

Estados Financieros semestrales

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

Al 30 de junio de 2019

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

1er. Semestre terminado el 30 de junio de 2019

CONTENIDO

Página(s)

Estados de Situación Financiera.....	3
Estados de Resultados Integrales.....	4
Estados de Cambios en el Patrimonio.....	5
Estados de Flujos de Efectivo.....	6
Notas a los Estados Financieros.....	7-68
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE SITUACIÓN FINANCIERA

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		Al 30 de junio de 2019	Al 31 de diciembre de 2018
	Notas		
Activos			
Efectivo y equivalentes de efectivo	6	121,946,350	2,350,058,741
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	6 y 7	9,440,620,443	3,671,151,309
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	6 y 8	65,447,734	60,219,789
A costo amortizado corto plazo	6 y 9	914,392,213	1,237,148,708
Otras cuentas por cobrar	6 y 10	283,165,074	30,962,364
Anticipos de impuesto sobre la renta	17	-	65,692,596
Impuestos por cobrar		67,399,076	-
Impuesto sobre la renta diferido	22	35,988,543	35,988,543
Total activos Corrientes		10,928,959,433	7,451,222,050
Inversiones en acciones	11	118,279,510	118,279,510
Mobiliario y equipos		5,721,235	5,006,304
Cargos diferidos		-	5,483,334
Activos intangibles		1,696,776	-
Otros activos		2,368,163	1,093,412
Total de activos		11,057,025,118	7,581,084,610
Pasivos y Patrimonio			
Pasivos financieros:			
A valor razonable	6 y 12	4,367,795,840	4,143,275,233
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados	6 y 8	341,149,870	141,111,748
A costo amortizado:			
Obligaciones con bancos	6 y 13	2,809,800,244	-
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo	14	1,014,549,041	688,420,342
Otras cuentas por pagar		17,371,096	31,572,619
Cuentas por pagar a relacionadas	15	-	1,615,094
Acumulaciones y otras obligaciones por pagar	16	64,411,248	73,073,394
Impuesto por pagar		2,218,287	-
Otros Pasivos		400,000	-
Total pasivos Corrientes		8,617,695,626	5,079,068,430
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo	14	200,000,000	600,000,000
Total Pasivos		8,817,695,626	5,679,068,430
Compromisos y contingencias	20		
Patrimonio			
Capital	18	900,000,000	900,000,000
Aportes para futura capitalización		138	138
Reserva de capital		180,000,000	180,000,000
Resultados acumulados		822,016,042	822,016,042
Resultados del ejercicio		337,313,312	-
Total de patrimonio		2,239,329,492	1,902,016,180
TOTAL DE PASIVOS Y PATRIMONIO		11,057,025,118	7,581,084,610

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRALES

Al 30 de junio de 2019 y 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 30 de junio de 2018</u>
	Notas		
Resultado por instrumentos financieros			
A valor razonable	7 y 12	981,068,685	2,339,280,433
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	8	(468,097,859)	(1,740,583,649)
A costo amortizado	9	66,772,383	14,888,128
Total resultados por instrumentos financieros		<u>579,743,208</u>	<u>613,584,913</u>
Resultado por intermediación			
Comisiones por operaciones bursátiles y extrabursátiles		1,702,485	817,728
Gastos por comisiones y servicios		(22,169,114)	(11,429,871)
Total Resultados por intermediación		<u>(20,466,628)</u>	<u>(10,612,142)</u>
Gastos por financiamiento	13 y 14	(132,814,181)	(53,240,152)
Gastos de administración y comercialización		(152,255,686)	(138,997,480)
Otros resultados			
Ganancia en cambio de moneda extranjera, neta	6	30,850,229	51,243,391
Resultado de inversiones en sociedades	11	8,321,889	7,791,658
Ingresos financieros		-	-
Otros ingresos		23,934,482	50,671,067
Total otros resultados		<u>63,106,600</u>	<u>109,706,115</u>
Resultado antes del impuesto sobre la renta		337,313,312	520,441,253
Impuesto sobre la renta	17	-	(20,434,039)
Utilidad neta		<u>337,313,312</u>	<u>500,007,215</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADO DE CAMBIOS EN EL PATRIMONIO

Al 30 de Junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

	<u>Capital</u>	<u>Aportes para futura Capitalización</u>	<u>Reserva de Capital</u>	<u>Resultados Acumulados</u>	<u>Total de Patrimonio</u>
<u>Notas</u>					
Saldos iniciales al 1ro. de enero de 2018	900,000,000	138	180,000,000	906,041,426	1,986,041,564
Resultado del ejercicio	-	-	-	415,974,616	415,974,616
Dividendos declarados	-	-	-	(500,000,000)	(500,000,000)
Saldos al 31 de diciembre de 2018	900,000,000	138	180,000,000	822,016,042	1,902,016,180
Resultado del ejercicio	-	-	-	337,313,312	337,313,312
Dividendos declarados	-	-	-	-	-
Saldos al 30 de junio de 2019	900,000,000	138	180,000,000	1,159,329,354	2,239,329,492

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

	<u>Junio 2019</u>	<u>Junio 2018</u>
Flujo neto originado por actividades de la operación:		
Comisiones pagadas	(20,466,628)	(10,612,142)
Ingreso neto por instrumentos financieros a valor razonable	(4,563,879,843)	3,346,374,307
Egreso neto por instrumentos financieros a derivados	(525,966,207)	(1,991,373,288)
Ingreso (Egreso) neto por instrumentos financieros a costo amortizado	1,238,504,987	215,510,350
Gastos de administración y comercialización pagados	(170,280,322)	(137,749,676)
Intereses pagados	(118,265,141)	(40,299,382)
Impuestos pagados	(3,196,832)	(13,249,075)
Otros ingresos netos por actividades de la operación	24,334,482	50,671,067
Flujo Neto originado por actividades de la operación	<u>(4,139,215,504)</u>	<u>1,419,272,162</u>
Flujo neto originado por actividades de inversion:		
Dividendos y otros ingresos percibidos de inversiones en sociedades	8,321,889	(82,102,300)
Incorporación de propiedades, planta y equipo	(472,798)	(138,445)
Inversiones en sociedades	-	-
Flujo neto originado por actividades de inversión	<u>7,849,091</u>	<u>(82,240,745)</u>
Flujo neto originado por actividades de financiamiento:		
Ingreso (Egreso) neto por pasivos financieros	2,721,379,903	(1,382,953,488)
Dividendos pagados	-	-
Flujo neto originado por actividades de financiamiento	<u>2,721,379,903</u>	<u>(1,382,953,488)</u>
Flujo neto total negativo del periodo	(1,409,986,511)	(45,922,071)
Efecto de la variación por cambios en la tasa de cambio sobre el efectivo y efectivo equivalentes de efectivo	30,850,229	51,243,391
Aumento neto en el efectivo	(1,379,136,282))	5,321,319
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	1,501,082,632	3,141,530,760
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	<u>121,946,350</u>	<u>3,146,852,079</u>
Transacciones no monetarias:		
Capital	-	-
Reserva legal	-	-
Resultados acumulados	<u>-</u>	<u>-</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 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 – 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 denomina ALPHA Sociedad de Valores, S. A. La Compañía fue constituida bajo las leyes de la República Dominicana el 4 de noviembre de 2008 y tiene por objetivo principal dedicarse a la compra y venta de todo tipo de títulos y documentos financieros, a la intermediación de valores y operaciones del mercado de valores, así como cualesquiera otras operaciones y servicios que sean compatibles con la actividad de intermediación en el mercado de valores y que previamente y de manera general autorice la Superintendencia de Valores de la República Dominicana.

La Compañía está domiciliada en la calle Ángel Severo Cabral No. 7, Ensanche Julieta, en Santo Domingo D. N. y cuenta con 66 empleados al 30 de junio de 2019 (Diciembre de 2018: 55 empleados).

Sus principales funcionarios son:

Nombre

Posición

Santiago Camarena

Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco

Vicepresidente de Finanzas

2. Bases para la preparación de los estados financieros

2.1 Base de preparación

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 30 de junio 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).

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A., al 30 de junio 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 3. 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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Cambios en políticas contables

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

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

NIIF 9 Instrumentos Financieros

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

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

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

(a) Clasificación y valoración

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

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Cambios en políticas contables (continuación)

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

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

(b) Deterioro

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

(c) Contabilidad de coberturas

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

NIIF 15 Ingresos Procedentes de Contratos con Clientes

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, para convertir los saldos en dólares estadounidenses (USD), Euros (EUR) y guaraníes paraguayos (PYG) a pesos dominicanos fueron las siguientes:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
<u>Moneda:</u>		
USD	50.8187	50.2762
EUR	59.8934	59.9275
PYG	<u>0.000820</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 equivalente al efectivo a menos que éste se encuentre restringido y no pueda ser intercambiado ni utilizado para cancelar un pasivo por un período mínimo de doce meses después del cierre del período sobre el que se informa.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.2 Clasificación corriente - no corriente (continuación)

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

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

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

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

4.3 Cálculo del valor razonable

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

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

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

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.3 Cálculo del valor razonable (continuación)

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

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

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

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

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

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

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.4 Reconocimiento de ingresos (continuación)

Ingresos por comisión

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

Dividendos

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

4.5 Impuestos

Impuesto sobre la renta corriente

El impuesto sobre la renta corriente es determinado tomando como base lo establecido en la Ley 11-92, Código Tributario, sus reglamentos y sus modificaciones. El impuesto corriente correspondiente al presente período y a los anteriores, es reconocido por la Compañía como un pasivo en la medida en que no haya sido liquidado o no haya podido ser compensado con los anticipos. Si la cantidad ya pagada, que corresponda al período anterior, excede el importe a pagar por esos períodos, el exceso es reconocido como un activo. La tasa de impuesto utilizada para determinar el impuesto sobre la renta al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.5 Impuestos

Impuesto sobre la renta diferido (continuación)

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

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

Los ingresos, gastos y activos se presentan netos del impuesto sobre las ventas de bienes y servicios, excepto cuando el impuesto sobre ventas y servicios (ITBIS) incurrido en la adquisición de activos o servicios no es recuperable de conformidad con el Código Tributario, en cuyo caso el ITBIS se registra como parte del costo de compra del activo relacionado o como un gasto, de ser el caso. La tasa del ITBIS al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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. Las regulaciones legales de la República Dominicana especifican que una 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. Sí 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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 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, 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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.10 Activos financieros (continuación)

Los activos financieros a costo amortizado incluyen las operaciones de compra con pacto de venta posterior y otras cuentas a cobrar.

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 integrante de las condiciones contractuales.

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

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.

Los pasivos financieros se clasifican como mantenidos para negociar ya que se incurren con el propósito de ser recomprados a corto plazo. En esta categoría se incluyen los instrumentos financieros derivados contratados por la Compañía que no han sido designados como instrumentos de cobertura en las relaciones de cobertura. Las pérdidas o ganancias de los pasivos mantenidos para negociar se reconocen en el estado de resultados integrales.

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

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

Baja de pasivos financieros

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

4.12 Deterioro de activos no financieros

La Compañía efectúa una revisión al cierre de cada ejercicio contable sobre los valores en libros de sus activos no financieros, con el objeto de identificar disminuciones de valor cuando hechos o circunstancias indican que los valores registrados podrían no ser recuperables. Si dicha indicación existiese y el valor en libros excede el importe recuperable, la Compañía valúa los activos o las unidades generadoras de efectivo a su importe recuperable, definido este como la cifra mayor entre su valor razonable menos los costos de venta y su valor en uso. Los ajustes

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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 del 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 están registrada al costo y anualmente, la Compañía determina si es necesario reconocer cualquier pérdida por deterioro relacionada con la inversión en acciones de acuerdo con lo establecido a la política contable.

4.15 Beneficios al personal

Prestaciones laborales

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

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

Beneficios post-empleo

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.15 Beneficios al personal (continuación)

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. Estimaciones e hipótesis contables significativas

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

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

Clasificación de arrendamientos de inmueble - la Compañía como arrendador

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

Estimaciones e hipótesis

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

4.16. 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.

NIIF 16 Arrendamientos

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

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

NIIF 16 Arrendamientos (continuación)

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

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

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

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

La NIIF 16 es efectiva para períodos anuales que empiezan el o después del 1ro. de enero de 2019.

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

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

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

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Saldos en moneda extranjera

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

<u>Activos:</u>	<u>Junio 2019</u> <u>USD</u>	<u>Diciembre 2018</u> <u>USD</u>
Efectivo y equivalente de efectivo	1,151,727	21,105,217
Inversiones en instrumentos financieros:		
A valor razonable con cambios en resultados	44,886,410	30,228,497
A valor razonable instrumentos financieros derivados	166,188	239,625
A costo amortizado	17,993,223	24,607,045
Otras cuentas por cobrar	2,760,256	126,809
Otros activos	10,711	-
	<u>66,968,516</u>	<u>76,307,193</u>
<u>Pasivos:</u>		
Pasivos financieros a su valor razonable	-	(1,393,541)
A valor razonable – Instrumentos financieros derivados	(556,753)	(1,198,964)
Obligaciones con Bancos e Instituciones Financieras	(35,521,760)	-
Otras cuentas por pagar	(100,533)	(556,003)
	<u>(36,179,047)</u>	<u>(3,148,508)</u>
Posición monetaria neta activa	<u>30,789,469</u>	<u>73,158,685</u>

	<u>Junio 2019</u> <u>EUR</u>	<u>Diciembre 2018</u> <u>EUR</u>
<u>Activos:</u>		
Efectivo y equivalente de efectivo	1,049	122,895
Posición monetaria neta activa	<u>1,049</u>	<u>122,895</u>

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Saldos en moneda extranjera (continuación)

El detalle de los ajustes en revaluación de moneda extranjera durante el 30 de junio de 2019 y 2018, es como sigue:

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>Junio 2019</u> <u>PYG</u>	<u>MEX</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	(7,047,471)	43,876	-	-	(7,003,595)
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	14,615,442	-	-	-	14,615,442
A valor razonable instrumentos financieros derivados	1,905,077	-	-	-	1,905,077
A costo amortizado	609,464	-	-	-	609,464
Otras cuentas por cobrar	4,394,343	-	-	(139,288)	4,255,055
Otros activos	696,773	-	-	-	696,773
Pasivos financieros:					
A valor razonable	13,449	-	-	-	13,449
A costo amortizado	15,758,564	-	-	-	15,758,564
	<u>30,945,641</u>	<u>43,876</u>	<u>-</u>	<u>(139,288)</u>	<u>30,850,229</u>
	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>Junio 2018</u> <u>PYG</u>	<u>MEX</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	(10,490,157)	(57,060)	-	-	(10,547,217)
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	24,028,248	(710,761)	838,237	-	24,155,724
A valor razonable instrumentos financieros derivados	28,899,295	-	-	-	28,899,295
A costo amortizado	7,494,930	-	-	-	7,494,930
Otras cuentas por cobrar	-	-	-	-	-
Otros activos	(131,246)	-	-	-	(131,246)
Pasivos financieros:					
A valor razonable	1,371,904	-	-	-	1,371,904
	<u>51,172,975</u>	<u>(767,821)</u>	<u>838,237</u>	<u>-</u>	<u>51,243,391</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

7. 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>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
Títulos / valores de deuda (a):		
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	4,126,991,057	1,742,871,855
Banco Central de República Dominicana	1,052,360,620	932,723,271
Asociación La Nacional de Ahorros y Préstamos	48,521,889	-
Asociación Cibao de Ahorros y Préstamos	506,593,911	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	197,587,255	35,282,582
Banco de Ahorro y Crédito Confisa, S. A.	-	100,690
Consortio Energético Punta Cana Macao, S. A.	38,742,915	48,452,320
Consortio Remix, S. A.	27,559,064	4,581,432
Consortio Minero Dominicano, S. A.	55,049,998	147,835,256
Dominican Power Partners	258,531,066	233,953,388
EDENORTE Dominicana S. A.	1,214,935,294	-
Empresa Generadora de Electricidad Haina S. A.	19,131,879	20,045,290
Fideicomiso RD Vial	-	51,796,904
Petroleum Company of Trinidad and Tobago Limited	-	130,539,358
Bonos Soberanos de Costa Rica	-	85,205,271
Gulfstream Petroleum Dominicana	1,255,855,141	-
Avianca Holding S.A.	330,499,231	-
	<u>9,132,359,319</u>	<u>3,433,387,617</u>
Aportes en fondos de inversión (b):		
Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 Dias Dólar	458,817	1,576,497
Fondo De Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	8,435,735	-
AFI Universal - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	3,963,605	3,813,460
BHD Liquidez - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	511,073	494,097
Fondo Mutuo Renta Fija Bhd Plazo 30 Días	1,614,314	441,907
Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	202,754	195,981
Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	6,109,835	5,936,270
JMMB Fondo de Inversión Cerrado Inmobiliario	20,548,578	6,720,877
JMMB Fondo de Inversión Money Market	22,219	21,424
JMMB Fondo Mutuo Plazo 90 días	35,533	33,989
PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	20,409,127	20,444,934
PIONEER- Fondo Nacional Pioneer United Renta Fija	1,021,874	972,160
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Liquidez	265,160	256,718
UNIVERSAL- Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual dólar	-	53,211,673
GAM - Fondo de Inversión Cerrado de Renta Fija	160,845,501	143,011,733
Fondo de Inversión Cerrado renta Inmobiliaria Dólares Popular	51,979,625	-
Fiduciaria Universal Fideicomiso de Oferta Pública	31,503,341	-
	<u>307,927,090</u>	<u>237,131,720</u>
Inversiones en acciones(c):		
ProShares SQQQ	-	631,972
Proshares Ultrapro Short QQQS	334,034	-
	<u>9,440,620,443</u>	<u>3,671,151,309</u>

- (a) Corresponden a inversiones de títulos / valores de renta fija emitidos por entidades estatales y privadas, que generan intereses a tasas anuales que oscilan entre 8.90% y 18.5% en pesos dominicanos y para los dólares estadounidenses oscilan entre 5.5% y 10% anual, el rango de vencimiento de estos títulos / valores oscila entre el año 2019 y 2049. Estas inversiones de títulos / valores se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Al 31 de diciembre de 2018, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP213,068,551(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.

