-ene-20	7,300,000.00	7,966,971.75	7,618,001.17	348,970.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-dic-19	22-ene-20	230,000.00	235,201.46	231,094.11	4,107.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	23-dic-19	22-ene-20	30,300,000.00	34,789,520.70	34,598,697.28	190,823.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	6-nov-19	22-ene-20	23,000,000.00	23,682,203.00	23,524,848.39	157,354.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0320	1-nov-19	29-ene-20	38,610,000.00	38,881,746.13	38,768,031.76	113,714.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	1-nov-19	29-ene-20	37,800,000.00	38,593,575.67	38,484,338.23	109,237.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-sep-19	31-ene-20	4,300,000.00	4,728,508.90	4,484,877.81	243,631.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	31-ene-20	2,700,000.00	2,999,563.21	2,816,086.06	183,477.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-dic-19	3-feb-20	22,900,000.00	24,314,083.03	23,880,656.69	433,426.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	21-nov-19	4-feb-20	1,000,000.00	1,098,706.98	1,065,530.32	33,176.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-dic-19	7-feb-20	3,700,000.00	4,105,545.13	3,857,601.13	247,944.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-sep-19	17-feb-20	1,400,000.00	1,634,799.58	1,551,050.77	83,748.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-sep-19	17-feb-20	470,000.00	474,950.20	471,849.97	3,100.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	26-dic-19	20-feb-20	460,000.00	487,467.79	470,465.70	17,002.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	26-feb-20	900,000.00	997,640.18	937,358.41	60,281.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	2-mar-20	3,400,000.00	3,649,765.60	3,542,397.95	107,367.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-19	2-mar-20	4,800,000.00	5,098,194.85	5,001,032.40	97,162.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-dic-19	18-mar-20	2,700,000.00	2,913,816.59	2,811,071.05	102,745.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	23-mar-20	260,000.00	271,571.47	260,680.60	10,890.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	30-mar-20	700,000.00	782,737.73	773,507.34	9,230.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-dic-19	14-abr-20	530,000.00	533,093.80	531,195.01	1,898.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-nov-19	20-abr-20	4,600,000.00	4,825,992.77	4,784,331.14	41,661.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11-dic-19	8-may-20	900,000.00	996,495.11	992,724.21	3,770.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	27-may-19	18-may-20	5,200,000.00	6,311,582.25	5,579,729.74	731,852.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	16-dic-19	12-jun-20	1,400,000.00	1,468,971.83	1,480,454.89	(11,483.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-ago-19	17-ago-20	7,200,000.00	7,790,190.78	7,412,137.98	378,052.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-dic-19	5-oct-20	10,000,000.00	10,583,692.47	10,262,035.33	321,657.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			268,528,722.00	288,079,805.82	283,520,885.21	4,558,920.61		

b) 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
BO0327	18-dic-19	10-ene-20	75,000.00	83,764.38	82,125.71	1,638.67	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-dic-19	10-ene-20	100,000.00	108,219.10	109,500.95	(1,281.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	16-oct-19	29-ene-20	12,000.00	12,967.62	13,123.57	(155.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	16-dic-19	5-mar-20	1,284,000.00	1,341,525.41	1,346,525.22	(4,999.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-nov-19	11-nov-20	45,000.00	49,894.61	48,468.76	1,425.85	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,516,000.00	1,596,371.12	1,599,744.21	(3,373.10)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 46 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

7. Contratos de venta forward (continuación):

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha 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

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
N/A	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 Negociación
BO0126	7-Jan-19	7-Jan-20	1,200,000.00	1,196,213.74	1,241,007.12	(44,793.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Jan-19	8-Jan-20	3,700,000.00	3,765,396.26	3,903,137.70	(137,741.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Jan-19	13-Jan-20	1,100,000.00	1,128,931.96	1,169,469.54	(40,537.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jan-19	13-Jan-20	700,000.00	773,834.51	800,215.20	(26,380.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Jan-19	23-Jan-20	500,000.00	477,917.08	494,725.58	(16,808.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Jan-19	24-Jan-20	50,800,000.00	50,353,176.99	52,192,581.00	(1,839,404.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Jan-19	24-Jan-20	49,400,000.00	48,879,785.97	50,665,366.93	(1,785,580.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	13-feb-20	7,400,000.00	7,540,075.59	7,841,018.02	(300,942.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Apr-19	27-mar-20	1,600,000.00	1,640,599.53	1,706,027.26	(65,427.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Apr-19	30-mar-20	2,400,000.00	2,508,870.18	2,608,586.71	(99,716.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Apr-19	15-Jan-20	38,000,000.00	39,875,510.56	40,427,316.54	(551,805.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	10-Apr-20	9,000,000.00	9,507,765.60	9,910,504.48	(402,738.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	59,009,804.56	(2,411,319.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	59,009,804.56	(2,411,319.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	59,009,804.56	(2,411,319.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	14-may-20	4,600,000.00	5,334,390.06	5,589,476.54	(255,086.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-may-19	11-may-20	53,200,000.00	56,793,951.90	59,403,852.47	(2,609,900.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	14-may-20	24,300,000.00	26,013,386.22	27,220,356.77	(1,206,970.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-jun-19	3-jun-20	140,000.00	145,922.37	151,888.04	(5,965.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-jun-19	1-jun-20	1,100,000.00	1,255,112.49	1,306,308.36	(51,195.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	15-jun-20	580,000.00	587,179.94	611,157.75	(23,977.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	15-jun-20	7,500,000.00	8,160,454.46	8,480,673.91	(320,219.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 47 de 104

31 de diciembre de 2019

7. Contratos de venta forward (continuación):

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	3-jul-19	2-jul-20	700,000.00	823,277.86	855,488.24	(32,210.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	8-jul-19	2-jul-20	170,000.00	171,452.29	177,683.65	(6,231.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	9-Aug-19	5-feb-20	530,000.00	553,335.76	562,919.77	(9,584.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Aug-19	13-Aug-20	240,000.00	252,035.78	261,863.07	(9,827.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-19	11-feb-20	4,800,000.00	5,201,829.73	5,327,889.05	(126,059.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Aug-19	17-feb-20	270,000.00	288,026.27	295,080.44	(7,054.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	23-Aug-19	19-feb-20	240,000.00	253,976.55	259,570.24	(5,593.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	23-Aug-19	19-feb-20	1,000,000.00	1,087,098.51	1,111,041.26	(23,942.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	26-Aug-19	3-Jan-20	450,000.00	482,129.47	490,865.87	(8,736.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Aug-19	26-feb-20	250,000.00	260,131.16	266,269.84	(6,138.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Aug-19	20-Aug-20	350,000.00	357,437.96	371,059.50	(13,621.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Aug-19	7-Jan-20	1,200,000.00	1,318,586.95	1,344,803.67	(26,216.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Aug-19	28-Aug-20	2,100,000.00	2,204,201.39	2,254,939.73	(50,738.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Aug-19	28-feb-20	2,400,000.00	2,605,550.57	2,668,282.48	(62,731.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-sep-19	3-mar-20	21,000,000.00	22,743,235.75	23,316,134.83	(572,899.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-sep-19	6-mar-20	500,000.00	543,920.79	549,552.46	(5,631.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	9-sep-19	6-mar-20	8,500,000.00	10,628,747.19	10,870,182.14	(241,434.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-sep-19	8-Jan-20	460,000.00	480,737.76	488,955.50	(8,217.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-sep-19	7-sep-20	520,000.00	541,026.76	562,353.56	(21,326.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-sep-19	16-mar-20	8,900,000.00	10,652,964.59	10,888,552.77	(235,588.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19-sep-19	17-mar-20	13,900,000.00	15,978,046.93	16,333,865.59	(355,818.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-sep-19	18-mar-20	570,000.00	582,217.34	595,841.09	(13,623.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-sep-19	18-mar-20	13,900,000.00	15,978,056.51	16,336,342.33	(358,285.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	26-sep-19	24-mar-20	240,000.00	263,255.43	269,762.53	(6,507.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-sep-19	27-mar-20	25,700,000.00	27,879,181.90	28,559,386.27	(680,204.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	1-oct-19	2-Jan-20	490,000.00	515,382.57	518,665.98	(3,283.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	1-oct-19	2-Jan-20	70,000.00	76,150.77	76,840.28	(689.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	1-oct-19	30-mar-20	190,000.00	208,405.72	212,048.82	(3,643.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	30-mar-20	3,600,000.00	3,873,784.24	3,926,619.12	(52,834.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-oct-19	25-sep-20	2,500,000.00	2,580,682.58	2,659,003.72	(78,321.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-oct-19	3-Apr-20	450,000.00	459,114.94	465,796.69	(6,681.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-oct-19	28-sep-20	250,000.00	251,235.12	258,565.57	(7,330.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-oct-19	3-Jan-20	2,500,000.00	2,886,645.52	2,901,595.64	(14,950.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-oct-19	28-sep-20	2,400,000.00	2,501,118.14	2,570,234.96	(69,116.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	3-oct-19	2-Jan-20	700,000.00	796,819.77	800,375.70	(3,555.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-oct-19	2-Jan-20	4,900,000.00	5,399,137.88	5,425,289.72	(26,151.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	4-oct-19	3-Jan-20	8,800,000.00	9,392,175.00	9,417,590.83	(25,415.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-Jan-20	320,000.00	335,366.84	337,169.85	(1,803.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-oct-19	7-Jan-20	530,000.00	551,046.63	554,429.77	(3,383.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 48 de 104