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

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

	<u>Al 30 de Junio</u> <u>2018</u>	<u>Diciembre 2018</u>
A- hasta A+	7,420,896,561	3,335,617,319
BBB- hasta BBB+	366,605,516	31,847,933
Menor que BBB-	421,555,292	165,821,940
Calificaciones de riesgo no disponible a la fecha	1,215,304,861	137,864,117
	<u>9,424,362,230</u>	<u>3,671,151,309</u>

Nota. Solo incluye las cuentas del portafolio de inversión.

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

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

	Al 30 de Junio de 2019			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	9,132,359,296	3,577,277,281	5,555,082,016	-
Aportes en fondos de inversión	307,927,113	307,927,113	-	-
Inversiones en acciones	334,034	334,034	-	-
	9,440,620,443	3,885,538,428	5,555,082,016	-

	Diciembre 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	-	-
	3,671,151,309	237,763,692	3,433,387,617	-

Durante el semestre terminado al 30 de junio 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, produjo ganancias netas por un importe ascendente a DOP1,572,751,551 (2018: DOP2,117,017,868), las cuales se incluyen dentro de los resultados por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados integrales que se acompañan.

8. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados

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

	Al 30 de Junio 2018	Al 31 de diciembre 2018
Activo:		
A valor razonable - instrumentos financieros derivados (a)	65,447,733	60,219,789
Pasivo:		
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados (b)	(341,149,870)	(141,111,748)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

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

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
Personas físicas	24,232,584	24,110,039
Personas jurídicas	12,152,165	16,264,004
Intermediarios de valores	21,080,138	9,642,920
Inversionista institucional	6,780,993	1,762,667
Partes relacionadas	1,201,853	547,159
Instituciones financieras	-	7,893,000
	65,447,733	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, la clasificación por nivel de técnica de medición es presentada a continuación:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>			
	<u>Valor Razonable</u>	<u>Nivel 1</u>	<u>Nivel 2</u>	<u>Nivel 3</u>
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	40,692,591	-	40,692,591	-
Banco Central de República Dominicana	19,183,656	-	19,183,656	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	-	-	-	-
Dominican Power Partners	4,369,633	-	4,369,633	-
Consorcio Minero Dominicano, S.A.	-	-	-	-
Ministerio de Hacienda de Costa Rica	1,197,939	-	1,197,939	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	3,914	-	3,914	-
Interactive Brokers LLC	-	-	-	-
	65,447,733	-	65,447,733	-

	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>			
	<u>Valor Razonable</u>	<u>Nivel 1</u>	<u>Nivel 2</u>	<u>Nivel 3</u>
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	47,495,211	-	47,495,211	-
Banco Central de República Dominicana	164,445	-	164,445	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	7,893,000	-	7,893,000	-
Dominican Power Partners	636,339	-	636,339	-
Consorcio Minero Dominicano, S.A.	11,212	-	11,212	-
Interactive Brokers LLC	4,019,582	-	4,019,582	-
	60,219,789	-	60,219,789	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

- (b) A continuación presentamos un 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:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
Personas físicas	(110,175,795)	(38,511,964)
Personas jurídicas	(66,196,180)	(45,779,591)
Intermediarios de valores	(34,624,966)	(7,844,727)
Inversionista institucional	(115,277,283)	(21,052,580)
Partes relacionadas	(3,996,542)	(15,637,590)
Instituciones financieras	(10,879,104)	(12,285,296)
	<u>(341,149,870)</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, la clasificación por nivel de técnica de medición es presentada a continuación:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>			
	<u>Valor Razonable</u>	<u>Nivel 1</u>	<u>Nivel 2</u>	<u>Nivel 3</u>
Instrumentos financieros derivados				
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(261,974,518)	-	(261,974,518)	-
Banco Central de República Dominicana	(70,911,182)	-	(70,911,182)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(1,503,460)	-	(1,503,460)	-
Dominican Power Partners	(5,540,666)	-	(5,540,666)	-
Consortio Remix	(22,106)	-	(22,106)	-
Ministerio de Hacienda de Costa Rica	(1,197,938)	-	(1,197,938)	-
	<u>(341,149,870)</u>	<u>-</u>	<u>(341,149,870)</u>	<u>-</u>

	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>			
	<u>Valor Razonable</u>	<u>Nivel 1</u>	<u>Nivel 2</u>	<u>Nivel 3</u>
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	(204,453)	-	(204,453)	-
Interactive Brokers LLC	(4,019,582)	-	(4,019,582)	-
	<u>(141,111,748)</u>	<u>-</u>	<u>(141,111,748)</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Durante el semestre terminado al 30 de junio de 2019, la Compañía producto de las valoraciones de los instrumentos financieros a su valor razonable derivados, se produjo pérdidas netas por un importe ascendente a DOP468,097,859 (Junio 2018: DOP1,740,583,648), 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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la Compañía mantiene las siguientes transacciones de contratos de títulos valores la cantidad en forwards de títulos de valores:

Al 30 de junio 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	DOP	DOP		
FWD													
Títulos DOP	1,460	9,681,150,000	(279,670,132)	922,430,000	23,816,008	-	51,580,302	5,421,962	(638,053)	(310,868,338)	(1,349,996)	57,002,264	(312,856,388)
Títulos USD	76	488,332,642	(6,272,120)	345,340,000	1,136,789	-	5,886,928	-	(136,523)	(10,797,988)	(87,748)	5,886,928	(11,022,258)
FWD Divisas													
Títulos DOP	336	87,140,000	484,720	2,680,310,000	(15,197,401)	-	2,558,541	-	-	(12,490,840)	(4,780,383)	2,558,541	(17,271,222)
Total	1,872	10,256,622,642	(285,457,532)	3,948,080,000	9,755,397	-	60,025,772	5,421,962	(774,576)	(334,157,166)	(6,218,127)	65,447,733	(341,149,868)

Al 31 de diciembre del 2018

Tipo de Contrato	No. de Operaciones	Nacional				Instrumentos Financieros Derivados a Valor Razonable						Total Activos a Valor Razonable	Total Pasivos a Valor Razonable
		Compra de Cartera		Ventas de Cartera		Posición Activa			Posición Pasiva				
		Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Cantidad U.M. (*) del Contrato	Monto de Contrato	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año	Hasta 7 días	Desde 8 a 360 días	Mayor a 1 año		
		DOP		DOP		DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP		
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

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Instrumentos financieros a su valor razonable - derivados (continuación)

Los contratos derivados financieros emitidos por la entidad, fueron:

	Al 30 de junio de 2019		Al 31 de diciembre de 2018	
	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP
Forward	(275,702,136)	(275,702,136)	(80,891,957)	(80,891,957)

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

	Al 30 de junio de 2019		Al 31 de diciembre de 2018	
	USD	DOP	USD	DOP
Forward	(19,848,012)	(255,854,124)	(48,231,942)	(32,660,015)

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

	Al 30 de junio del 2019			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	(2,617,759)	(14,659,519)	(118,111,803)	(140,313,055)

	Al 31 de diciembre del 2018			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	7,893,000	(13,362,360)	(31,558,951)	(43,863,646)

Las condiciones pactadas para estos contratos, son como sigue:

	Al 30 de junio de 2019				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	(156,083,581)	(115,255,279)	(4,363,276)	-	-

	Al 31 de diciembre de 2018				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	(14,755,909)	(41,316,850)	(24,819,198)	-	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Instrumentos financieros a su valor razonable - derivados (continuación)

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

	<u>Al 30 de Junio de 2019</u>				
	<u>Hasta 1 mes</u>	<u>De 1-3 meses</u>	<u>3 meses a 1 año</u>	<u>De 1-5 años</u>	<u>Más de 5 años</u>
Forward	<u>(170,439,157)</u>	<u>(51,873,290)</u>	<u>(53,389,689)</u>	-	-
	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>				
	<u>Hasta 1 mes</u>	<u>De 1-3 meses</u>	<u>3 meses a 1 año</u>	<u>De 1-5 años</u>	<u>Más de 5 años</u>
Forward	<u>(25,490,528)</u>	<u>(37,300,914)</u>	<u>(18,100,515)</u>	-	-

9. 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 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
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 (en lo adelante "DPP") le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud de del contrato de suministro de Energía y Potencia entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE) y DPP No. 135/14. Por medio de este contrato DPP transfiere la totalidad del crédito por un importe original de US\$16,914,217 equivalente a DOP850,382,575, este contrato devenga interés de 8% anual, con vencimiento en marzo de 2019, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2018, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$574,620 equivalente a DOP28,889,710. Al 30 de junio de 2019, esta inversión fue desmaterializada y quedaron pendientes de cobro de esta inversión un monto de 74,144.51Equivalente en DOP 3,767,928.	3,767,928	879,272,285
En fecha 05 de abril de 2019, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual la empresa Banco Panama, S.A. (en lo adelante "LA CEDENTE") le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud del ACUERDO DE RECONOCIMIENTO DE DEUDA entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE), EDENORTE DOMINICANA, S.A. y LA CEDENTE de fecha 05 de abril de 2019. Por medio de este contrato LA CEDENTE transfiere la totalidad del crédito por un importe original de US\$16,344,220 equivalente a DOP830,592,011, este contrato devenga interés de 7% anual, con vencimiento en julio de 2024, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 30 de junio de 2019, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$16,388,713 equivalente a DOP832,853,067.	832,853,067	-
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 (en lo adelante "DPP") le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud de del contrato de suministro de Energía y Potencia entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE) y DPP No. 135/14. Por medio de este contrato DPP transfiere la totalidad del crédito por un importe original de US\$6,928,389 equivalente a DOP348,333,052, este contrato devenga interés de 8% anual, con vencimiento en marzo de 2019, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 31 de diciembre de 2018, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$189,819 equivalente a DOP9,543,371. Al 30 de junio	1,543,416	357,876,423

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

de 2019, esta inversión fue desmaterializada y quedaron pendientes de cobro de esta inversión un monto de USD\$30,371.02, Equivalente en DOP 1,543,416.

En fecha 09 de mayo de 2019, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual el Mercado Electronico Dominicano(LA CEDENTE) le transfiere a la Compañía su derecho sobre la deuda que se originó en virtud del ACUERDO DE RECONOCIMIENTO DE DEUDA entre la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas estatales (CDEEE), EDESUR DOMINICANA, S.A. y LA CEDENTE., por un importe original deUS\$1,521,634.23 equivalente en DOP77,327,473, este contrato devengaba interés de 7% anual, con vencimiento en julio de 2024, capital pagadero al vencimiento, más intereses pendientes de pago a esa fecha. Al 30 de junio de 2019, incluye intereses por cobrar por un importe de US\$1,499,995 equivalente a DOP76,227,803.02.

76,227,803

-

914,392,214

1,237,148,708

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

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

	<u>Al 30 de junio de</u> <u>2019</u>	<u>Al 31 de</u> <u>diciembre de</u> <u>2018</u>
2019	-	1,237,148,708
2024	914,392,213	-
	<u>914,392,213</u>	<u>1,237,148,708</u>

Al 30 de junio de 2019, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a US\$48,564.83 equivalente a DOP7,779,345 (Diciembre 2018: DOP38,433,081), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado en los estados de situación financiera que se acompañan.

Durante el semestre terminado el 30 de junio 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 DOP66.7 millones (Junio 2018: DOP14.9 millones), los cuales se presentan como resultado por instrumentos financieros – a costo amortizado en los estados de resultados integrales que se acompañan.

10. Otras cuentas por cobrar

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

	<u>Al 30 de junio</u> <u>de 2019</u>	<u>Al 31 de</u> <u>diciembre de</u> <u>2018</u>
Interés por cobrar (a)	64,163,161	29,365,091
Cuentas por cobrar empleados	0	603,981
Anticipos a proveedores	1,000,000	871,836
Cuentas por cobrar a parte relacionada	216,759,123	1,032
Otras	1,242,790	120,424
	<u>283,165,074</u>	<u>30,962,364</u>

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

Año	Sin atraso ni deterioro	Con Atrasos sin Deterioro			Total
		De 1 día y menos de 45 días	De 45 días y menos de 60 días	Más de 60 días	
2019	65,315,585	-	-	217,849,489	283,165,074
2018	29,404,591	1,555,773	-	2,000	30,962,364

11. Inversiones en acciones

Un detalle de las inversiones en acciones de la Compañía es como sigue:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>	<u>Porcentaje 2019</u>	<u>Porcentaje 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)	28,384,353	28,384,353	9.9999%	9.9999%
	<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 de Valores de la República Dominicana, de conformidad con las Resoluciones No. 01 y 04, emitidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana en fechas 3 de mayo de 2004 y 26 de enero de 2005, y se rige por la Ley 19-00 del Mercado de Valores y el reglamento de aplicación de la Ley.

El movimiento de las inversiones en acciones es como sigue:

	<u>Al 30 de Junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 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) Corresponde a adquisición de 18,179 acciones dentro del capital suscrito y pagado de la sociedad Cevaldom a razón de US\$100.94 por cada una, mediante la suscripción de un Acuerdo de Compraventa definitivo en fecha 23 de febrero de 2018 con la sociedad Cavali, S. A, anterior propietaria de las inversiones, con efectividad al 1ro de marzo de 2018.
- (b) Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. fue constituida el 15 de mayo de 2001, bajo la razón social Bolsa Nacional de Valores. Posteriormente, en fecha 8 de abril de 2002, cambió formalmente su nombre a Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. Su objetivo principal es prestar todos los servicios necesarios para la efectiva realización de transacciones con valores, así como toda actividad que contribuya al desarrollo

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

del mercado de valores. La Bolsa de Valores es a su vez propietaria del 34% de CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A.

Al 30 de junio de 2019, los ingresos generados por estas inversiones ascienden a DOP8,321,889 (Junio 2018: 7,791,658), los cuales se presentan en el renglón de resultado de inversiones en sociedades en los estados de resultados integrales que se acompañan.

12. 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:

	Al 30 de junio 2019			
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Valor razonable
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	119,754,552	-	119,754,552
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	4,248,041,288	-	4,248,041,288
	-	4,367,795,840	-	4,367,795,840

	Al 31 de diciembre de 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:

	Junio 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	1,017,439,294	1,586,080,664	1,764,275,882	-	4,367,795,840
	1,017,439,294	1,586,080,664	1,764,275,882		4,367,795,840
	Diciembre 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

Al 30 de junio de 2019 y 2018, la Compañía producto los rendimientos y valoraciones de los pasivos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, se reconoció pérdidas netas por un importe ascendente a

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

DOP62,335,404 (Junio 2018: DOP588,412,074), las cuales se incluyen dentro resultados integrales por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados que se acompañan.

13. Obligaciones con bancos

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

	Al 30 de junio de 2019	Al 31 de diciembre de 2018
<u>Banco Multiple Ademi S.A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 31 de mayo de 2019, por un importe original de DOP100,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 11.00% anual. Con vencimiento en el mes de mayo del 2020, este préstamo esta Garantizado con bonos corporativos emitidos por la Asociación Cibao. Este prestamo continúa vigente al cierre de junio de 2019.	100,000,000	-
<u>Banco Popular Dominicano, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 29 de mayo de 2019, por un importe original de USD18,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 4.50% anual. este préstamo esta garantizado con inversión en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central Dominicano Con vencimiento en el mes de Mayo del 2020, Este prestamo continúa vigente al cierre de junio de 2019.	914,736,600	-
<u>Banco de Reservas de la Republica Dominicana, S. A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 29 de mayo de 2019, por un importe original de USD17,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 5.25% anual, con vencimiento en el mes de mayo del año 2019. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Este prestamo continúa vigente al cierre de junio de 2019.	889,327,250	-
<u>Banco BHD Leo, S.A.</u>		
Préstamo adquirido en fecha 03 de junio de 2019, por un importe original de DOP500,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 9.75% anual, con vencimiento en el mes de agosto del año 2019. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno (nota 10). Este prestamo continúa vigente al cierre de junio de 2019.	500,000,000	-
Préstamo con la Asociación Cibao de Ahorros y préstamos, S. A.		
Préstamo adquirido en fecha fecha 05 de mayo del 2019 y renovado 28 de junio de 2019, por un importe original de DOP400,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 9.75% anual, con vencimiento en el mes de mayo del año 2020. Este préstamo estaba garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano (nota 10). Este prestamo continua vigente al cierre de junio de 2019.	400,000,000	-
	<u>2,804,063,850</u>	<u>-</u>

Al 30 de junio 2019, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP5,736,394, los cuales se incluyen como parte de este rubro de las obligaciones con bancos en los estados de situación financiera que se acompañan.

Al 30 junio de 2019, la Compañía posee obligaciones con bancos por un importe aproximado de DOP2,810,000,000, las cuales están garantizadas con inversiones de títulos / valores de renta fija emitidas por el Ministerio de Hacienda de República Dominicana y el Banco Central de la República Dominicana (nota 10).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

13. Obligaciones con bancos (continuación)

Durante el semestre terminado al 30 de junio de 2019, la Compañía reconoció gastos de intereses por este concepto de obligaciones con bancos DOP73,274,450 (Junio 2018 DOP11,013,012), los cuales se incluyen dentro de los gastos por financiamiento en los estados de resultados integrales que se acompañan.

14. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos

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

	<u>Al 30 de Junio</u> <u>2018</u>	<u>Al 31 de</u> <u>diciembre de</u> <u>2018</u>
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo		
Bonos locales	1,000,000,000	675,000,000
Intereses por pagar sobre bonos locales	14,549,041	13,420,342
	<u>1,014,549,041</u>	<u>688,420,342</u>
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo		
Bonos locales	1,214,549,041	1,288,420,342
Menos: porción corriente de bonos locales	(1,014,549,041)	(688,420,342)
	<u>200,000,000</u>	<u>600,000,000</u>
	<u>1,214,549,041</u>	<u>1,288,420,342</u>

Bonos locales

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Segunda Resolución de fecha 11 de abril de 2018, el Programa de Emisiones de Bonos Corporativos por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-119 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1806-BC0075. Al 30 de junio de 2019, la Compañía mantiene colocado de esta emisión un importe de DOP1,000,000,000. Los títulos devengan una tasa de interés 9% y 9.8% anual, pagaderos de manera trimestral y semestral con vencimiento 2021 y 2023.

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Tercera Resolución de fecha 25 de abril de 2016, el Programa de Emisiones de Bonos Corporativos por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-098 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1604-BC062. Al 30 de junio de 2019, la Compañía mantiene colocado un importe de DOP200,000,000. Los títulos devengan una tasa de interés 10.0% anual, pagaderos de manera semestral con vencimiento en abril de 2019.

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

14. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (continuación)

Bonos locales (continuación)

2019					
Tramos	Monto	Tasa Anual	Fecha de Emisión	Vencimiento	Calendario de Repago
1	200,000,000	10%	27/04/2017	27/04/2020	Pago al vencimiento
1	200,000,000	9%	28/06/2018	28/06/2021	Pago al vencimiento
2	200,000,000	9.5%	28/06/2018	28/06/2023	Pago al vencimiento
4	200,000,000	9.7%	25/04/2019	25/08/2021	Pago al vencimiento
3	200,000,000	9.6%	06/05/2019	25/11/2021	Pago al vencimiento
5	200,000,000	9.8%	26/04/2019	25/11/2021	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	9.6%	27/04/2017	27/04/2020	Pago al vencimiento
1	200,000,000	9.0%	28/06/2018	28/06/2021	Pago al vencimiento
1	200,000,000	9.5%	28/06/2018	28/06/2023	Pago al vencimiento
	1,275,000,000				

Al 30 de junio de 2019, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP14,549,041 (Diciembre 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:

	<u>Al 30 de junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
Saldo al inicio del año	1,275,000,000	875,000,000
Bonos locales emitidos en el año	600,000,000	400,000,000
Llegado a su vencimiento en el año	(675,000,000)	-
Saldo al final del año	1,200,000,000	1,275,000,000

Durante el semestre terminado al 30 de junio de 2019, la Compañía reconoció gastos de intereses por obligaciones por instrumentos financieros emitidos DOP59,519,858 (Junio 2018: DOP42,227,140), los cuales se incluyen dentro de los gastos por de financiamiento en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

15. 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:

		<u>30 de Junio 2019</u>	<u>Al 31 de Diciembre 2018</u>
Saldos:	Vínculo		
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	14,695,472	-
GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	Relacionada	-	143,011,733
Empleados	Relacionados	7,217	-
		<u>14,702,689</u>	<u>143,011,733</u>
Pasivos financieros a su valor razonable:			
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	-	(53,974,891)
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	28,960,485	-
		<u>28,960,485</u>	<u>53,974,891</u>
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	580,810	-
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	1,670,934	547,159
Empleados	Relacionados	444,192	-
		<u>2,695,936</u>	<u>547,159</u>
Pasivos a su valor razonable instrumentos financieros derivados:			
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	14,515,554	-
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	3,996,542	(15,637,590)
Empleados	Relacionados	2,456,148	-
		<u>20,968,244</u>	<u>15,637,590</u>
Cuentas Por Cobrar Relacionadas			
Mercado Electrónico Dominicano, S. A	Relacionada	216,759,123	-
Empleados	Relacionados	443,478	-
		<u>217,202,601</u>	<u>-</u>
Cuentas por pagar a relacionadas:			
Mercado Electrónico Dominicano, S. A	Relacionada	-	(1,437,835)
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	-	(177,259)
Empleados	Relacionados	1,259,410	-
		<u>1,259,410</u>	<u>(1,615,094)</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

15. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

Transacciones:

Resultado por instrumentos financieros

A valor razonable	Relacionada	122,194,489	317,167,270
A costo amortizado	Relacionada	-	-
		<u>-</u>	<u>317,167,270</u>

Gastos de administración y comercialización:

Arrendamientos	Relacionada	(4,379,347)	(6,906,575)
Servicios generales, planeamiento, estrategia y soporte de tecnología	Relacionada	(10,963,717)	(26,911,626)
		<u>(15,343,064)</u>	<u>(33,774,181)</u>

Dividendos (nota 18):

	Accionistas		
Dividendos pagados		-	450,000,000
Retenciones		-	50,000,000
Total		<u>-</u>	<u>500,000,000</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

15. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

Términos y condiciones

Las cuentas por pagar a partes relacionadas no tienen garantías y no causan intereses. Estos saldos son pagaderos en efectivo y en la moneda funcional de la Compañía. Durante el semestre terminado al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, no se ha reconocido ningún deterioro relacionado con estos saldos.

Compensaciones al personal clave

Durante el semestre terminado el 30 de junio de 2019, las compensaciones al personal clave ascienden a aproximadamente DOP50.2 millones (Junio 2018: DOP27.3 millones). Este importe se incluye como parte de los gastos de sueldos y compensaciones al personal en los estados de resultados integrales que se acompañan.

16. Acumulaciones y otras obligaciones por pagar

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

	<u>30 de junio de</u> <u>2019</u>	<u>31 de</u> <u>Diciembre</u> <u>2018</u>
Retenciones por pagar	0	3,588,551
Bonificación por pagar	6,976,445	12,315,782
Incentivo al personal por pagar	57,105,063	56,733,671
AFP Por pagar	170,606	162,684
SFS Por pagar	159,134	152,618
Anticipo de impuestos por pagar	-	120,088
	<u>64,411,248</u>	<u>73,073,394</u>

17. 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.

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.

Al 30 de junio de 2019 la empresa no tiene creada provisión para impuesto sobre la renta.

Al 30 de junio de 2019 el saldo de impuesto diferido activo es de DOP 35,988,543.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Patrimonio

Capital social suscrito y pagado

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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.

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

El movimiento de las acciones en cantidad y valores durante al 30 de junio de 2019 y al año terminado el 31 de diciembre 2018 es como sigue:

	<u>30 de junio de</u> <u>2019</u>	<u>31 de</u> <u>diciembre de</u> <u>2018</u>
Cantidad de acciones:		
<u>Capital social suscrito:</u>		
Número de acciones al inicio	9,000,000	9,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	-
Número de acciones al final	9,000,000	9,000,000
 <u>Capital social suscrito y pagado:</u>	 <u>2019</u>	 <u>2018</u>
Número de acciones al inicio	9,000,000	9,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	-
Número de acciones al final	9,000,000	9,000,000
 <u>Valores:</u>	 <u>2019</u>	 <u>2018</u>
<u>Capital social suscrito:</u>		
Saldo inicial	900,000,000	900,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	-
Saldo final	900,000,000	900,000,000
 <u>Capital social suscrito y pagado:</u>	 <u>2019</u>	 <u>2018</u>
Saldo inicial	900,000,000	900,000,000
Acciones emitidas durante el año	-	-
Saldo final	900,000,000	900,000,000

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018 el capital social suscrito y pagado esta compuesto de la siguiente manera:

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Patrimonio (continuación)

Reserva de capital

El Artículo 46 de la Ley de Mercado de Valores 19-00, establece que las sociedades que realizan transacciones bursátiles deberán efectuar una reserva que corresponde al 20% del total capital pagado de la Compañía. Esta reserva no está disponible para ser distribuida como dividendos, excepto en el caso de disolución de la Compañía. Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la reserva de capital es equivalente a dicho porcentaje.

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

Dividendos pagados

Al 30 de junio de 2019 la compañía no ha declarado dividendos.

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. 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 de Valores de la República Dominicana (SIV) y en la Resolución CNV2005-10-IV "Norma para los Intermediarios de Valores que establece las disposiciones para su funcionamiento". De acuerdo con los índices mantenidos, la Compañía queda clasificada y autorizada para realizar determinadas operaciones bursátiles y financieras.

Al 30 de junio de 2019, la utilidad por acción de la Compañía asciende a DOP128 (2018: DOP90) por cada acción.

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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:

	<u>Junio 2019</u>		<u>Diciembre 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	0.2874	0.155	0.4883	0.155
Índice de patrimonio y garantías de riesgo (Nivel 1)	0.2874	0.103	0.4883	0.103

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

19. 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

	Al 30 de junio de 2019										
Tipo de Contrato	Comisiones		Valor Razonable						A Costo Amortizado		Total
			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	
	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razonable	-	-	1,266,908,679	(2,243,795,485)	1,908,269,093	(64,155,442)	303,944,129	(228,313,344)	-	-	942,857,630
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	875,071,667	(1,304,958,471)	-	-	-	-	-	-	(429,886,804)
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	66,772,383	-	66,772,383
Ingresos por Custodia de Valores	-	(6,001,662)	-	-	-	-	-	-	-	-	(6,001,662)
Ingresos (gastos) por Servicios	1,702,485	(9,701,767)	-	-	-	-	-	-	-	-	(7,999,281)
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(6,465,684)	-	-	-	-	-	-	-	-	(6,465,684)
Total	1,702,485	(22,169,113)	2,141,980,346	(3,548,753,956)	1,908,269,093	(64,155,443)	303,944,129	(228,313,344)	66,772,383	-	559,276,580

	Al 30 de junio de 2018										
Tipo de Contrato	Comisiones		Valor Razonable						A Costo Amortizado		Total
			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	
	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	DOP	
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razonable	-	-	1,275,726,448	(2,134,833,083)	3,345,026,273	(128,501,521)	184,694,693	(202,832,376)	-	-	2,339,280,434
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	776,739,889	(2,517,323,538)	-	-	-	-	-	-	(1,740,583,649)
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	14,888,128	-	14,888,128
Gastos por Custodia de Valores	-	(5,753,649)	-	-	-	-	-	-	-	-	(5,739,649)
Ingresos (gastos) por Servicios	817,728	(2,760,297)	-	-	-	-	-	-	-	-	(1,942,569)
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(2,929,925)	-	-	-	-	-	-	-	-	(2,929,925)
Total	817,728	(11,429,871)	2,052,466,337	(4,652,156,621)	3,345,026,273	(128,501,521)	184,694,693	(202,832,376)	14,888,128	-	602,972,770

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Contingencias y compromisos

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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:

<u>Contingentes</u>	<u>Junio 2019</u>	<u>Dic. 2018</u>
Derechos por Contratos de Compra Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD) menor 365 días	11,261,271,492	8,232,515,996
Derechos por Contratos de Venta Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD) menor 365 días	171,525,425	-
Derechos por Contratos de Venta de Divisas Implícita	2,956,545,281	1,775,088,969
Derechos por Contratos de Compra de Divisas Implícitos	93,463,267	14,997,648
Derechos por Contratos de Compra Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	1,054,436,361	-
Derechos por Contratos de Venta Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	1,041,849,447	-
Derechos por Contratos de Venta Spot de Acciones - Portafolio de Acciones "T"	1,259,410	-
Derechos por Contratos de Compra Spot de Acciones - Portafolio de Acciones "T"	164,482,768	-
Derechos por Contratos de Compra Forward de TVD con un tenor al vencimiento mayor a 365 días	1,189,775,437	569,917,410
Derechos por Contratos de Compra Futuros de TVD	137,413,765	91,967,739
Derechos por Contratos de Venta Futuros de TVD		286,570,569
	<u>18,072,022,653</u>	<u>10,971,058,331</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Contingencias y compromisos (continuación)

Encargos de confianza

Al 30 de junio de 2019, la Compañía refleja a valor nominal, un saldo de DOP18,868,806,769 (Diciembre 2018: DOP18,021,128,900) por títulos valores pertenecientes a terceros objeto 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 DOP4,356,280,500(2018: DOP3,918,143,000) en bancos del país. Estas líneas están garantizadas con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano, títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana y Bonos Corporativos de la Asociación Cibao. Al 30 de junio de 2019, la compañía posee balance de inversiones restringidas puestas en garantías por DOP3,230,975,749 (Diciembre 2018 no poseía). Al 30 de junio de 2018, la Compañía está utilizando de estas líneas de crédito DOP2,804,063,850 (diciembre 2018: No tenía líneas en uso) y posee un balance disponible de DOP1,552,216,650 (Diciembre 2018: DOP3,918,143,000).

Contrato de alquiler

La Compañía mantiene un contrato de arrendamiento operativo con la relacionada Mercado Electronico Dominicana, S. A., como arrendatario, sobre propiedad que utiliza para sus oficinas administrativas, la cual es a largo plazo. El plazo de arrendamiento se extiende hasta cuatro (4) años con renovación a vencimiento, previo acuerdo entre las partes interesadas. Al 30 de junio de 2019, la renta mensual es de DOP729,891 (Junio 2018: DOP729,891). Al 30 de junio de 2019, el gasto por este concepto ascendió a DOP4,379,347 (Junio 2018: DOP2,483,206) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan. En Junio de 2018 se produjo un aumento donde la renta mensual paso de DOP350,663 a DOP729,891.

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

<u>Año</u>	<u>Importe</u>
	<u>DOP</u>
2019	9,196,627
2020	9,656,458
2020	10,139,281
2021	10,646,245
	39,638,611

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 DOP42,000.00 (Junio 2018 DOP30,000) equivalentes al 0.003% de la emisión vigentes. Durante el semestre terminado el 30 de junio de 2019, los gastos por este concepto ascendieron a DOP858,150.9 (Junio 2018: DOP780,000), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. 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 semestres terminados el 30 de junio de 2019 y 2018 los gastos por este concepto ascendieron a DOP372,000 los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados que se acompañan.

La Compañía tiene un acuerdo con CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A., por custodia, transferencia, compensación y liquidación de valores, adicional a esto tiene el compromiso de pagarle de manera mensual DOP5,000.00 por cada emisión vigente. Al 30 de junio de 2019, los gastos por este concepto ascendieron a DOP6,001,662 (Junio 2018: DOP5,739,649), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

La Compañía tiene el compromiso de pagar a la Superintendencia de Valores de la República Dominicana una tarifa por servicio de mantenimiento en el Registro del Mercado de Valores, según lo establece la Resolución R-CNV-2016-41-MV, la cual requiere un aporte anual de DOP4,000,000.00, pagadero en cuatro cuotas trimestrales. Este gasto se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

La Compañía mantiene diversos contratos con una relacionada, la cual realiza facturaciones de manera mensual por concepto de servicios generales, planeamiento, estrategia, servicios digitales y soporte de tecnología. Al 30 de junio de 2019, el importe a pagar mensual es de DOP DOP1,827,633 (Junio 2018: DOP1,882,490). Al 30 de junio de 2019, el gasto por este concepto ascendió a DOP10,963,717 (junio 2018: DOP14,996,699) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

21. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros

Gestión del Riesgo Financiero

La Entidad realiza una gestión proactiva y control integral de los riesgos a los que está expuesta en el desarrollo de sus actividades con el objetivo de identificarlos, transferirlos o minimizar sus efectos, así como monitorear la generación de nuevos riesgos y velar por la continuidad del negocio y sus operaciones en el marco de una gestión rigurosa, transparente, eficiente y enfocada en la creación de valor, siempre en apego a la normativa vigente y a las políticas y manuales internos. La gestión de riesgos de la organización está orientada a la creación y protección de valor para la Entidad, sus clientes y sus accionistas, garantizando una amplia cobertura de todos los riesgos a los que está expuesta y el uso de información completa y veraz, acorde a los lineamientos estratégicos y el apetito de riesgo de la organización.