7. Contratos de venta forward (continuación):

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
BC0921	7-oct-19	1-oct-20	620,000.00	611,345.56	627,880.65	(16,535.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	7-Jan-20	5,300,000.00	5,875,757.59	5,909,588.51	(33,830.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-oct-19	4-feb-20	26,200,000.00	27,970,341.18	27,891,118.59	79,222.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-oct-19	7-Jan-20	12,600,000.00	15,499,600.42	15,393,179.02	106,421.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-oct-19	7-Jan-20	560,000.00	589,946.32	586,445.02	3,501.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	8-oct-19	8-Jan-20	31,000,000.00	33,019,229.81	32,827,981.42	191,248.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-oct-19	3-Jan-20	21,400,000.00	22,697,072.04	22,557,844.78	139,227.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-oct-19	8-Apr-20	2,900,000.00	3,095,192.44	3,117,160.32	(21,967.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	10-oct-19	7-Apr-20	24,800,000.00	29,827,895.75	30,012,793.73	(184,897.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-oct-19	9-Jan-20	150,000.00	161,312.97	161,035.81	277.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-oct-19	8-Apr-20	3,400,000.00	3,609,534.39	3,637,198.06	(27,663.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11-oct-19	9-oct-20	500,000.00	585,495.81	598,665.25	(13,169.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	14-oct-19	13-Jan-20	15,600,000.00	16,923,661.61	16,901,110.32	22,551.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-oct-19	16-Jan-20	530,000.00	546,666.14	546,481.27	184.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	15-Jan-20	19,200,000.00	20,333,480.71	20,346,680.10	(13,199.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-oct-19	27-mar-20	7,200,000.00	7,710,768.60	7,777,171.12	(66,402.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-oct-19	16-Jan-20	21,800,000.00	22,862,559.30	22,884,996.26	(22,436.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	18-oct-19	16-Jan-20	600,000.00	673,269.56	672,282.24	987.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-oct-19	20-Apr-20	270,000.00	281,474.44	282,581.43	(1,106.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-oct-19	22-Jan-20	530,000.00	548,774.56	548,647.43	127.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	22-oct-19	20-Jan-20	10,800,000.00	11,534,096.52	11,523,785.93	10,310.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-oct-19	23-Jan-20	120,000.00	128,476.50	128,489.30	(12.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-oct-19	22-Apr-20	260,000.00	258,406.93	260,712.95	(2,306.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-oct-19	28-Jan-20	260,000.00	272,072.92	272,192.15	(119.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-oct-19	26-feb-20	480,000.00	501,364.18	501,746.32	(382.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	29-oct-19	27-Jan-20	11,700,000.00	12,507,079.75	12,477,905.57	29,174.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-oct-19	28-Jan-20	25,300,000.00	30,127,451.41	30,084,052.26	43,399.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30-oct-19	29-Jan-20	14,200,000.00	17,068,822.18	17,075,529.14	(6,706.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	30-oct-19	28-Jan-20	12,600,000.00	13,416,777.70	13,394,935.10	21,842.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-nov-19	30-Jan-20	170,000.00	175,397.43	175,557.46	(160.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-nov-19	3-Jan-20	60,600,000.00	68,884,415.56	68,667,962.22	216,453.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	48,600,000.00	51,104,821.36	51,094,103.05	10,718.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	18,300,000.00	19,281,521.12	19,277,477.17	4,043.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-nov-19	4-feb-20	16,500,000.00	17,389,226.64	17,385,579.56	3,647.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	6-nov-19	3-feb-20	83,300,000.00	89,278,043.83	89,179,942.93	98,100.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-nov-19	3-feb-20	45,200,000.00	55,721,529.87	55,660,301.69	61,228.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	7-nov-19	3-feb-20	44,300,000.00	54,506,097.34	54,446,204.71	59,892.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-nov-19	7-Jan-20	550,000.00	571,869.31	570,293.22	1,576.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-nov-19	8-may-20	160,000.00	159,361.65	160,818.29	(1,456.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	8-nov-19	6-feb-20	530,000.00	569,890.96	569,501.26	389.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 49 de 104

31 de diciembre de 2019

7. Contratos de venta forward (continuación):

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	8-nov-19	6-may-20	14,700,000.00	15,556,565.03	15,697,243.45	(140,678.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-nov-19	6-feb-20	800,000.00	948,540.91	948,426.40	114.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-nov-19	28-Jan-20	1,500,000.00	1,608,030.60	1,605,111.34	2,919.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-nov-19	6-may-20	2,500,000.00	2,719,093.79	2,739,071.39	(19,977.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-nov-19	10-feb-20	260,000.00	273,549.15	273,667.48	(118.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-nov-19	10-Jan-20	40,600,000.00	44,366,999.19	44,230,521.78	136,477.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	12-nov-19	6-nov-20	11,100,000.00	12,672,494.53	12,893,371.36	(220,876.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	13-nov-19	2-Jan-20	230,000.00	240,075.38	239,466.76	608.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	11-feb-20	420,000.00	440,818.73	441,070.37	(251.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-nov-19	13-nov-20	310,000.00	304,249.45	311,481.29	(7,231.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	13-nov-19	21-feb-20	230,000.00	246,090.60	246,478.42	(387.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	13-nov-19	15-Jan-20	1,600,000.00	1,938,457.16	1,933,881.77	4,575.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-nov-19	30-Jan-20	200,000.00	211,100.65	209,362.73	1,737.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	18-nov-19	17-Jan-20	71,800,000.00	77,927,377.99	77,780,363.12	147,014.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-nov-19	28-Jan-20	1,000,000.00	1,070,398.41	1,069,258.08	1,140.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-nov-19	18-may-20	9,000,000.00	10,241,220.00	10,366,914.04	(125,694.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	19-nov-19	18-may-20	38,400,000.00	46,799,061.25	47,373,442.35	(574,381.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	20-nov-19	19-may-20	250,000.00	276,543.79	279,036.53	(2,492.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	20-nov-19	19-may-20	320,000.00	351,059.57	354,223.99	(3,164.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20-nov-19	19-nov-20	1,500,000.00	1,676,010.59	1,711,362.83	(35,352.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-nov-19	7-Jan-20	47,900,000.00	53,328,873.10	53,231,964.34	96,908.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-nov-19	27-Jan-20	23,400,000.00	24,845,294.10	24,838,610.93	6,683.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	28-nov-19	27-Jan-20	540,000.00	556,530.43	556,276.13	254.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	29-nov-19	2-Jan-20	290,000.00	293,520.48	292,886.67	633.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	2-Dec-19	2-Jan-20	160,000.00	170,218.95	169,979.46	239.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	2-Dec-19	2-mar-20	520,000.00	544,267.78	546,473.37	(2,205.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Dec-19	2-jun-20	700,000.00	777,754.88	787,638.67	(9,883.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-Dec-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,132,274.35	1,133,157.38	(883.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-Dec-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,132,274.35	1,133,157.38	(883.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-Dec-19	3-feb-20	1,000,000.00	1,132,274.35	1,133,157.38	(883.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	2-Dec-19	29-may-20	34,900,000.00	39,191,283.99	39,674,423.10	(483,139.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Dec-19	2-mar-20	4,800,000.00	5,166,660.70	5,188,572.41	(21,911.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-Dec-19	13-Jan-20	8,500,000.00	9,166,443.46	9,157,676.17	8,767.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-Dec-19	1-jun-20	25,200,000.00	27,406,027.74	27,714,122.24	(308,094.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-Dec-19	2-mar-20	3,400,000.00	3,785,691.97	3,798,179.98	(12,488.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-Dec-19	3-mar-20	600,000.00	654,735.93	657,612.43	(2,876.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	3-Dec-19	27-nov-20	1,500,000.00	1,565,474.25	1,605,970.35	(40,496.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Dec-19	3-Jan-20	47,700,000.00	53,194,329.31	53,107,113.88	87,215.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	4-Dec-19	2-Jan-20	1,700,000.00	2,127,290.25	2,123,896.86	3,393.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 50 de 104

31 de diciembre de 2019

7. Contratos de venta forward (continuación):

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
MH0322	4-Dec-19	4-feb-20	2,000,000.00	2,147,604.94	2,148,365.32	(760.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Dec-19	4-feb-20	900,000.00	1,068,951.66	1,069,531.17	(579.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	4-Dec-19	3-mar-20	900,000.00	1,040,306.13	1,043,896.22	(3,590.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	5-Dec-19	8-Jan-20	460,000.00	476,451.36	475,833.12	618.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-Dec-19	4-mar-20	250,000.00	268,333.78	269,553.56	(1,219.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Dec-19	4-feb-20	25,400,000.00	27,058,083.65	27,082,936.16	(24,852.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Dec-19	4-mar-20	16,600,000.00	17,764,536.77	17,838,588.71	(74,051.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	5-Dec-19	4-mar-20	25,600,000.00	28,825,868.64	28,940,596.20	(114,727.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	5-Dec-19	4-feb-20	600,000.00	646,154.74	646,626.61	(471.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	5-Dec-19	4-feb-20	1,500,000.00	1,615,386.92	1,616,566.60	(1,179.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-Dec-19	8-Jan-20	200,000.00	212,855.84	212,659.75	196.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-Dec-19	3-jun-20	270,000.00	274,730.49	278,312.95	(3,582.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Dec-19	4-feb-20	21,700,000.00	23,166,476.51	23,187,754.62	(21,278.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	6-Dec-19	3-feb-20	2,300,000.00	2,863,923.83	2,864,541.06	(617.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	6-Dec-19	8-Jan-20	14,500,000.00	16,183,369.66	16,168,461.26	14,908.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	6-Dec-19	4-feb-20	1,300,000.00	1,448,872.39	1,449,657.87	(785.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	6-Dec-19	7-Jan-20	3,900,000.00	4,256,397.41	4,251,865.03	4,532.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-Dec-19	8-Jan-20	370,000.00	385,638.95	385,356.31	282.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-Dec-19	10-Jan-20	250,000.00	266,799.95	265,879.29	920.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-Dec-19	9-mar-20	420,000.00	450,156.32	451,189.46	(1,033.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-Dec-19	6-mar-20	310,000.00	330,507.53	331,115.54	(608.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Dec-19	10-mar-20	24,400,000.00	26,131,925.77	26,195,866.27	(63,940.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Dec-19	9-jun-20	19,600,000.00	21,341,096.39	21,585,113.99	(244,017.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-Dec-19	8-jun-20	75,000,000.00	83,250,354.46	84,143,336.86	(892,982.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	10-Dec-19	8-jun-20	67,100,000.00	73,656,904.69	74,446,983.24	(790,078.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-Dec-19	11-mar-20	190,000.00	188,373.76	188,863.26	(489.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Dec-19	10-Jan-20	23,900,000.00	26,701,720.12	26,609,579.31	92,140.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0722	12-Dec-19	12-feb-20	300,000.00	334,447.28	333,994.36	452.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-Dec-19	12-jun-20	260,000.00	269,668.52	272,714.03	(3,045.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12-Dec-19	28-Jan-20	1,000,000.00	1,069,442.43	1,067,300.58	2,141.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12-Dec-19	13-feb-20	700,000.00	758,334.38	757,412.02	922.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-19	15-Jan-20	21,500,000.00	22,834,210.95	22,716,265.16	117,945.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-Dec-19	14-feb-20	250,000.00	269,333.31	269,244.74	88.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Dec-19	16-mar-20	15,400,000.00	16,590,457.29	16,646,149.59	(55,692.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-Dec-19	16-Jan-20	10,600,000.00	11,380,976.10	11,357,876.68	23,099.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16-Dec-19	16-Jan-20	8,900,000.00	9,602,480.92	9,584,793.22	17,687.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-Dec-19	16-Jan-20	300,000.00	320,780.20	320,008.80	771.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 51 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