Los riesgos financieros a los que está expuesta la Entidad son los siguientes:

- a) Riesgo de Mercado: se refiere a la probabilidad de pérdida producto de movimientos adversos de los niveles de las variables de mercado. El riesgo de mercado se divide en riesgo de precios, riesgo de tasas de interés y riesgo de tipo de cambio.
 - Riesgo de Tipo de Cambio: es el riesgo asociado a las fluctuaciones en los tipos de cambio que impacten adversamente el valor de las posiciones de la Entidad.
 - Riesgo de Tasas de Interés: se refiere a la exposición en la condición financiera de la Entidad ante movimientos adversos en las tasas de interés. Se considera a las tasas de interés en su dimensión de rendimientos del mercado y como determinantes no sólo de las oportunidades presentes de créditos, sino

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

- de las futuras reinversiones de flujos, por lo que constituyen un determinante matemático de los precios de los activos financieros.
 - Riesgo de Precios: es la posibilidad a la cual está expuesta la Entidad de disminuir sus ingresos o incurrir en pérdidas como resultado de la variación de los precios de los activos. La dirección de causalidad entre precio y rendimiento del mercado se establece a favor del rendimiento y, en consecuencia, el uso del precio como variable de riesgo es en cuanto al riesgo residual.
- b) Riesgo de Liquidez: se refiere a la probabilidad de que la Entidad incurra en pérdidas por no poder obtener los fondos con los que hacer frente a sus obligaciones en el momento en que se deben cumplir y a un costo razonable. El riesgo de liquidez se divide en:
- Riesgo de Liquidez de Mercado: es la exposición a una pérdida realizada o potencial debido a la incapacidad para liquidar inversiones sin afectar el precio, sujeto a la profundidad del mercado y el balance entre la oferta y la demanda al momento de realizar la liquidación.
 - Riesgo de Liquidez de Fondos: es la exposición a una pérdida potencial como resultado de la incapacidad de la Entidad en obtener los recursos inmediatos para cumplir con los compromisos contractuales y las necesidades del flujo de caja.
- c) Riesgo de Crédito: se origina en la probabilidad de que una de las partes del contrato del instrumento financiero incumpla sus obligaciones contractuales por motivos de insolvencia o incapacidad de pago y produzca a la Entidad una pérdida financiera. El riesgo de crédito se divide en:
- Riesgo de emisor: es el riesgo de que el emisor de un instrumento no abone, en tiempo y forma, los cupones y/o el nominal a vencimiento de las emisiones realizadas tal y como esté establecido en las condiciones contractuales de cada emisión.
 - Riesgo de contraparte: se refiere al incumplimiento definitivo de una obligación por parte de una contraparte o cliente de la Entidad en una operación financiera.
- d) Riesgo Operacional: es la posibilidad de sufrir pérdidas debido a la falta de adecuación o a fallos de los procesos internos, personas o sistemas internos, o bien a causa de acontecimientos externos.

Estructura de Administración del Riesgo

Para una adecuada gestión de riesgos la Entidad ha configurado una estructura organizacional claramente delimitada a nivel de funciones y responsabilidades, así como los niveles de dependencia e interrelación que le corresponde a cada una de las partes que interactúan en la toma de decisiones y cuyas acciones impactan en el nivel de exposición al riesgo.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Si bien es responsabilidad de todos los colaboradores de la organización identificar y gestionar los riesgos asociados al desempeño de sus labores, la administración del riesgo de la Entidad se realiza a través de cuatro (4) áreas de supervisión clave que aseguran que la organización cuente con procesos eficaces y sostenibles, controles estrictos, una gestión robusta de los riesgos y de gobierno, contribuyendo a la protección de valor de la organización, su solvencia y reputación.

1. Consejo de Administración

El Consejo de Administración tiene como función la definición y aprobación de los lineamientos estratégicos y el apetito al riesgo, así como las políticas de gestión de riesgos de la Entidad, además de asegurar la existencia de los recursos necesarios para la correcta implementación de las mismas.

El Consejo de Administración celebra reuniones ordinarias una vez al mes, en las que analiza el grado de cumplimiento de las políticas, estrategias y procedimientos establecidos y previamente aprobados.

2. Alta Gerencia

Por delegación del Consejo de Administración, la Alta Gerencia es responsable de la gestión de los riesgos asumidos por la Entidad, por lo cual está permanentemente informada de la evolución de los distintos ámbitos de riesgo y lidera la ejecución de la estrategia de gestión de riesgos de la organización.

3. Áreas de Control Interno: Análisis y Control de Riesgos, Auditoría Interna y Cumplimiento

3.1. Análisis y Control de Riesgos

El Área de Análisis y Control de Riesgos realiza la labor continua de análisis, medición, monitoreo y control e informa a los órganos, unidades y funcionarios de la Entidad sobre los riesgos cuantificables que se enfrenten a partir de las operaciones y las actividades dentro de la organización.

Toda propuesta de gestión de riesgos y las excepciones a los procesos de administración de los mismos son revisados a través del Comité de Riesgos, el cual se reúne al menos una vez al mes para revisar la gestión de riesgos de la Entidad y dar seguimiento a sus exposiciones. El Comité de Riesgos es responsable de proponer y aprobar la estrategia, las políticas y procedimientos que garanticen una adecuada administración de los riesgos a que se ve expuesta la Entidad en apego a la regulación vigente en materia de gestión de riesgos.

3.2. Auditoría Interna

Los procesos de administración de riesgo a lo largo de la sociedad son auditados permanentemente por el Departamento de Auditoría Interna, el cual examina la suficiencia de los procedimientos y el cumplimiento de éstos. Auditoría Interna discute los resultados de todas las evaluaciones con el Comité de Auditoría y reporta sus hallazgos y recomendaciones al Consejo de Administración como mínimo una vez al mes.

3.3. Cumplimiento

El Departamento de Cumplimiento vela constantemente por la observancia de todas las normas que debe seguir la Entidad como sujeto obligado, en virtud de la supervisión ejercida por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana, en especial aquellas relativas al área de prevención y control de lavado de activos y financiamiento al terrorismo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

El Comité de Cumplimiento revisa al menos una vez al mes las políticas, procedimientos y controles aprobados por el Consejo de Administración e implementados por la empresa para cumplir con las disposiciones para la prevención del lavado de activos, financiamiento al terrorismo y la proliferación de armas de destrucción masiva en el mercado de valores dominicano.

4. Áreas de Negociación

El Departamento de Tesorería, junto con el Área de Análisis y Control de Riesgos, tiene la responsabilidad de plantear estrategias para administrar el riesgo de liquidez asociado a la disponibilidad de recursos monetarios con el objeto de minimizar el impacto de la contracción de las fuentes de liquidez en la Entidad.

El Departamento de Trading interviene en el proceso de identificación de oportunidades de negocios y, por tanto, es parte integral del proceso de gestión de riesgos, participando en el proceso de análisis de condiciones de tasas, tipos de cambio y precios, cuyos niveles y volatilidades generan expectativas de beneficios o pérdidas.

Objetivos, Políticas y Procesos de Gestión de Riesgos

Para cada uno de los riesgos definidos anteriormente, la Entidad ha establecido principios, lineamientos, procedimientos y metodologías, contenidos en el Manual de Políticas y Gestión de Riesgos con la finalidad de realizar una administración integral de los riesgos a los que está expuesta en el desarrollo de sus actividades.

Riesgo de Mercado

La gestión del riesgo de mercado de la Entidad se encuentra detallada en el Manual de Políticas y Gestión de Riesgos, el cual establece metodologías para la identificación, medición, mitigación y transferencia, evaluación y reporte de posiciones financieras y de riesgo de mercado según los modelos internos de la Entidad, como la definición de los correspondientes límites y parámetros cuando corresponda.

La Entidad reconoce que el riesgo de mercado no sólo es inherente a su negocio como parte de los riesgos o tensiones que necesita prever, sino como parte de la misma naturaleza del negocio y, por tanto, una buena parte del riesgo de mercado es gestionado como oportunidad de negocios y no como riesgo mismo, tanto en lo referente a sus posiciones propias, como a los negocios que realiza para y con sus clientes.

La Entidad identifica tres categorías de riesgo de mercado que responden a tres variables a las que la Entidad atribuye la sensibilidad de sus posiciones y balances: tasas de interés, tipos de cambio y precios. Para efectos de la identificación de riesgos, la Entidad observa y monitorea constantemente el comportamiento de dichas variables, atendiendo a los volúmenes y niveles históricos de las mismas, así como cualquier evento extraordinario que altere el flujo normal del mercado en cuanto a sus expectativas.

Al cierre de junio 2019 el portafolio disponible de inversiones se compone en un 69% de activos denominados en pesos dominicanos y un 31% de instrumentos denominados en dólares estadounidenses. Asimismo, al 31 de diciembre de 2018 el portafolio de inversiones se compone en un 56.49% de activos denominados en dólares estadounidenses y un 43.51% en instrumentos denominados en pesos dominicanos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

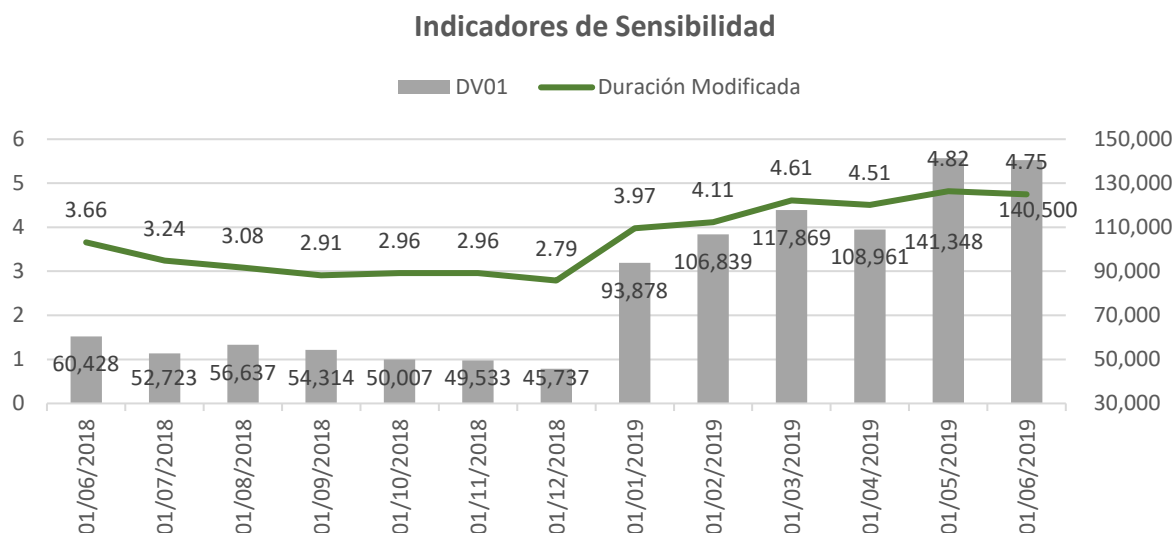
21. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros (continuación)

Composición Portafolio de Inversiones Disponible		
Concentración por Moneda	30/06/2019	31/12/2018
Pesos Dominicanos	68.69%	43.51%
Dólar Estadounidense	31.31%	56.49%
Total	100.00%	100.00%

La Entidad calcula y monitorea indicadores de sensibilidad, entre los cuales se pueden mencionar la duración, la duración modificada y el valor dólar de un punto básico (DV01); así como indicadores específicos de riesgo como el valor en riesgo. Además, la Entidad mantiene constante vigilancia a los límites de exposición y parámetros de riesgo de mercado establecidos internamente como los de carácter regulatorio.

- Duración y DV01

La siguiente gráfica muestra el comportamiento de los últimos 12 meses de los principales indicadores de sensibilidad, los cuales reflejan un aumento significativo en la exposición del portafolio total a cambios en los precios de sus instrumentos respecto al nivel registrado al cierre de diciembre 2018. Específicamente, la duración modificada, medida del plazo promedio ponderado de los activos sensibles a tasas de interés que componen el portafolio total de inversiones de la Entidad, aumentó de 2.79 a 4.75 en los cierres de diciembre 2018 y junio 2019, respectivamente.



El DV01 mide el cambio expresado en dólares estadounidenses en el valor de las posiciones como resultado de la variación de la tasa de interés en un punto básico (0.01%). Como puede visualizarse en la gráfica, el DV01 aumentó en US\$94,763 respecto a diciembre 2018, situándose al cierre de junio 2019 en US\$140,500.

Estos cambios responden primordialmente al crecimiento sostenido del portafolio de inversión que cuenta con importantes posiciones al cierre de junio de 2019 en títulos emitidos por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, destacándose las posiciones con vencimiento en los años 2026, 2028 y 2034, además de la participación de los bonos con vencimiento en el año 2029 emitidos por Gulfstream Petroleum Dominicana. La participación de bonos emitidos por el

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Banco Central y los bonos de la Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte (EDENORTE) también cuentan con una participación importante y presentan incrementos significativos en los períodos bajo comparación.

- Valor en Riesgo (VaR)

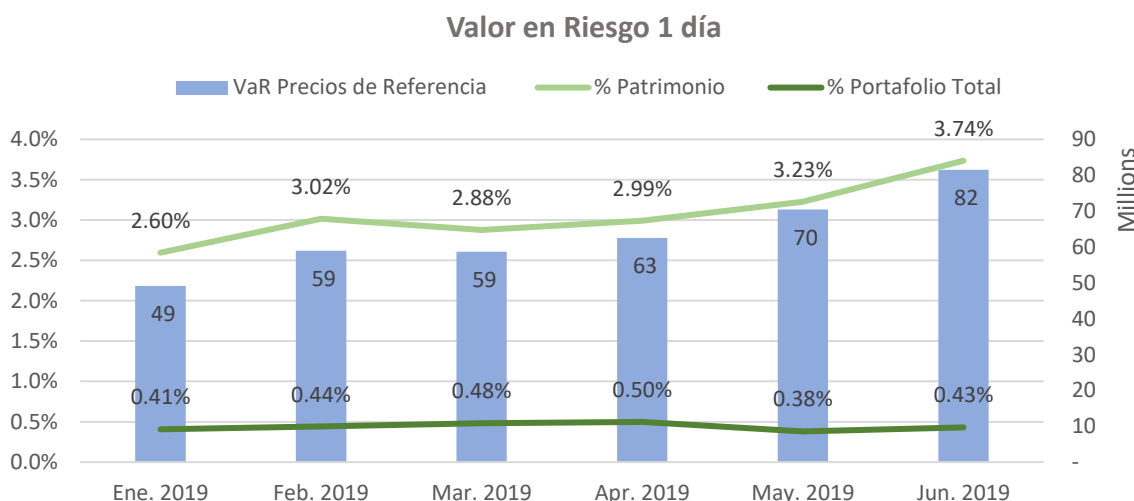
Complementariamente, se estima el riesgo de mercado a nivel de portafolio a través del indicador específico de riesgo llamado valor en riesgo, el cual expresa en términos monetarios la máxima pérdida o ganancia que podría experimentar el portafolio de inversiones dentro de horizontes temporales establecidos, dado un nivel de confianza establecido.

Para estimar el riesgo de mercado a nivel de portafolio se parte de la fórmula general:

$$VAR = Valor\ de\ Mercado * Nivel\ de\ Confianza * \sigma Rendimiento * \sqrt{Horizonte}$$

En esta fórmula, el concepto de rendimiento se refiere al rendimiento de negociación, por lo que se estima a partir de la variación logarítmica diaria del valor de mercado de la posición. Se utiliza un nivel de confianza del 95% y el horizonte de tiempo de 1 día. El término de volatilidad se calcula a través de la aplicación de una matriz de varianzas y covarianzas y un vector de pesos relativos de las posiciones del portafolio para fines de obtener la varianza y desviación estándar del portafolio.

El Valor en Riesgo de un (1) día promedia en el año 2019 63.5 millones de pesos, lo cual representa sólo un 0.43% del portafolio neto promedio de 14,777 millones de pesos. Específicamente, el Valor en Riesgo de 1 día al cierre de Junio 2019 se sitúa alrededor de los 82MM de pesos dominicanos, representando un 0.43% del portafolio neto y un 3.74% del patrimonio, muy por debajo de los límites aprobados por el Consejo de Administración.



La mitigación de riesgos es una labor que forma parte del día a día de los tomadores de riesgos y consiste en proteger a la Entidad de los riesgos existentes, consecuencia de variaciones en el mercado, a través de un conjunto de estrategias diseñadas para lograr la reducción, transferencia o anulación del riesgo. Si bien la Entidad no requirió la utilización de coberturas en los períodos de referencia, podría implementar coberturas por balance, cobertura a través de instrumentos derivados y estrategias de diversificación, según se muestra a continuación:

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Tabla I
Mecanismos de Mitigación y Transferencia

COBERTURA POR BALANCE	Posiciones de signo opuesto con igual o similar sensibilidad Permuta Financiera de títulos valores
COBERTURA CON INSTRUMENTOS DERIVADOS	Permuta Financiera de tasas de interés Permuta Financiera de divisas Contratos a plazo de tipo de interés o Forward Rate Agreement (FRA) Caps, Floors, y Collars Forwards y Futuros Opciones
ESTRATEGIAS DE DIVERSIFICACIÓN	Diversificar a través de diferentes sectores y tipos Diversificar dentro de cada clase de activos Diversificar por horizontes de tiempo Diversificar por zonas geográficas

Riesgo de Liquidez

La gestión del riesgo de liquidez de la Entidad se encuentra definida en su Manual de Políticas y Gestión de Riesgos, la cual establece metodologías de identificación, medición, mitigación y transferencia, evaluación y remisión de información relevante de exposición al riesgo de liquidez que surge de la posibilidad de que la Entidad no cuente con los recursos necesarios para hacerle frente a los compromisos en un determinado período de tiempo.