7. Contratos de venta forward (continuación):

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
BC0921	17-Dec-19	16-jun-20	300,000.00	312,340.56	315,809.38	(3,468.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-Dec-19	16-jun-20	270,000.00	276,278.91	279,555.62	(3,276.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Dec-19	14-feb-20	19,800,000.00	21,194,993.07	21,184,049.02	10,944.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-Dec-19	16-Dec-20	700,000.00	703,868.90	721,434.80	(17,565.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Dec-19	17-mar-20	38,100,000.00	40,968,682.05	41,097,027.50	(128,345.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-Dec-19	20-Jan-20	600,000.00	688,400.54	687,009.76	1,390.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Dec-19	3-feb-20	21,500,000.00	22,946,096.84	22,929,491.89	16,604.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0522	20-Dec-19	19-mar-20	360,000.00	376,754.93	377,907.88	(1,152.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-19	20-feb-20	260,000.00	275,300.28	275,385.91	(85.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	20-Dec-19	22-Jan-20	14,400,000.00	17,610,235.50	17,579,690.51	30,544.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20-Dec-19	14-Dec-20	19,700,000.00	22,001,278.37	22,453,511.01	(452,232.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-Dec-19	25-jun-20	250,000.00	260,408.92	263,779.82	(3,370.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Dec-19	24-feb-20	490,000.00	520,850.69	521,397.54	(546.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-Dec-19	24-Jan-20	4,700,000.00	5,163,762.92	5,157,250.78	6,512.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26-Dec-19	24-Jan-20	65,400,000.00	72,555,974.77	72,464,472.70	91,502.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	27-Dec-19	24-jun-20	450,000.00	490,899.10	496,443.68	(5,544.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	27-Dec-19	23-Dec-20	250,000.00	253,746.54	260,343.42	(6,596.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Dec-19	7-Jan-20	47,600,000.00	53,189,642.06	53,043,049.34	146,592.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Dec-19	7-Jan-20	23,800,000.00	26,594,821.02	26,521,524.66	73,296.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	27-Dec-19	27-Jan-20	42,700,000.00	53,574,742.41	53,530,133.75	44,608.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-Dec-19	26-feb-20	700,000.00	816,877.16	817,653.08	(775.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-Dec-19	26-mar-20	700,000.00	767,423.43	770,584.82	(3,161.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-Dec-19	26-mar-20	1,000,000.00	1,145,177.26	1,149,894.80	(4,717.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	27-Dec-19	24-jun-20	23,500,000.00	26,925,354.97	27,239,613.30	(314,258.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Dec-19	2-Jan-20	117,200,000.00	132,357,627.36	132,471,055.79	(113,428.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	30-Dec-19	2-Jan-20	38,500,000.00	47,648,745.89	47,689,580.12	(40,834.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			2,416,990,000.00	2,665,682,717.00	2,689,410,992.14	(23,728,275.14)		

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
	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 52 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

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 Negociación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	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
N/A	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 Negociación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	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
N/A	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 53 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2019

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 Negociación
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

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
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total								

10. Inversiones en otras obligaciones DOP

d) Oro Cuenta 6.1.4

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación	Código ISIN
N/A	BANCO MULTIPLE SANTA CRUZ	887,583,892.62	887,583,892.62	N/A	N/A	DOP	100%	N/A
Total		887,583,892.62	887,583,892.62					



LPFA Sociedad de Valores, S. A.
formación Suplementaria

NEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN
1 de diciembre de 2019 y 2018
Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	51,000,000.00	N/A	52,102,824.00	N/A	DOP	OTC	2.55%
DO1002215825	BCRD 11% 14-OCT-22	8,000,000.00	N/A	8,206,768.00	N/A	DOP	OTC	0.40%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	9,560,000.00	N/A	9,766,725.44	N/A	DOP	OTC	0.48%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	10,000,000.00	N/A	10,007,660.00	N/A	DOP	OTC	0.49%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	15,200,000.00	N/A	15,211,643.20	N/A	DOP	OTC	0.74%
DO1002216724	BCRD 11% 05-ENE-2024	18,900,000.00	N/A	19,317,652.20	N/A	DOP	OTC	0.94%
DO1005204412	BCRD 11.38% 06-JUL-29	25,000,000.00	N/A	26,613,275.00	N/A	DOP	OTC	1.30%
DO1005206722	MHRD 11.50% 11-ENE-2034	89,300,000.00	N/A	96,448,822.20	N/A	DOP	OTC	4.72%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	10,000,000.00	N/A	10,617,920.00	N/A	DOP	OTC	0.52%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	90,000,000.00	N/A	94,374,360.00	N/A	DOP	OTC	4.62%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	50,000,000.00	N/A	53,089,600.00	N/A	DOP	OTC	2.60%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	157,700,000.00	N/A	168,388,748.30	N/A	DOP	OTC	8.24%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	35,700,000.00	N/A	38,119,710.30	N/A	DOP	OTC	1.86%
DO1005234625	MHRD 15.95% 04-JUN-21	68,500,000.00	N/A	74,683,906.00	N/A	DOP	OTC	3.65%
DO1005234625	MHRD 15.95% 04-JUN-21	45,000,000.00	N/A	49,062,420.00	N/A	DOP	OTC	2.40%
DO1005206623	MHRD 10.25% 11-ENE-2024	150,000,000.00	N/A	153,580,050.00	N/A	DOP	OTC	7.51%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	349,000,000.00	N/A	364,623,334.00	N/A	DOP	OTC	17.83%
DO1005207027	MHRD 10.75% 08-NOV-2029	100,000,000.00	N/A	102,771,500.00	N/A	DOP	OTC	5.03%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	20,000,000.00	N/A	21,235,840.00	N/A	DOP	OTC	1.04%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	12,900,000.00	N/A	13,325,325.90	N/A	DOP	OTC	0.65%
DO1005234625	MHRD 15.95% 04-JUN-21	42,600,000.00	N/A	46,445,757.60	N/A	DOP	OTC	2.27%
DO1005234625	MHRD 15.95% 04-JUN-21	13,600,000.00	N/A	14,827,753.60	N/A	DOP	OTC	0.73%
DO1005241125	MHRD 16.95% 04-FEB-22	41,800,000.00	N/A	47,901,964.00	N/A	DOP	OTC	2.34%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	13,300,000.00	N/A	13,608,839.30	N/A	DOP	OTC	0.67%
DO1005206623	MHRD 10.25% 11-ENE-2024	21,300,000.00	N/A	21,808,367.10	N/A	DOP	OTC	1.07%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	100,000,000.00	N/A	104,476,600.00	N/A	DOP	OTC	5.11%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	32,100,000.00	N/A	33,660,188.40	N/A	DOP	OTC	1.65%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	49,500,000.00	N/A	51,132,064.50	N/A	DOP	OTC	2.50%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	8,000,000.00	N/A	8,516,248.00	N/A	DOP	OTC	0.42%
DO1005207027	MHRD 10.75% 08-NOV-2029	67,300,000.00	N/A	69,165,219.50	N/A	DOP	OTC	3.38%
DO1005206722	MHRD 11.50% 11-ENE-2034	37,300,000.00	N/A	40,286,014.20	N/A	DOP	OTC	1.97%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	185,000,000.00	N/A	202,893,570.00	N/A	DOP	OTC	9.92%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	7,600,000.00	N/A	8,335,087.20	N/A	DOP	OTC	0.41%
USD (*)		1,935,160,000.00	-	2,044,605,757.94	-			100%

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
DO1005207118	MH 6.65% 27-DIC-2026	9,600,000.00	N/A	9,600,000.00	N/A	USD	OTC	100%
		9,600,000.00	-	9,600,000.00	-			100%

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 10:54 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 55 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Al 31 de diciembre de 2018

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 participacion
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%
D09014000119	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 dias	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%
D08013900121	JMMB Fondo de Inversión 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 56 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 57 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 58 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 59 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 60 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 61 de 104

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-Nov-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 62 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 63 de 104

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 64 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 65 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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

Anexo I - Página 66 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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-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 67 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 68 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 69 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 70 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 71 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 72 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 73 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 74 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 75 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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	410,304.43	(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 76 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 77 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 78 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 79 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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-Jan-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 80 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 81 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 82 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 83 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 84 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 85 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0729	10-Aug-18	6-Feb-19	300,000.00	379,874.32	306,574.54	(73,299.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0729	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
BO0222	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 86 de 104

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 87 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 88 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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	3,296,231.66	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

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 89 de 104

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 90 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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

52.9601

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 91 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

52.9601

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 92 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

52.9601

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 93 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 94 de 104

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 95 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 96 de 104

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 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 97 de 104

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 98 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 negociación
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
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	1,400,000.00	1,474,830.62	1,493,960.83	-19,130.21	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	269,193.33	-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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 99 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 negociación
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	570,677.16	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

Anexo I - Página 100 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 negociación
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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 101 de 104

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
B00126	17-Dec-18	18-Mar-19	500,000.00	538,187.86	543,093.61	-4,905.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
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 102 de 104

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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	26/12/2019	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	28/12/2019	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	27/12/2019	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

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo I - Página 103 de 104

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	27/12/2019	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	28/12/2019	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	31/12/2019	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

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
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
1 de diciembre de 2019 y 2018
Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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 10:54 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>



LPHA Sociedad de Valores, S. A.

formación Suplementaria

NEXO II - ESTADOS DE CARTERA EN CUSTODIA

de diciembre de 2019 y 2018

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 2019 y 2018.