La liquidez se construye a partir de condiciones contractuales y de gestión de activos financieros, mediante la estructuración del tiempo o producto del calce mismo de las aperturas y cierres de posiciones de toda naturaleza.

De manera diaria se monitorea la estructura natural de los flujos de efectivo resultantes de las operaciones y el balance de las fuentes de liquidez. Se establecen grados de liquidez aceptables para bandas de tiempo determinadas y una vez identificados posibles descalces de los flujos pactados, se evalúa la capacidad de cobertura razonable de las fuentes especiales de liquidez, normalmente las líneas de crédito pactadas con anticipación.

La Entidad ha mantenido una adecuada posición en activos líquidos para cumplir con sus compromisos contractuales y responder a sus necesidades de liquidez. Al cierre de junio 2019 las reservas de activos líquidos de alta calidad superan los 2,012 millones de pesos y las otras reservas de activos líquidos ascienden a 597 millones de pesos. La salida neta de liquidez de 30 días al cierre de junio se sitúa cercana a los 6,425 millones de pesos y las reservas de activos líquidos esperadas para dicho período superan los 3,507 millones de pesos, situando el ratio de cobertura de liquidez en 0.95.

El Ratio de Cobertura de Liquidez mide la capacidad que tiene el intermediario de valores para cumplir con todos sus pactos a treinta (30) días, dada la disponibilidad de reservas de activos líquidos que se caracterizan por la posibilidad de ser convertidos en efectivo oportunamente y con mínimo impacto en el precio. Es importante destacar que el ratio de cobertura de liquidez considera los activos líquidos del portafolio disponible, así como aquellas reservas líquidas que funcionan como activos subyacentes en operaciones a plazo con liquidación y por tanto con disponibilidad inmediata en el período de 30 días.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

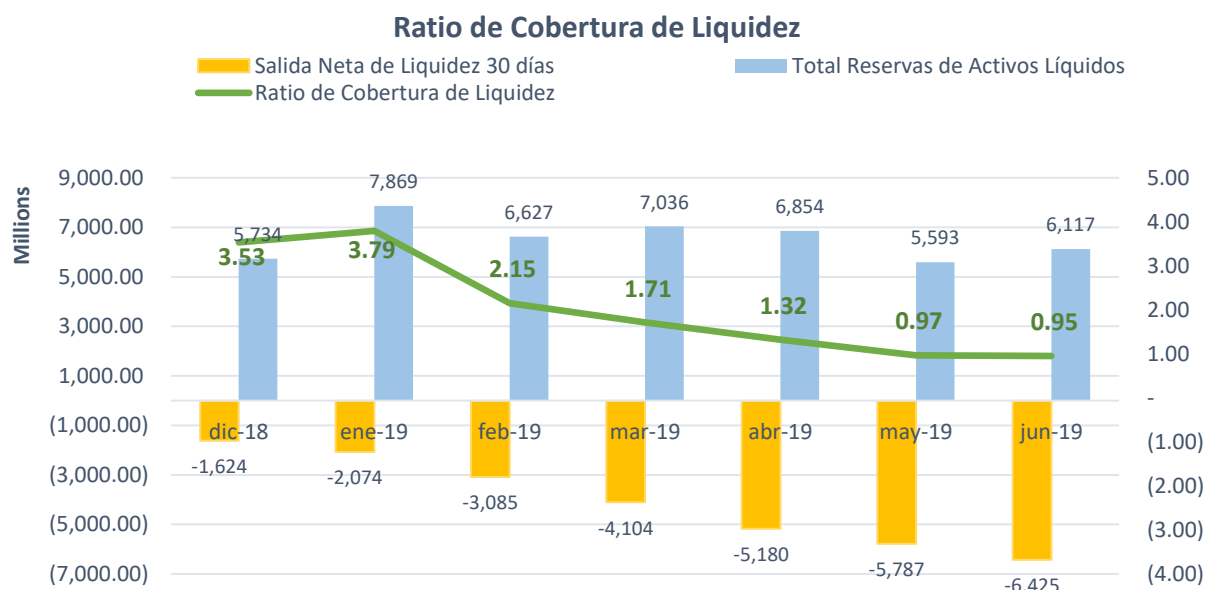
Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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



Complementariamente, se vigilan los plazos y volúmenes de las operaciones pactadas con el fin de evaluar el estado de los límites y parámetros establecidos respecto al patrimonio de la Entidad.

La Entidad concentra sus esfuerzos de mitigación de riesgo de liquidez en las siguientes acciones:

1. El mantenimiento de facilidades financieras, tales que puedan accederse de forma oportuna y con un costo razonable ante los previsible gaps deficitarios de liquidez operativa. Estas fuentes de liquidez contingente se diversifican en la medida de lo posible, a efecto de disminuir el riesgo sistémico en contingencias de grado mayor.
2. La externalización del fenómeno de liquidez de forma anticipada mediante reportes diarios y su divulgación interna para los tomadores de decisiones a efectos de que se conozcan las necesidades y debilidades de la liquidez en términos de volúmenes y plazos.
3. Optimizar el gap de títulos a efectos de evitar alteraciones del costo de fondos o las premisas de resultados de otras posiciones, forzados por los faltantes en los flujos de instrumentos no previstos.

Riesgo de Crédito

La gestión del riesgo de contraparte de la Entidad se encuentra detallada en el Manual de Políticas y Gestión de Riesgos, el cual establece políticas, procedimientos y metodologías para la identificación, medición, control, mitigación y comunicación del nivel de exposición a este tipo de riesgo.

Tanto a efectos de riesgo de insolvencia como de riesgo país, el riesgo de crédito de un determinado emisor o emisión es medido por agencias dedicadas a la evaluación o calificación de riesgos mediante ratings que recogen una clasificación cualitativa y cuantitativa de la capacidad que tiene un activo o entidad para generar los flujos prometidos.

La Entidad lleva a cabo un monitoreo constante de la concentración por emisor en su portafolio de inversiones, así como la aplicación estricta de la evaluación del perfil de las contrapartes y su renovación con periodicidad establecida para identificar cambios de patrones o comportamientos, dadas nuevas administraciones o experiencias de mercado adquiridas por la contraparte. Los niveles de concentración se evalúan respecto al cumplimiento de límites y parámetros establecidos para la gestión de riesgo de contraparte.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

El portafolio de inversiones disponible superó los 10,117 millones de pesos al cierre de junio 2019 reflejando un aumento del 112% respecto al cierre de diciembre 2018. En términos de concentración, los instrumentos emitidos por el Ministerio de Hacienda y el Banco Central de la República Dominicana representan un 49.22% del portafolio, cerca de un 21% se compone de valores de reconocimiento de deuda de la Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte (EDENORTE) y no se mantiene ninguna otra posición que supere el 20% del portafolio. Respecto al cierre de diciembre 2018, el portafolio de inversiones disponible ascendió a 4,773.8 millones de pesos y la concentración en títulos del Ministerio de Hacienda y del Banco Central de la República Dominicana fue del 54% del portafolio, un 25% se compuso de facturas de corto plazo emitidas por la Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas Estatales y no se mantuvo ninguna otra posición que superara el 20% del portafolio.

La siguiente tabla muestra la exposición al riesgo de contraparte según la categoría de emisor:

Composición Portafolio de Inversiones		
Emisor	30-jun-19	31-dic-18
Ministerio de Hacienda de la R.D.	39.16%	35.64%
Banco Central de la R.D.	10.06%	18.70%
Corporación Dominicana de Empresas Eléctricas Estatales	0.00%	25.11%
Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte	20.94%	0.00%
Otros Emisores	29.84%	20.55%
Valor del Portafolio	10,117,906,549	4,773,831,734

La Entidad califica los títulos valores emitidos por el Banco Central de la República Dominicana y el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana en el mercado local en el nivel AAA alineado a la consideración de estas inversiones como activos de alta calidad y de bajo riesgo. Los activos con calificación igual o superior a la calificación deuda soberana de República Dominicana (BB-) se consideran como grado de inversión y representan el 73% del portafolio de inversiones para el 31 de diciembre de 2018 y el 74% del portafolio de inversiones para el cierre de junio de 2019. No obstante, considerando la posición de la Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte, que aún no cuenta con calificación oficial, pero que cuenta con una calificación interna basada en riesgo del gobierno dominicano, se podría decir basado en esta consideración, que el 95% del portafolio tiene grado de inversión.

Composición Portafolio de Inversiones		
Clasificación Oficial	30-jun-19	31-dic-18
Grado de Inversión	74%	73%

Complementariamente, la Entidad mide su exposición al riesgo de crédito a través del Índice de Patrimonio y Garantías de Riesgo, garantizando constantemente la adecuación del patrimonio y garantías de riesgo de la empresa para un nivel de operaciones activas y contingentes registradas en sus libros ajustadas por factores de ponderación de riesgo, en apego a las disposiciones establecidas en el Manual de Contabilidad y Plan de Cuentas de la Superintendencia de Valores de la República Dominicana. Los factores de ponderación de riesgo se establecen por categorías y miden el riesgo de crédito directo, el riesgo de crédito emisor y el riesgo de crédito de contraparte de las cuentas de activos y cuentas contingentes.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

El Índice de Patrimonio y Garantías de Riesgo representa una metodología dinámica de control de riesgo y de balance no restrictiva a disposición de la Entidad, que permite a ésta:

- Escoger balanceadamente el nivel de riesgo de crédito de las actividades que la Entidad realiza, acorde con el nivel de capitalización y garantías patrimoniales de la Entidad; o,
- Ajustar el tamaño del balance de la Entidad para acometer actividades que impliquen un mayor nivel de riesgo de crédito en línea con el nivel de capitalización y garantías patrimoniales de la Entidad; o,
- Aumentar la capitalización o garantías patrimoniales que respaldan la Entidad para acometer en mayor dimensión actividades que impliquen un nivel de riesgo de crédito más alto.

Riesgo Operacional

La gestión de riesgo operacional en la Entidad exige la verificación y monitoreo de los productos, actividades, procesos y nuevos sistemas frente a las estrategias y políticas de la Entidad, de modo que se minimice la posibilidad de pérdidas financieras asociadas al diseño inapropiado de los procesos críticos o a políticas y procedimientos inadecuados o inexistentes.

El Área de Análisis y Control de Riesgos, en colaboración con Auditoría Interna, mantiene una base de datos de procesos críticos y actualiza de manera periódica la matriz de riesgo operacional y mapa de riesgos de la Entidad. Respaldado por el Manual de Continuidad de Negocios y otros mecanismos oportunos, tales como seguros y coberturas contra siniestros y desastres naturales, se asume un activo compromiso de lograr una gestión integral de los riesgos con el objetivo de reducir los impactos derivados de una interrupción operativa, garantizar la preservación de la reputación corporativa y el enfoque al crecimiento y las ventajas competitivas debido a la demostrada capacidad de mantener la calidad y la entrega de servicios de la Entidad.

Auditoría Interna verifica que la Entidad mide y controla adecuadamente los riesgos operativos, de conformidad con las políticas y procedimientos establecidos por el Consejo de Administración, así como el Manual Administrativo, el Manual de Políticas y Procedimientos, el Manual de Políticas y Gestión de Riesgos y la normativa vigente.

La Política de Gestión de Riesgo Operacional de ALPHA se encuentra detallada en el Manual de Políticas y Gestión de Riesgos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Uso de Estimaciones y Juicios Contables.

La Entidad cuenta con una Política de Valoración de Títulos Valores de Deuda (en lo adelante Política de Valoración) que establece principios, lineamientos y procedimientos para la medición y el ajuste a valor de mercado de los instrumentos aplicables.

Dentro del marco de una estrategia macroprudencial que busca mantener la estabilidad financiera, la Entidad permite la constitución de una provisión de riesgo de mercado con el fin de proteger a la Entidad de fluctuaciones en las tasas de interés del mercado que pudieran tener un efecto material adverso en las utilidades de la empresa.

La provisión de riesgo de mercado, cuyos límites mínimo y máximo vienen dados por datos observables de mercado, impacta directamente en la medición del valor razonable de los activos o pasivos financieros y obedece a la estrategia conservadora de valoración que mantiene la Entidad, el nivel de apetito al riesgo y las perspectivas propias de la empresa respecto al comportamiento del mercado.

La Entidad construye periódicamente una Curva YTM de Referencia para los instrumentos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana y el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, la cual es una proyección realizada con regresión lineal basada en observaciones disponibles de los últimos 30 días. Además, calcula un coeficiente de riesgo de mercado basado en la desviación máxima de las tasas de rendimiento de los últimos 12 meses de un título representativo del mercado. Ambos componentes se consolidan en la forma de una banda contracíclica que permite a la metodología reducir la volatilidad en la valoración, amortiguar las deficiencias de las fuentes de información y cubrir el riesgo de movimientos de precios por la liquidación o slippage en mercados poco activos como el de títulos valores de deuda de la República Dominicana.

El valor razonable de instrumentos cotizados en mercados activos se determina utilizando cotizaciones diarias a través de sistemas información electrónica (como por ejemplo, Bloomberg). En el caso de que no exista información en mercados activos se podrá utilizar información de proveedores externos de información de mercado, precios de transacciones similares e información histórica para validar los parámetros de valoración.

El Área de Análisis y Control de Riesgos vigila activamente la valoración de los instrumentos financieros y se asegura a través de estrictos controles internos que se cumplan los límites máximos y mínimos establecidos. Para controlar que los parámetros de mercado que la Entidad utiliza en la valoración de los instrumentos financieros corresponden al estado actual del mercado, en forma diaria se ejecuta un proceso de verificación independiente de precios y tasas.

La Entidad, en consideración con las metodologías descritas anteriormente, clasifica los instrumentos financieros que posee en el portafolio de inversiones en los siguientes niveles:

Nivel I: son aquellos instrumentos financieros cuyo valor razonable es realizado con precios cotizados (sin ajustar) en mercados activos para activos o pasivos idénticos. Para estos instrumentos existen cotizaciones de mercado observables, por lo que no se requieren supuestos para valorizar.

Dentro de este nivel se encuentran primordialmente las inversiones en fondos cerrados, fondos abiertos, acciones, bonos emitidos por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana en el mercado internacional, deuda soberana extranjera que cotiza en mercados internacionales y bonos corporativos emitidos en el mercado local.

Nivel II: son instrumentos financieros cuyo valor razonable es realizado con variables distintas a los precios cotizados en Nivel I que sean observables para el activo o pasivo, directamente (es decir, como precios) o indirectamente (obtenidos a partir de los precios). Dentro de esta categoría se incluyen:

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

- a) Precios cotizados para activos o pasivos similares en mercados activos.
- b) Precios cotizados para activos o pasivos idénticos o similares en mercados que no son activos.
- c) Datos de entrada distintos de los precios cotizados que son observables para el activo o pasivo.
- d) Datos de entrada corroborados por el mercado.

En este nivel se encuentran principalmente los bonos emitidos por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana y el Banco Central de la República Dominicana en el mercado local, así como bonos corporativos de empresas del país emitidos en el mercado local.

Nivel III: son aquellos instrumentos financieros cuyo valor razonable es determinado utilizando datos de entrada no observables.

La siguiente tabla muestra la clasificación por niveles de los instrumentos financieros registrados a valor razonable correspondientes al cierre de junio de 2019:

Activos Financieros	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total RD\$
<i>Inversiones en Instrumentos Financieros:</i>				
<i>Instrumentos a Valor Razonable Cartera Disponible</i>	3,423,632,749	2,248,431,298	-	5,672,064,047
<i>Rendimientos por Cobrar Cartera Disponible</i>	21,930,114	60,011,673	-	81,941,788
<i>Instrumentos para Negociación</i>	3,445,562,864	2,308,442,971	-	5,754,005,835
<i>Renta Fija Cartera Restringida</i>	130,026,910	3,100,948,839	-	3,230,975,749
<i>Rendimientos por Cobrar Cartera Restringida</i>	1,687,507	129,439,255	-	131,126,762
<i>Valor Mercado Renta Variable</i>	308,253,883	-	-	308,253,883
<i>Instrumentos a Valor Razonable Valoración Spot</i>	7,241	16,250,973	-	16,258,214
<i>Otros Instrumentos</i>	439,975,541	3,246,639,068	-	3,686,614,608
A Valor Razonable con Cambios en Resultados	3,885,538,405	5,555,082,038	-	9,440,620,443
<i>Derivados Negociación: FWD</i>	1,151,670	61,687,339	-	62,839,009
<i>Otros derivados: FWD Divisa Implícita y Futuros</i>	50,183	2,558,541	-	2,608,725
Instrumentos Financieros Derivados	1,201,853	64,245,880	-	65,447,733
Total	3,886,740,258	5,619,327,919	-	9,506,068,177
Pasivos Financieros	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total RD\$
<i>Pasivos Indexados a Valores</i>	-	4,336,643,468	-	4,336,643,468
<i>Valoración Spot</i>	-	31,152,372	-	31,152,372
Instrumentos a Valor Razonable	-	4,367,795,840	-	4,367,795,840
<i>Derivados Negociación: FWD</i>	2,723,505	321,155,144	-	323,878,648
<i>Otros derivados : FWD Divisa Implícita</i>		17,271,222	-	17,271,222
Instrumentos Financieros Derivados	2,723,505	338,426,366	-	341,149,871
Total	2,723,505	4,706,222,206	-	4,708,945,711

La categoría de Activos Financieros a Valor Razonable con Cambios en Resultados está integrada por el valor en libros de los instrumentos de deuda, así como los rendimientos por cobrar de dichos activos. Además, incluye el valor contable de los instrumentos de renta variable de la cartera de inversiones, así como la valoración de las operaciones spot vigentes a la fecha referida.