Tipos de Clientes	31 de diciembre de 2019					Moneda de Denominación
	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado	
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	702	852	1981	4,281,884,052	153,886,436	DOP
Personas Jurídicas DOP	131	-	-	1,799,875,473	53,019,887	USD
Clientes Profesionales DOP	30	84	182	10,713,804,799	336,734,050	DOP
Personas Físicas USD	7	-	-	8,912,984	130,497	USD
Personas Jurídicas USD	35	43	126	2,849,817	43,453	DOP
Clientes Profesionales USD	11	-	-	9,545,705	95,216	USD
Total Clientes	767	979	2289	16,795,564,323	543,640,373	DOP
Total USD	149	-	-	21,308,506	269,166	USD

Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	31 de diciembre de 2018			Moneda de Denominación
		Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal	
		Activos	Inactivos		
Personas Físicas DOP	2,511	1,199	1,312	4,676,019,792	DOP
Personas Físicas USD	231	103	128	1,152,625,240	DOP
Personas Jurídicas DOP	127	74	53	8,711,062,328	DOP
Personas Jurídicas USD	155	-	-	19,662,785	USD
Clientes Profesionales DOP	14	-	-	12,961,484	USD
Clientes Profesionales USD	13	-	-	25,523,261	USD
total Clientes	2,869	1,376	1,493	14,539,707,360	DOP
Total USD	182	-	-	58,147,530	USD

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 10:54 AST)

<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO III - ESTADOS DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

Anexo III

31 de diciembre de 2019 y 2018

(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 2019 y 2018.

	<u>2019</u>	<u>2018</u>
Utilidad neta	523,167,810	415,974,616
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	523,167,810	415,974,616

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 10:54 AST)
<https://www.viafirma.com.do/inbox/app/alpha/v/5NZQ-HZJW-SKWH-DXGF>

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 2019 y 2018

(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 2019 y 2018.

	Al 31 de diciembre de 2019								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	2,444,020,868	-	-	-	-	-	-	-	2,444,020,868	2,444,020,868
Instrumento Financiero de Cartera Propia Disponible	2,464,043,617	-	-	-	-	-	-	3,011,121,355	5,475,164,972	2,464,043,617
Inversiones a Costo Amortizado	-	-	-	-	-	-	1,177,050,623	-	1,177,050,623	-
Instrumento Financiero de Cartera Propia Comprometida	-	-	-	-	-	-	-	2,628,131,747	2,628,131,747	-
Contratos Derivados	638,698	2,947,790	8,314,971	3,001,289	1,337,735	4,277,515	1,152,947	1,410	21,672,355	11,901,459
Impuestos por Cobrar	-	-	-	-	-	-	68,827,475	-	68,827,475	-
Activos Intangibles	-	-	-	-	-	-	-	3,400,846	3,400,846	-
Otras Cuentas por Cobrar	11,356,549	12,902,833	473,216	25,235,969	2,406,365	10,254,746	77,359	1,000,000	63,707,038	24,732,598
Inversiones en Sociedades	-	-	-	-	-	-	-	118,279,510	118,279,510	-
Propiedades de Planta y Equipo	-	-	-	-	-	-	-	7,207,605	7,207,605	-
Otros Activos	-	-	109,417	-	194,916	63,438	43,796	747,470	1,159,037	109,417
Total de Activos	4,920,059,732	15,850,623	8,897,604	28,237,258	3,939,016	14,595,699	1,247,152,200	5,769,889,943	12,008,622,076	4,944,807,959
Pasivos Financieros a Valor Razonable	(219,021,129)	(755,176,255)	(1,148,533,053)	(1,066,134,634)	(523,441,956)	(1,052,010,847)	(243,184,710)	(16,809,645)	(5,024,312,229)	(2,122,730,437)
Instrumentos Financieros Derivados	(7,776,722)	(35,666,543)	(50,431,584)	(36,569,513)	(85,228,623)	(8,828,862)	(748,645)	(151,471)	(225,401,963)	(93,874,849)
Operaciones de Financiamientos	-	-	-	(1,015,068)	-	(11,925,554)	(675,000,148)	(200,300,000)	(888,240,770)	-
Otras Cuentas por Pagar	-	(15,014,991)	-	-	-	-	-	-	(15,014,991)	(15,014,991)
Otros Pasivos	-	-	(13,099,243)	-	-	(61,676,971)	-	-	(74,776,214)	(13,099,243)
Total Pasivos	(226,797,851)	(805,857,789)	(1,212,063,880)	(1,103,719,215)	(608,670,579)	(1,134,442,234)	(918,933,503)	(217,261,116)	(6,227,746,167)	(2,244,719,520)
Flujo de caja estático	4,693,261,881	(790,007,166)	(1,203,166,276)	(1,075,481,957)	(604,731,563)	(1,119,846,535)	328,218,697	5,552,628,827	5,780,875,909	1,681,219,385
Flujo de caja acumulado	4,693,261,881	3,903,254,715	2,700,088,439	1,624,606,482	1,019,874,919	(99,971,616)	228,247,082	5,780,875,909		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO IV - TABLAS DE RIESGO DE LIQUIDEZ

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Anexo IV - Página 2 de 2

Tablas de riesgo de liquidez: (continuación):

	Al 31 de diciembre de 2018									
	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	Total Bands	Total 30 días
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 V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 1 de 3

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas

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

Deudores por intermediación

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 2019 y 2018, la Compañía no mantenía cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia.

Propiedad de Inversión

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 2019 y 2018, la Compañía no mantenía cuenta por pagar a acreedores por intermediación.