El 59% del valor de esta categoría (RD\$5,555,082,038) está clasificada dentro del Nivel II de la jerarquía de valor razonable y está compuesto primordialmente (93%) por el valor y rendimientos por cobrar de los títulos emitidos por el Banco Central

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

de la República Dominicana y el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, alineados a la estrategia conservadora de la Política de Valoración de la Entidad descrita anteriormente. El 41% restante está clasificado dentro del Nivel I de la jerarquía de valor razonable y está compuesto principalmente por bonos corporativos locales y valores estructurados de reconocimiento de deuda de la Empresa Distribuidora de Electricidad del Norte.

La categoría Instrumentos Financieros Derivados incluye la valoración de las operaciones forward vigentes a la fecha referida, los contratos de futuros y las operaciones a plazo con divisa implícita, las cuales se clasifican según el nivel asignado al título valor de deuda asociado a dichas operaciones.

Complementariamente, los pasivos financieros reflejados en la tabla corresponden al valor de mercado de los préstamos de títulos valores vigentes, las pérdidas por ajustes a valor de mercado de las operaciones spot y de las operaciones forward, así como la reducción en valor de las operaciones a plazo con divisa implícita. La clasificación según la jerarquía de valor razonable se asigna de acuerdo al título valor asociado a las operaciones referidas.

La siguiente tabla muestra la clasificación por niveles de los instrumentos financieros registrados a valor razonable correspondientes al 31 de diciembre de 2018:

Activos Financieros	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total RD\$
<i>Inversiones en Instrumentos Financieros:</i>				
<i>Instrumentos a Valor Razonable Cartera Disponible</i>	1,335,922,126	2,001,234,540	-	3,337,156,665
<i>Rendimientos por Cobrar Cartera Disponible</i>	23,173,423	72,861,046	-	96,034,469
<i>Instrumentos para Negociación</i>	1,359,095,549	2,074,095,586	-	3,433,191,134
<i>Renta Fija Cartera Restringida</i>	195,582	-	-	195,582
<i>Rendimientos por Cobrar Cartera Restringida</i>	900	-	-	900
<i>Valor Mercado Renta Variable</i>	237,763,692	-	-	237,763,692
<i>Instrumentos a Valor Razonable Valoración Spot</i>	-	-	-	-
A Valor Razonable con Cambios en Resultados	1,597,055,723	2,074,095,586	-	3,671,151,309
A Costo Amortizado				2,086,124,818
<i>Derivados Negociación: FWD</i>	9,825,069	40,904,492	-	50,729,561
<i>Otros derivados: FWD Divisa Implícita</i>		9,490,229		9,490,229
Instrumentos Financieros Derivados	9,825,069	50,394,721	-	60,219,789
Total	1,606,880,792	2,124,490,306	-	3,731,371,098
Pasivos Financieros	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	Total RD\$
<i>Pasivos Indexados a Valores</i>	2,508,051	4,140,767,183	-	4,143,275,233
<i>Valoración Spot</i>	-	-	-	-
Instrumentos a Valor Razonable	2,508,051	4,140,767,183	-	4,143,275,233
<i>Derivados Negociación: FWD</i>	45,912,988	81,036,834	-	126,949,822
<i>Otros derivados : FWD Divisa Implícita</i>		14,161,926		14,161,926
Instrumentos Financieros Derivados	45,912,988	95,198,760	-	141,111,748
Total	48,421,039	4,235,965,942	-	4,284,386,981

La categoría de Activos Financieros a Valor Razonable con Cambios en Resultados está integrada por el valor en libros de los instrumentos de deuda, así como los rendimientos por cobrar de dichos activos. Además, incluye el valor contable de los instrumentos de renta variable de la cartera de inversiones, así como la valoración de las operaciones spot vigentes a la fecha referida.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

El 56.5% del valor de esta categoría (RD\$2,074,095,586) está clasificada dentro del Nivel II de la jerarquía de valor razonable y está compuesto primordialmente (85%) por el valor y rendimientos por cobrar de los títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana y el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, alineados a la estrategia conservadora de la Política de Valoración de la Entidad descrita anteriormente.

La categoría Instrumentos Financieros Derivados incluye la valoración de las operaciones forward vigentes a la fecha referida y las operaciones a plazo con divisa implícita, las cuales se clasifican según el nivel asignado al título valor de deuda asociado a dichas operaciones.

Complementariamente, los pasivos financieros reflejados en la tabla corresponden al valor de mercado de los préstamos de títulos valores vigentes, la partida de pasivos de la valoración de las operaciones spot y de las operaciones forward, así como la reducción en valor de las operaciones a plazo con divisa implícita. La clasificación según la jerarquía de valor razonable se asigna de acuerdo al título valor asociado a las operaciones referidas.

22. 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 periodos terminados el 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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 y instrumentos financieros emitidos y el efectivo y equivalentes de efectivo) entre la sumatoria del pasivo neto y el patrimonio.

	<u>Al 30 de Junio de 2019</u>	<u>Al 31 de diciembre de 2018</u>
Pasivos financieros a valor razonable	4,367,795,840	4,143,275,233
Instrumentos financieros derivados	341,149,870	141,111,748
Obligaciones con bancos y obligaciones por instrumentos financieros emitidos	4,024,349,285	1,288,420,342
Otras cuentas por pagar	16,111,686	31,572,619
Cuentas por pagar a relacionadas	1,259,410	1,615,094
Acumulaciones y otras obligaciones	67,029,535	73,073,394
Menos – Efectivo en caja y bancos	(121,946,350)	(1,501,082,632)
Pasivo neto	8,695,749,276	4,177,985,798
Patrimonio	2,239,329,492	1,902,016,180
Capital neto	10,935,078,768	6,080,001,978
	0.79	0.68

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. 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:

	<u>30 de junio de 2019</u>		<u>31 de diciembre de 2018</u>	
	<u>Valor en libros</u>	<u>Valor razonable</u>	<u>Valor en Libros</u>	<u>Valor razonable</u>
Pasivos financieros				
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	(1,214,549,041)	(1,214,549,041)	(1,288,420,342)	(1,299,397,444)
	<u>(1,214,549,041)</u>	<u>(1,214,549,041)</u>	<u>(1,288,420,342)</u>	<u>(1,299,397,444)</u>

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

Al 30 de Junio de 2019 y 30 de Junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Valores razonables (continuación)

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

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

24. Cambios en pasivos provenientes de actividades de financiamiento

Junio 2019					
	1ro. de enero de 2019	Flujo de efectivo		Movimiento en moneda extranjera	30 de junio de 2019
		Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados		
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (a)	1,275,000,000	1,599,850,000	(1,674,850,000)	-	1,200,000,000
Obligaciones con bancos (b)	-	17,229,926,664	(14,438,063,014)	12,200,200	2,804,063,850
	<u>1,275,000,000</u>	<u>18,829,776,664</u>	<u>(16,112,913,014)</u>	<u>12,200,200</u>	<u>4,004,063,850</u>
Diciembre 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 30 de junio de 2019, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones por instrumentos financieros emitidos ascendentes a DOP14,549,041 (Diciembre 2018: DOP 13,420,342).

(b) Al 30 de junio de 2019, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones con bancos ascendentes a DOP5,736,394.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018:

Al 30 de junio de 2019

1. Equivalentes de efectivo DOP

1. Equivalentes de efectivo DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participación
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

2.2 Acciones USD:

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

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
DO8014600126	Fondo de Inversión Cerrado Renta Inmobiliaria Dolares Popular	1,000,000.00	1,022,603.66	1,022,844.00	240.34	USD	N/A	43%
US74347G4082	Proshares Ultrapro Short Qqq Split	187.00	7,782.94	6,573.05	1,209.89	USD	N/A	0%
DO9014000119	FIDUCIARIA POPULAR -Fideicomiso De Valores Inmobiliarios Fpm No. 02 - Fp	118.00	126,491.21	120,228.08	6,263.13	USD	N/A	5%
DO9015700121	FIDUCIARIA UNIVERSAL-Fideicomiso De Oferta Publica De Val Ores Fid G-Patio 01-Fu	611.00	605,538.54	619,916.32	14,377.78	USD	N/A	26%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Rf Bhd 30 Dias Usd	2,977.45	30,813.04	31,766.14	953.10	USD	N/A	1%
N/A	Fondo De Inversion Abierto Plazo Men Sual Dolar	156.13	165,295.37	165,996.67	701.30	USD	N/A	7%
DO8013900121	JMMB-Jmmb Fondo De Inversion Cerrado Immo Biliario	381.00	399,882.48	404,350.73	4,468.25	USD	N/A	17%
Total		1,004,430.58	2,358,407.24	2,371,674.98	13,267.75			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

2.3 Acciones 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 De Inv. Dep. Financier O Flexible	291.82	3,599,017.37	3,963,605.41	364,588.04	DOP	N/A	0%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Renta Fija Nacional - Bh D Liquidez	387.46	473,186.68	511,072.64	37,885.97	DOP	N/A	0%
N/A	BHD-Fondo Mutuo Renta Fija Bhd Plazo 30 Dias	366.29	418,870.88	458,816.67	39,945.79	DOP	N/A	0%
N/A	Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	173.61	193,721.94	202,753.84	9,031.89	DOP	N/A	0%
N/A	JMMB-Fondo Abierto Jmmb Money Market	17.20	20,902.86	22,219.41	1,316.54	DOP	N/A	0%
N/A	UNIVERSAL-Cuotas Fondo De Inversion Abierto Un Iversal Liquidez	243.28	250,135.88	265,159.60	15,023.71	DOP	N/A	0%
N/A	JMMB-Fondo Mutuo Plazo 90 Dias Jmmb	32.16	33,523.70	35,532.59	2,008.88	DOP	N/A	0%
DO8013400122	PIONEER-Cuota Del Fondo Cerrado Inv Inmobiliaria Pioneer	16,217.00	16,286,294.82	20,409,126.93	4,122,832.11	DOP	N/A	14%
DO8012152021	PIONEER-Cuotas Participacion Pioneer	905.00	1,100,154.20	1,021,873.51	78,280.69	DOP	N/A	1%
DO8013300124	GAM-Fondo De Inversion Cerrado De Renta Fija Gam	96,334.00	144,773,155.44	160,838,283.06	16,065,127.62	DOP	N/A	84%
Total		114,967.84	167,148,963.78	187,728,443.66	20,579,479.89			100%

3.1 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 o centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002213325	BCRD 12% 07-ENE-22	870,000.00	-	906,686.16	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002217425	BCRD 10.50% 04-OCT-2024	1,090,000.00	-	1,084,177.22	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002213721	BCRD 10.5% 17-ENE-20	460,000.00	-	461,903.48	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1002213820	BCRD 12% 20-ENE-22	810,000.00	-	844,371.54	N/A	DOP	OTC	0.02%
DO1002257728	BCRD 14% 08-ENE-21	6,400,000.00	-	6,764,563.20	N/A	DOP	OTC	0.18%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	2,960,000.00	-	3,013,460.56	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO1002215825	BCRD 11% 14-OCT-22	5,000,000.00	-	5,106,765.00	N/A	DOP	OTC	0.14%
DO1002249022	BCRD 14% 18-OCT-19	1,400,000.00	-	1,417,256.40	N/A	DOP	OTC	0.04%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	2,270,000.00	-	2,272,079.32	N/A	DOP	OTC	0.07%
DO1002215726	BCRD 11% 30-SEPT-22	69,540,000.00	-	71,030,868.06	N/A	DOP	OTC	2.00%
DO1002214521	BCRD 11% 15-JUL-22	230,000.00	-	234,941.78	N/A	DOP	OTC	0.01%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

3.1 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
DO1002216625	BCRD 11% 15-SEPT-2023	4,610,000.00	-	4,700,157.77	N/A	DOP	OTC	0.13%
DO1002218621	NOTAS BCRD 10.50% 17-ENE-2025	50,400,000.00	-	50,006,325.60	N/A	DOP	OTC	1.45%
DO1002216427	BCRD 11% 23-JUN-23	5,270,000.00	-	5,378,330.12	N/A	DOP	OTC	0.15%
DO1002218423	NOTAS BCRD 9.50% 15 - ENE-202	57,160,000.00	-	56,815,553.84	N/A	DOP	OTC	1.64%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	17,100,000.00	-	16,967,235.60	N/A	DOP	OTC	0.49%
DO1002216526	BCRD 10% 10-SEPT-2021	19,740,000.00	-	19,723,043.34	N/A	DOP	OTC	0.57%
DO1002217227	BCRD 11% 17-MAY-2024	950,000.00	-	965,912.50	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1002219017	NOTAS BCRD 10.50% 14 - MAR-2025	140,510,000.00	-	139,266,486.50	N/A	DOP	OTC	4.04%
DO1002220023	NOTAS BCRD 10.00% 27-MAY-2022	200,000,000.00	-	199,317,800.00	N/A	DOP	OTC	5.75%
DO1005205013	MHRD 10.38% 06-MAR-26	6,500,000.00	-	6,718,803.00	N/A	DOP	OTC	0.19%
DO1005205310	MHRD 11% 06-NOV-26	113,300,000.00	-	120,441,299.00	N/A	DOP	OTC	3.26%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	500,000.00	-	531,420.00	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	200,000.00	-	207,979.40	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	5,500,000.00	-	5,928,626.00	N/A	DOP	OTC	0.16%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	900,000.00	-	967,248.90	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	493,700,000.00	-	516,652,113.0000	N/A	DOP	OTC	14.19%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	3,300,000.00	-	3,549,384.30	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO1005206722	MHRD 11.50% 11-ENE-2034	35,100,000.00	-	37,857,842.10	N/A	DOP	OTC	1.01%
USP3579ECD78	MHRD 9.75% 05-JUN-2026	213,200,000.00	-	218,302,942.00	N/A	DOP	OTC	6.13%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	20,800,000.00	-	23,280,108.80	N/A	DOP	OTC	0.60%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	95,700,000.00	-	101,317,685.70	N/A	DOP	OTC	2.75%
USP3579EBZ99	MHRD 8.90% 15-FEB-2023	156,750,000.00	-	156,680,873.25	N/A	DOP	OTC	4.50%
DO2009308019	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E1]	3,101,748.00	-	3,119,434.17	N/A	DOP	OTC	0.09%
DO2009308613	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	150,000.00	-	148,843.80	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO2015200127	COMIRDOM 12.00% 28-AGOS-2028 [	41,918,813.00	-	42,146,180.64	N/A	DOP	OTC	1.20%
DO2009305114	EGE HAINA 12% 27-JUN-26 [E1]	29,600.00	-	30,489.86	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO2009308811	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [	15,500,000.00	-	15,380,526.00	N/A	DOP	OTC	0.45%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

3.1 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 o centralización de negociación	Porcentaje de participación
DO2009308415	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E1]	200,000.00	-	201,140.40	N/A	DOP	OTC	0.01%
DO2015200226	COMIRDOM 12.00% 18-SEP-2028	12,314,209.00	-	12,382,614.43	N/A	DOP	OTC	0.35%
DO2009305213	EGE HAINA 12% 27-JUN-26 [E2]	30,000.00	-	30,901.89	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO2016300124	GULFSTREAM DOMINICANA 28-MAY-2	131,192,859.00	-	131,179,739.71	N/A	DOP	OTC	3.77%
DO2009308217	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E1]	75,000.00	-	75,427.65	N/A	DOP	OTC	0.00%
DO2016300223	GULFSTREAM PETROLEUM DOMINICAN	1,120,931,644.00	-	1,120,903,620.71	N/A	DOP	OTC	32.21%
DO2012502624	ALNAP 10.75% 08-SEP-2024 [E6]	43,894,136.00	-	47,035,200.37	N/A	DOP	OTC	1.26%
DO2003700120	ASOCIACION CIBAO 10.30% 16-MAY	370,000,000.00	-	370,076,590.00	N/A	DOP	OTC	10.63%
DO1005251025	MHRD 18.5% 04-FEB-28	1,000,000.00	-	1,342,826.00	N/A	DOP	OTC	0.03%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	7,300,000.00	-	8,103,284.70	N/A	DOP	OTC	0.21%
		3,479,858,009.00		3,530,871,063.77				100%

3.2 Títulos valores de deuda

USD :

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo o centralización de negociación	Porcentaje de participación
USP3579EAG28	MH DOMREP 8.63% 20-ABR-27	82,000.00	-	98,122.18	N/A	USD	OTC	0.19%
USP3579EAT49	MHRD 6.6% 28-ENE-24	8,000.00	-	8,905.97	N/A	USD	OTC	0.02%
USP3579EAY34	MH DOMREP 7.45% 30-ABR-44 [REG]	5,000.00	-	5,806.93	N/A	USD	OTC	0.01%
USP3579EBK21	MHRD 6.88% 29-ENE-26	256,000.00	-	289,572.86	N/A	USD	OTC	0.61%
DO1005205716	MHRD 6.00% 05-MAR-2027	159,000.00	-	174,303.27	N/A	USD	OTC	0.38%
USP3579EBY25	MH DOMREP 6.50% 15-FEB-2048	18,000.00	-	19,065.47	N/A	USD	OTC	0.04%
USP3579EBV85	MH DOMREP 5.95% 25-ENE-27	13,000.00	-	14,041.27	N/A	USD	OTC	0.03%
USP3579EAH01	MH DOMREP 7.5% 06-MAY-21	1,243,000.00	-	874,686.67	N/A	USD	OTC	2.95%
USP3579EBD87	MH DOMREP 5.5% 27-ENE-25	20,000.00	-	21,304.62	N/A	USD	OTC	0.05%
USP3579ECE51	MH DOMREP 6.40% 05 - JUN - 204	250,000.00	-	261,877.25	N/A	USD	OTC	0.59%
USP3579ECB13	DOMREP 6.00% 19-JUL-2028	29,000.00	-	31,344.30	N/A	USD	OTC	0.07%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

3.1 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 o centralización de negociación	Porcentaje de participación
DO2014300910	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E9]	57,763.00	-	61,392.71	N/A	USD	OTC	0.14%
DO2014304813	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E48]	1,000.00	-	1,043.84	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014305117	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E51]	19,076.00	-	19,912.25	N/A	USD	OTC	0.05%
DO2009904510	CEPM 5.50% 20-NOV-2027	729,724.00	-	761,165.62	N/A	USD	OTC	1.73%
DO2014304615	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E46]	999.00	-	1,048.36	N/A	USD	OTC	0.00%
DO2014304219	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E42]	14,517.00	-	15,234.23	N/A	USD	OTC	0.03%
DO2014304714	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E47]	29,607.00	-	31,069.76	N/A	USD	OTC	0.07%
DO2014301017	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E10]	30,762.00	-	32,695.02	N/A	USD	OTC	0.07%
DO2014300316	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E03]	63,000.00	-	66,958.79	N/A	USD	OTC	0.15%
DO2014303716	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E37]	146,314.00	-	155,871.82	N/A	USD	OTC	0.35%
DO2014302510	DPP 6.25% 09-MAY-2027 [E25]	91,516.00	-	97,405.60	N/A	USD	OTC	0.22%
DO2014303518	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E35]	396,722.00	-	422,637.47	N/A	USD	OTC	0.94%
DO2014302015	DPP 6.25% 31-MAR-2027 [E20]	132,165.00	-	140,549.28	N/A	USD	OTC	0.31%
DO2014303310	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E33]	15,000.00	-	15,979.86	N/A	USD	OTC	0.04%
DO2014304110	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E41]	7,605.00	-	7,980.73	N/A	USD	OTC	0.02%
DO2014304912	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E49]	83,595.00	-	87,259.64	N/A	USD	OTC	0.20%
DO2014305216	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E52]	13,398.00	-	13,985.34	N/A	USD	OTC	0.03%
DO2014302411	DPP 6.25% 09-MAY-2027 [E24]	33,581.00	-	35,742.14	N/A	USD	OTC	0.08%
DO2013001022	CONSORCIO REMIX 6.55% 15-DIC-2	2,797.00	-	2,796.95	N/A	USD	OTC	0.01%
DO2013001220	CONSORCIO REMIX 6.75% 05-SEPT-	536,930.00	-	536,914.97	N/A	USD	OTC	1.27%
DO2014301918	DPP 6.25% 31-MAR-2027 [E19]	433,550.00	-	461,053.54	N/A	USD	OTC	1.03%
DO2014303914	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E39]	1,605,055.00	-	1,709,903.61	N/A	USD	OTC	3.81%
DO2014303112	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E31]	1,289,846.00	-	1,374,103.90	N/A	USD	OTC	3.06%
DO2014303211	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E32]	210,000.00	-	223,718.04	N/A	USD	OTC	0.50%
DO2014304516	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E45]	9,424.00	-	9,889.60	N/A	USD	OTC	0.02%
USP10475AA22	BANRESERVAS 7% 01-FEB-23	3,656,000.00		3,781,448.33	N/A	USD	OTC	8.67%
USP0605NAA92	AVIANCA HOLDING SA 8.375% 10-0	6,631,000.00		6,424,822.32	N/A	USD	OTC	15.73%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

3.1 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 o centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO2014800216	EDENORTE 7.00% 15-JUL-2024 ARD	23,842,606.00		23,842,343.73	N/A	USD	OTC	56.54%
Total		42,166,552.00	-	42,133,958.24	-			19%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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 negociación
MH0332	28/6/2019	1/7/2019	300,000,000.00	343,359,000.00	335,770,800.00	(7,588,200.00)	DOP	OTC
MH0828	28/6/2019	1/7/2019	90,200,000.00	96,362,644.40	94,393,398.00	(1,969,246.40)	DOP	OTC
MH0134	28/6/2019	1/7/2019	500,000,000.00	560,586,000.00	539,285,500.00	(21,300,500.00)	DOP	OTC
MH0332	27/6/2019	2/7/2019	10,000,000.00	11,415,000.00	11,192,360.00	(222,640.00)	DOP	OTC
Total			900,200,000.00	1,011,722,644.40	980,642,058.00	- 31,080,586.40		

b) Títulos Valores de Deuda USD

50.8187

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	DOP	OTC
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	DOP	OTC
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	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

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
FICIPU	28/6/2019	3/7/2019	3,165.00	3,236,658.32	3,236,658.77	0.45	USD	OTC
Total			3,165.00	3,236,658.32	3,236,658.77	0.45		

c) Divisas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-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
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 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	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

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 negociación
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

5. Contratos de venta spot:

a) Títulos Valores de Deuda 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
MH0828	28/6/2019	1/7/2019	318,200,000.00	341,788,484.20	332,993,118.00	8,795,366.20	DOP	OTC
MH0828	28/6/2019	1/7/2019	93,500,000.00	100,431,248.50	97,846,815.00	2,584,433.50	DOP	OTC
MH0626	26/6/2019	1/7/2019	205,000,000.00	210,496,870.00	209,906,675.00	590,195.00	DOP	OTC
MH1126	28/6/2019	1/7/2019	108,300,000.00	117,851,626.80	115,126,149.00	2,725,477.80	DOP	OTC
DR0223	28/6/2019	1/7/2019	146,800,000.00	146,663,476.00	146,735,261.20	(71,785.20)	DOP	OTC
Total	28/6/2019	1/7/2019	871,800,000.00	917,231,705.50	902,608,018.20	14,623,687.30		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

a) Titulos 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
DP3127	28/6/2019	2/7/2019	1,289,846.00	1,395,948.73	1,374,103.90	21,844.83	USD	OTC
DP1927	28/6/2019	2/7/2019	433,550.00	468,329.38	461,053.54	7,275.84	USD	OTC
DP4927	28/6/2019	2/7/2019	83,595.00	88,747.80	87,259.64	1,488.16	USD	OTC
Total			1,806,991.00	1,953,025.91	1,922,417.08	30,608.83		

b) Acciones DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Valor nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
CUOGAM	26/6/2019	1/7/2019	750	1259410.15	1252192.5	7,217.65	DOP	OTC
Total			750.00	1,259,410.15	1,252,192.50	7,217.65		

b) Acciones USD

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Valor 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 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) Divisas Implícitas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-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
Total			-	-	-	-		