Cuentas por pagar por operaciones de cartera propia

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 2019 al 31 de diciembre de 2019.

Fecha	Descripción de Hecho Relevante
9/11/2019	En fecha veintiocho (28) de noviembre del 2019, La Compañía suscribió una Enmienda al Contrato de Línea de Crédito con la Asociación Cibao de Ahorros y Prestamos (ACAP), en donde ACAP renueva el crédito que tenía Compañía con esta entidad por un plazo de un año contados a partir de la firma del Contrato.
21/11/2019	En fecha veinte (20) de noviembre del 2019, Compañía adquirió un crédito de la Empresa de Distribuidora de Electricidad del Este S.A. (EDEESTE), en virtud un Contrato de Cesión de Créditos con la Empresa Generadora de Electricidad Haina S.A., (EGE HAINA).
19/11/2019	En fecha 18 de noviembre de 2019, la Compañía giró una línea de crédito con Banco Popular Dominicano S.A., y a consecuencia suscribió un Acto de Constitución de Garantía.
18/07/2019	Cambio de Garantía Línea de Crédito Banco Popular Dominicano, S.A.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 2 de 3

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas (continuación)

Hechos relevantes (continuación)

Fecha	Descripción de Hecho Relevante
28/06/2019	Aumento Línea de Crédito Banco Popular Dominicano.
10/06/2019	En fecha seis (6) de junio de 2019, la Compañía suscribió con Citibank N.A., Sucursal República Dominicana un Contrato de Línea de Crédito con Garantía Prendaria por un monto de hasta USD\$8,000,000.
07/06/2019	En fecha seis (6) de junio de 2019, la Compañía suscribió con Citibank N.A., Sucursal Republica Dominicana un Contrato de Línea de Crédito con Garantía Prendaria por un monto de hasta USD\$8,000,000.
16/05/2019	Finalizo la colocación total en Mercado Primario de 3era, 4ta y 5ta emisión del Programa Emisiones SIVEM-119 por monto DOP 600,000,000.00 con vencimiento del 25-abr., 25-agos. y 25-del 2021, con tasas fijas de 9.60%, 9.70% y 9.80% y pagos de intereses para 3era será anual y para 4ta y 5ta semestral
07/05/2019	Emisión del Informe Trimestral del Representante de la Masa Obligacionista Correspondiente al trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a la sociedad Alpha Sociedad De Valores, S. A., Puesto de Bolsa, correspondientes al programa SIVEM-119.
07/05/2019	Emisión del Informe Trimestral del Representante de la Masa Obligacionista correspondiente al trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a la sociedad Alpha Sociedad De Valores, S. A., Puesto de Bolsa, correspondientes al programa SIVEM-098.
07/05/2019	Aprobación los Estados Financieros Auditados correspondientes al año 2018, mediante la tercera resolución de la Asamblea General Ordinaria Anual de la Compañía celebrada el 6 de mayo del 2019.
06/05/2019	Informe de Gobierno Corporativo 2018 de la Compañía mediante la tercera resolución adoptada por el Consejo de Administración en la reunión de fecha 03-05-2019.
02/05/2019	En fecha 01 de mayo del 2019 Celebración de Asamblea General Ordinaria de Accionistas de la Compañía donde se decidió aplazar el conocimiento de dicha asamblea para el día 06 de mayo del 2019.
23/04/2019	Emisión del Informe Trimestral de Calificación correspondiente al trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a la sociedad Alpha Sociedad De Valores, S. A., Puesto de Bolsa, con una calificación A-, por Feller Rate, S.R.L.
23/04/2019	Emisión del Informe Trimestral de Calificación correspondiente al trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a la sociedad Alpha Sociedad De Valores, S. A., Puesto de Bolsa, con una calificación A-, por Feller Rate, S.R.L.
22/04/2019	Emisión del Informe Trimestral de Calificación correspondiente al trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a la sociedad Alpha Sociedad De Valores, S. A., Puesto de Bolsa, con una calificación A-, por Feller Rate, S.R.L.
22/04/2019	Emisión del Informe Trimestral de Calificación del trimestre cerrado el treinta y uno (31) de marzo del año dos mil diecinueve (2019) relativo a ALPHA Sociedad de Valores, S. A., calificación A-, por Feller Rate, S.R. L

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

Anexo V - Página 3 de 3

31 de diciembre de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas (continuación)

Hechos relevantes (continuación)

Fecha	Descripción de Hecho Relevante
15/04/2019	Publicación de Convocatoria a Asamblea General Ordinaria Anual de Accionistas de la Compañía en fecha 1ro. de mayo de 2019.
08/04/2019	Suscripción de Contrato de Cesión de Derechos y Compromiso de Pago sobre Acuerdo de Reconocimiento de Deuda y Pago, con Banco Panamá.
21/03/2019	La Compañía suscribe un acuerdo de reconocimiento de deuda y pago con la Empresa Distribuidora del Norte.
08/02/2019	La Compañía suscribió contrato de línea de crédito con la institución Citibank, N. A.

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 del Mercado de Valores de la República Dominicana

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 Superintendencia del Mercado de Valores de la República Dominicana.

Estados financieros ajustados por inflación

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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.