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	N/A
Total			-	-	-	-		

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
BC0921	2-abr-19	1-jul-19	200,000.00	198,149.11	199,828.20	1,679.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-jul-18	1-jul-19	4,500,000.00	4,530,369.35	4,764,154.50	233,785.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-abr-19	1-jul-19	100,000.00	101,117.35	99,914.10	(1,203.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	1-may-19	1-jul-19	610,000.00	617,712.63	617,518.86	(193.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	2-abr-19	1-jul-19	310,000.00	308,591.99	313,821.06	5,229.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	2-abr-19	1-jul-19	2,200,000.00	2,436,644.52	2,372,856.20	(63,788.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-abr-19	1-jul-19	600,000.00	691,912.83	671,541.60	(20,371.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-may-19	1-jul-19	330,000.00	337,940.26	329,716.53	(8,223.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	7-jun-19	1-jul-19	580,000.00	587,088.22	587,149.08	60.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-may-19	1-jul-19	900,000.00	970,481.53	941,841.00	(28,640.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	31-may-19	1-jul-19	200,000.00	203,954.80	198,447.20	(5,507.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	31-may-19	1-jul-19	4,700,000.00	5,288,824.45	5,069,283.70	(219,540.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-may-19	1-jul-19	13,800,000.00	14,857,052.03	14,441,562.00	(415,490.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	31-may-19	1-jul-19	4,300,000.00	4,900,581.00	4,637,855.30	(262,725.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31-may-19	1-jul-19	480,000.00	489,836.85	485,916.48	(3,920.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-may-19	1-jul-19	900,000.00	963,016.43	952,830.90	(10,185.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-may-19	1-jul-19	8,800,000.00	9,637,545.36	9,316,568.80	(320,976.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	30-may-19	1-jul-19	1,100,000.00	1,162,894.11	1,151,139.00	(11,755.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	30-may-19	1-jul-19	1,100,000.00	1,250,480.65	1,186,428.10	(64,052.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-may-19	1-jul-19	380,000.00	391,134.26	379,673.58	(11,460.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-may-19	1-jul-19	150,000.00	155,127.50	149,871.15	(5,256.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	1-jul-19	1,100,000.00	1,187,341.65	1,164,571.10	(22,770.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	1-jul-19	800,000.00	857,718.15	846,960.80	(10,757.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-jun-19	1-jul-19	100,000.00	99,384.43	99,914.10	529.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	1-jul-19	3,500,000.00	3,751,638.14	3,705,453.50	(46,184.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	31-may-19	1-jul-19	8,600,000.00	9,396,430.21	9,104,828.60	(291,601.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	1-jul-19	17,700,000.00	19,279,646.57	18,739,007.70	(540,638.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	1-jul-19	1,700,000.00	1,803,920.56	1,799,791.70	(4,128.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	31-may-19	1-jul-19	2,820,000.00	2,887,457.66	2,798,105.52	(89,352.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-ene-19	2-jul-19	9,100,000.00	9,066,087.87	9,634,179.10	568,091.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-ene-19	2-jul-19	500,000.00	464,027.71	529,350.50	65,322.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	4-mar-19	2-jul-19	400,000.00	407,242.43	411,534.80	4,292.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-jul-18	2-jul-19	500,000.00	563,098.39	529,350.50	(33,747.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-may-19	2-jul-19	900,000.00	976,288.74	941,841.00	(34,447.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-may-19	2-jul-19	5,800,000.00	6,226,520.96	6,140,465.80	(86,055.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-may-19	2-jul-19	1,500,000.00	1,621,948.06	1,617,856.50	(4,091.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-may-19	2-jul-19	400,000.00	437,687.40	431,428.40	(6,259.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	10-jun-19	2-jul-19	200,000.00	212,810.71	212,568.00	(242.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-abr-19	2-jul-19	4,100,000.00	4,291,299.15	4,340,674.10	49,374.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-abr-19	2-jul-19	460,000.00	465,566.29	465,669.96	103.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-abr-19	2-jul-19	1,900,000.00	1,949,453.12	2,011,531.90	62,078.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-may-19	2-jul-19	4,000,000.00	4,342,546.93	4,234,804.00	(107,742.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	3-may-19	2-jul-19	490,000.00	492,643.84	496,039.74	3,395.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	2-jul-19	1,800,000.00	1,991,291.45	1,905,661.80	(85,629.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-may-19	2-jul-19	280,000.00	278,962.08	279,759.48	797.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-may-19	2-jul-19	1,400,000.00	1,460,928.81	1,465,086.00	4,157.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	31-may-19	2-jul-19	32,920,000.00	33,639,063.02	32,664,409.12	(974,653.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-may-19	2-jul-19	5,900,000.00	6,406,023.83	6,174,291.00	(231,732.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-may-19	2-jul-19	18,200,000.00	19,596,665.01	19,046,118.00	(550,547.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	2-jul-19	1,300,000.00	1,480,965.23	1,455,006.80	(25,958.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-abr-19	2-jul-19	190,000.00	188,844.76	189,836.79	992.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	2-jul-19	900,000.00	962,397.62	952,830.90	(9,566.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	2-jul-19	1,600,000.00	1,700,627.84	1,693,921.60	(6,706.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	2-jul-19	3,900,000.00	4,237,763.50	4,128,933.90	(108,829.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	2-jul-19	17,300,000.00	18,787,034.78	18,315,527.30	(471,507.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	2-jul-19	35,400,000.00	38,559,430.82	37,478,015.40	(1,081,415.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-ene-19	3-jul-19	15,800,000.00	15,675,915.81	16,725,268.52	1,049,352.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-ene-19	3-jul-19	500,000.00	503,770.27	529,280.65	25,510.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-mar-19	3-jul-19	81,900,000.00	86,476,032.07	81,821,938.64	(4,654,093.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC1121	5-mar-19	3-jul-19	163,150,000.00	172,094,322.67	163,001,338.86	(9,092,983.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	4-ene-19	3-jul-19	400,000.00	410,628.84	425,144.21	14,515.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-jun-19	3-jul-19	90,000.00	89,195.42	89,912.29	716.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-abr-19	3-jul-19	200,000.00	198,313.90	199,805.08	1,491.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	29-may-19	3-jul-19	520,000.00	530,922.13	526,063.47	(4,858.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-jun-19	3-jul-19	150,000.00	156,393.05	149,857.03	(6,536.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	3-jul-19	1,200,000.00	1,367,719.31	1,342,783.24	(24,936.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-jun-19	3-jul-19	270,000.00	274,131.51	273,148.34	(983.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	3-jul-19	1,100,000.00	1,194,683.95	1,164,400.48	(30,283.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	3-jul-19	9,400,000.00	9,780,348.61	9,950,476.21	170,127.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	3-jul-19	4,800,000.00	5,023,237.85	5,081,094.23	57,856.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-abr-19	3-jul-19	6,700,000.00	7,540,403.48	7,497,475.92	(42,927.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-abr-19	3-jul-19	900,000.00	1,028,297.86	1,007,087.43	(21,210.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	4-abr-19	3-jul-19	85,300,000.00	90,660,753.12	89,254,920.79	(1,405,832.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-jun-19	3-jul-19	580,000.00	587,185.75	586,763.11	(422.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	3-jul-19	8,800,000.00	9,628,246.58	9,315,203.86	(313,042.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-jun-19	3-jul-19	10,000,000.00	11,218,221.71	10,783,980.92	(434,240.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	3-jun-19	3-jul-19	4,600,000.00	4,899,625.56	4,813,278.26	(86,347.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	3-jul-19	10,700,000.00	11,643,564.08	11,326,441.06	(317,123.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	3-jul-19	1,200,000.00	1,260,682.81	1,270,255.07	9,572.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	3-jul-19	1,400,000.00	1,494,445.03	1,481,964.25	(12,480.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-abr-19	3-jul-19	150,000.00	151,351.27	149,853.81	(1,497.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0320	4-abr-19	3-jul-19	150,000.00	156,601.19	153,165.83	(3,435.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	3-jul-19	1,000,000.00	1,113,275.46	1,058,545.89	(54,729.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-jun-19	3-jul-19	210,000.00	216,249.43	209,792.33	(6,457.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	3-jul-19	700,000.00	791,641.44	783,290.22	(8,351.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-jun-19	4-jul-19	420,000.00	430,124.16	419,573.74	(10,550.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	1,900,000.00	2,109,800.88	2,011,178.24	(98,622.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0223	3-jun-19	4-jul-19	69,100,000.00	79,336,508.07	76,658,709.06	(2,677,799.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	4,900,000.00	5,331,119.00	5,186,722.82	(144,396.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	1,900,000.00	2,018,090.34	2,011,178.24	(6,912.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	4-jul-19	700,000.00	812,558.10	783,255.22	(29,302.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	2,800,000.00	3,012,927.89	2,963,841.61	(49,086.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	4-jul-19	2,200,000.00	2,563,622.98	2,461,701.75	(101,921.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	5-abr-19	4-jul-19	590,000.00	594,570.98	596,801.18	2,230.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	4-jul-19	2,200,000.00	2,476,565.25	2,461,765.48	(14,799.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	5-jun-19	4-jul-19	350,000.00	353,197.99	354,034.60	836.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-mar-19	4-jul-19	1,500,000.00	1,573,370.16	1,587,786.16	14,416.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	4-jul-19	600,000.00	691,255.02	671,390.58	(19,864.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-jun-19	4-jul-19	490,000.00	499,091.70	495,648.44	(3,443.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	5-jun-19	4-jul-19	480,000.00	489,200.27	485,533.16	(3,667.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	5-jun-19	4-jul-19	3,500,000.00	3,776,970.48	3,662,189.32	(114,781.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	4-jul-19	26,500,000.00	28,688,696.91	28,050,643.82	(638,053.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	4-jul-19	4,800,000.00	5,163,146.31	5,080,960.09	(82,186.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	4-jul-19	4,600,000.00	5,058,609.13	4,869,168.36	(189,440.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-jun-19	4-jul-19	650,000.00	655,715.62	657,492.83	1,777.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	4-jul-19	1,000,000.00	1,168,800.81	1,118,936.03	(49,864.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	4-jul-19	700,000.00	828,301.43	783,255.22	(45,046.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	4-jul-19	3,100,000.00	3,356,293.38	3,281,453.39	(74,839.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	4-jun-19	4-jul-19	1,300,000.00	1,439,520.11	1,401,872.56	(37,647.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	4-jun-19	4-jul-19	45,200,000.00	49,206,346.78	47,294,559.28	(1,911,787.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
NO0325	4-jun-19	4-jul-19	280,000.00	299,264.83	277,464.18	(21,800.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	4-jun-19	4-jul-19	4,100,000.00	4,609,356.81	4,421,290.39	(188,066.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	4-jul-19	600,000.00	740,762.82	671,373.20	(69,389.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-jun-19	4-jul-19	210,000.00	209,657.88	209,795.89	138.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	4-jul-19	900,000.00	961,132.53	952,704.98	(8,427.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	4-jul-19	900,000.00	1,067,716.52	1,007,042.43	(60,674.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jun-19	4-jul-19	7,400,000.00	7,926,614.62	7,833,352.06	(93,262.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	4-jul-19	2,400,000.00	2,616,657.65	2,540,480.04	(76,177.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-jun-19	4-jul-19	770,000.00	777,957.48	778,876.12	918.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	4-jul-19	500,000.00	587,855.48	559,492.15	(28,363.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-abr-19	4-jul-19	3,700,000.00	3,901,736.70	3,916,504.99	14,768.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	4-jul-19	700,000.00	781,549.33	783,289.02	1,739.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	4-jul-19	900,000.00	985,033.49	1,007,085.88	22,052.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-abr-19	4-jul-19	2,500,000.00	2,564,406.73	2,646,333.38	81,926.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	15,500,000.00	16,922,077.48	16,406,980.35	(515,097.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-jun-19	4-jul-19	290,000.00	293,549.86	293,342.95	(206.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	700,000.00	770,586.92	740,960.40	(29,626.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	3-jun-19	4-jul-19	1,100,000.00	1,202,980.48	1,164,366.35	(38,614.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-ene-19	5-jul-19	500,000.00	506,370.60	529,241.91	22,871.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-ene-19	5-jul-19	1,200,000.00	1,246,696.66	1,270,193.54	23,496.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	1,800,000.00	1,929,176.05	1,905,270.89	(23,905.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	700,000.00	769,552.08	740,938.68	(28,613.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	5-jun-19	5-jul-19	10,000,000.00	11,211,921.72	10,783,289.29	(428,632.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	5-jun-19	5-jul-19	3,100,000.00	3,393,647.36	3,243,575.80	(150,071.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	5-jul-19	1,700,000.00	1,945,623.61	1,902,202.01	(43,421.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	5-jun-19	5-jul-19	8,900,000.00	9,693,071.91	9,312,201.50	(380,870.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-jun-19	5-jul-19	380,000.00	390,713.01	379,623.50	(11,089.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	4,400,000.00	4,814,172.68	4,657,328.83	(156,843.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	1,400,000.00	1,539,827.39	1,481,877.36	(57,950.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	3,400,000.00	3,722,383.38	3,598,845.01	(123,538.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	5,700,000.00	6,198,533.27	6,033,480.79	(165,052.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-feb-19	5-jul-19	7,700,000.00	7,911,538.36	8,150,325.45	238,787.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-mar-19	5-jul-19	4,700,000.00	4,905,038.36	4,974,924.68	69,886.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	7-mar-19	5-jul-19	190,000.00	185,572.54	188,850.67	3,278.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0124	7-mar-19	5-jul-19	900,000.00	951,640.24	925,864.53	(25,775.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	7-mar-19	5-jul-19	4,700,000.00	4,761,244.09	4,835,070.35	73,826.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	7-mar-19	5-jul-19	900,000.00	953,928.51	970,496.04	16,567.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	7-mar-19	5-jul-19	1,300,000.00	1,286,760.30	1,337,359.88	50,599.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	4-mar-19	5-jul-19	200,000.00	222,455.32	215,071.26	(7,384.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	5-jul-19	700,000.00	792,952.66	783,220.21	(9,732.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	8,900,000.00	9,667,834.69	9,420,506.04	(247,328.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	4,400,000.00	4,808,830.22	4,657,328.83	(151,501.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jul-18	5-jul-19	300,000.00	261,666.06	317,545.15	55,879.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jul-18	5-jul-19	200,000.00	214,423.32	211,698.92	(2,724.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	1,200,000.00	1,308,684.17	1,270,180.59	(38,503.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-jun-19	5-jul-19	260,000.00	263,620.00	259,742.40	(3,877.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	5-jun-19	5-jul-19	19,600,000.00	21,337,295.74	20,507,769.59	(829,526.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	18-jun-19	5-jul-19	96,000,000.00	99,622,876.70	98,287,366.12	(1,335,510.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	5-jul-19	71,100,000.00	77,285,943.91	74,392,980.50	(2,892,963.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
DR0223	18-jun-19	5-jul-19	113,400,000.00	116,558,552.05	113,356,903.07	(3,201,648.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	5-jul-19	1,000,000.00	1,168,718.39	1,118,886.02	(49,832.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	1,500,000.00	1,634,098.67	1,587,725.74	(46,372.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	7,100,000.00	7,696,971.23	7,515,235.16	(181,736.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	5-jun-19	5-jul-19	210,000.00	210,126.53	212,392.81	2,266.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	5-jul-19	16,200,000.00	17,591,086.95	17,147,437.97	(443,648.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-may-19	5-jul-19	900,000.00	964,483.56	952,635.44	(11,848.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-jul-19	1,800,000.00	1,938,188.01	1,905,309.72	(32,878.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	5-jul-19	240,000.00	246,798.31	239,750.18	(7,048.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	6-jun-19	5-jul-19	620,000.00	628,041.70	627,064.48	(977.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	6-jun-19	5-jul-19	400,000.00	430,438.58	431,049.50	610.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	6-may-19	5-jul-19	10,500,000.00	11,505,225.85	11,322,453.75	(182,772.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-may-19	5-jul-19	580,000.00	588,422.79	579,396.28	(9,026.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	5-abr-19	5-jul-19	470,000.00	470,906.08	475,355.33	4,449.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-jul-19	27,100,000.00	29,016,135.09	28,684,911.66	(331,223.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-may-19	5-jul-19	250,000.00	255,219.78	252,853.64	(2,366.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	8-jul-19	1,200,000.00	1,255,203.70	1,270,105.85	14,902.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	8-jul-19	1,800,000.00	1,972,170.02	1,905,103.25	(67,066.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	8-jul-19	2,300,000.00	2,467,420.91	2,434,369.54	(33,051.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	7-may-19	8-jul-19	2,700,000.00	2,885,769.75	2,857,654.87	(28,114.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	8-jul-19	3,600,000.00	3,857,233.44	3,810,317.55	(46,915.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	7-may-19	8-jul-19	5,000,000.00	5,356,794.52	5,231,198.39	(125,596.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	9-ene-19	8-jul-19	240,000.00	241,708.97	242,645.74	936.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-ene-19	8-jul-19	200,000.00	210,634.98	211,678.14	1,043.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-ene-19	8-jul-19	4,500,000.00	4,719,231.25	5,034,456.83	315,225.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ene-19	8-jul-19	500,000.00	482,900.07	529,195.35	46,295.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	8-abr-19	8-jul-19	310,000.00	315,355.81	313,408.44	(1,947.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	8-jul-19	500,000.00	530,045.02	529,210.77	(834.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	1,300,000.00	1,444,065.42	1,375,907.90	(68,157.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	8,400,000.00	9,130,699.58	8,890,481.83	(240,217.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	8-jul-19	1,000,000.00	1,168,994.08	1,118,816.51	(50,177.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	8-jul-19	480,000.00	488,297.15	479,497.32	(8,799.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-jun-19	8-jul-19	720,000.00	733,363.55	727,916.38	(5,447.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-abr-19	8-jul-19	470,000.00	475,145.14	469,474.11	(5,671.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-abr-19	8-jul-19	3,700,000.00	3,897,332.61	3,916,045.57	18,712.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	8-abr-19	8-jul-19	510,000.00	513,517.28	515,607.43	2,090.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	8-abr-19	8-jul-19	470,000.00	474,736.45	475,167.64	431.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-mar-19	8-jul-19	5,300,000.00	5,937,432.51	5,929,727.52	(7,704.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	9-may-19	8-jul-19	2,300,000.00	2,543,757.04	2,406,351.26	(137,405.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-jun-19	8-jul-19	700,000.00	730,598.16	740,895.08	10,296.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-jun-19	8-jul-19	1,600,000.00	1,848,406.04	1,790,106.42	(58,299.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-jun-19	8-jul-19	13,300,000.00	14,422,916.16	14,076,596.24	(346,319.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	6-jun-19	8-jul-19	90,000.00	98,292.33	89,481.29	(8,811.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-jun-19	8-jul-19	1,800,000.00	1,920,788.39	1,905,103.25	(15,685.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-jun-19	8-jul-19	380,000.00	390,607.06	379,602.04	(11,005.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	2,600,000.00	2,885,455.47	2,751,815.81	(133,639.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-may-19	8-jul-19	500,000.00	531,191.30	529,195.35	(1,995.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-jun-19	8-jul-19	490,000.00	495,649.31	495,401.72	(247.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-may-19	8-jul-19	3,700,000.00	4,000,372.72	3,916,045.57	(84,327.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	700,000.00	739,060.48	740,873.49	1,813.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	2,500,000.00	2,689,030.35	2,645,976.74	(43,053.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-jun-19	8-jul-19	340,000.00	342,008.01	343,738.29	1,730.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	8-jul-19	13,200,000.00	14,434,047.95	13,970,757.17	(463,290.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	8-abr-19	8-jul-19	16,800,000.00	18,034,538.60	17,782,259.29	(252,279.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-may-19	8-jul-19	23,600,000.00	24,398,224.25	24,978,748.37	580,524.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	8-jul-19	6,400,000.00	6,871,916.37	6,773,897.86	(98,018.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	9-jul-19	7,000,000.00	7,497,589.05	7,408,517.50	(89,071.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	10-may-19	9-jul-19	150,000.00	149,779.17	148,807.79	(971.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	1,600,000.00	1,730,222.47	1,693,375.43	(36,847.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	1,700,000.00	1,825,763.28	1,799,211.39	(26,551.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	2,600,000.00	2,887,200.00	2,751,735.07	(135,464.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	22,500,000.00	24,443,452.60	23,813,855.62	(629,596.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	3,500,000.00	3,847,326.08	3,704,258.75	(143,067.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	6,200,000.00	6,732,876.77	6,561,829.79	(171,046.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	9-jul-19	600,000.00	698,823.08	671,211.57	(27,611.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	4,600,000.00	4,954,135.63	4,868,610.48	(85,525.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	7,800,000.00	8,505,574.44	8,255,205.22	(250,369.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	9-jul-19	4,200,000.00	4,863,499.78	4,698,853.17	(164,646.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	8-ene-19	9-jul-19	260,000.00	250,236.94	258,490.56	8,253.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ene-19	9-jul-19	4,700,000.00	4,727,739.73	4,974,290.32	246,550.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	10-ene-19	9-jul-19	500,000.00	462,998.88	529,196.79	66,197.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-ene-19	9-jul-19	200,000.00	199,529.33	211,671.93	12,142.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-ene-19	9-jul-19	2,000,000.00	2,052,166.64	2,116,719.29	64,552.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	9-jul-19	16,900,000.00	18,107,366.66	17,886,851.55	(220,515.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	9-jul-19	900,000.00	974,134.26	952,523.68	(21,610.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-abr-19	9-jul-19	210,000.00	210,370.58	209,759.57	(611.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	6-jun-19	9-jul-19	130,930,000.00	137,686,927.23	129,721,700.75	(7,965,226.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	18-jun-19	9-jul-19	70,100,000.00	71,945,711.98	69,542,839.65	(2,402,872.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	18-jun-19	9-jul-19	69,470,000.00	73,054,126.88	68,828,889.87	(4,225,237.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-abr-19	9-jul-19	900,000.00	1,028,746.61	1,006,817.35	(21,929.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-abr-19	9-jul-19	23,200,000.00	25,499,984.36	25,014,021.98	(485,962.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	9-jul-19	2,700,000.00	2,934,206.69	2,857,662.67	(76,544.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-jun-19	9-jul-19	270,000.00	275,005.81	272,932.70	(2,073.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	9-jul-19	350,000.00	359,285.45	349,599.28	(9,686.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	9-jul-19	17,700,000.00	19,240,170.01	18,732,965.69	(507,204.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	7-jun-19	9-jul-19	13,600,000.00	14,702,319.00	14,228,519.19	(473,799.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	8-abr-19	9-jul-19	73,100,000.00	79,598,040.54	78,815,733.04	(782,307.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	10-jun-19	9-jul-19	1,000,000.00	1,066,566.84	1,058,359.64	(8,207.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-jun-19	9-jul-19	330,000.00	336,959.46	329,622.18	(7,337.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-abr-19	9-jul-19	460,000.00	464,701.09	464,996.45	295.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-abr-19	9-jul-19	400,000.00	494,711.22	447,474.38	(47,236.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-abr-19	9-jul-19	12,700,000.00	13,844,531.23	13,693,020.65	(151,510.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	9-jul-19	44,900,000.00	47,992,023.68	47,521,871.88	(470,151.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	16-may-19	9-jul-19	420,000.00	421,818.01	424,561.98	2,743.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	9-jul-19	5,100,000.00	5,486,511.36	5,397,634.18	(88,877.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	9-jul-19	7,200,000.00	7,726,334.42	7,620,189.43	(106,144.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	9-jul-19	4,700,000.00	5,010,136.50	4,974,290.32	(35,846.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-jun-19	9-jul-19	240,000.00	248,086.50	239,732.79	(8,353.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	9-jul-19	45,800,000.00	49,140,402.34	48,472,871.67	(667,530.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-may-19	9-jul-19	900,000.00	1,028,252.94	1,006,817.35	(21,435.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-ene-19	10-jul-19	1,200,000.00	1,197,868.01	1,269,994.31	72,126.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-ene-19	10-jul-19	190,000.00	189,520.12	192,038.46	2,518.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-ene-19	10-jul-19	330,000.00	327,667.96	333,546.21	5,878.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-ene-19	10-jul-19	1,700,000.00	1,689,192.41	1,799,221.56	110,029.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	16-ene-19	10-jul-19	560,000.00	568,394.52	566,008.08	(2,386.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-ene-19	10-jul-19	900,000.00	943,326.85	952,495.73	9,168.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-abr-19	10-jul-19	3,300,000.00	3,607,097.79	3,492,484.34	(114,613.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	10-jul-19	300,000.00	298,667.40	317,498.58	18,831.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-abr-19	10-jul-19	460,000.00	464,524.66	464,935.21	410.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	900,000.00	983,054.29	952,529.06	(30,525.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	2,100,000.00	2,305,725.00	2,222,490.04	(83,234.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	11-abr-19	10-jul-19	57,600,000.00	60,620,256.00	59,251,272.38	(1,368,983.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-abr-19	10-jul-19	7,300,000.00	7,820,251.58	7,726,069.04	(94,182.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	12-jun-19	10-jul-19	84,700,000.00	91,892,663.79	88,612,260.32	(3,280,403.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-abr-19	10-jul-19	45,600,000.00	49,671,198.71	49,163,914.55	(507,284.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	15-mar-19	10-jul-19	5,500,000.00	5,863,102.63	5,929,858.11	66,755.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-ene-19	10-jul-19	330,000.00	327,329.66	333,551.95	6,222.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-ene-19	10-jul-19	700,000.00	759,821.58	740,830.01	(18,991.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-mar-19	10-jul-19	2,000,000.00	2,043,423.22	2,116,657.18	73,233.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-abr-19	10-jul-19	2,500,000.00	2,667,609.46	2,645,821.47	(21,787.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	16-abr-19	10-jul-19	300,000.00	299,390.19	308,600.38	9,210.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	1,000,000.00	1,102,358.36	1,058,328.59	(44,029.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	10-jun-19	10-jul-19	3,300,000.00	3,581,734.30	3,452,425.73	(129,308.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	7,100,000.00	7,681,133.90	7,514,132.98	(167,000.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	3,000,000.00	3,267,780.16	3,174,985.77	(92,794.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	10-jul-19	1,300,000.00	1,474,521.38	1,454,226.69	(20,294.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	2,600,000.00	2,884,707.57	2,751,654.33	(133,053.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	10-jul-19	900,000.00	1,069,880.99	1,006,772.32	(63,108.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	1,800,000.00	1,918,225.34	1,904,991.46	(13,233.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	10-jul-19	700,000.00	768,673.63	740,830.01	(27,843.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	10-jun-19	10-jul-19	140,000.00	149,380.51	139,181.32	(10,199.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	11-jul-19	1,100,000.00	1,280,495.24	1,230,444.47	(50,050.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	11-jul-19	8,600,000.00	9,311,871.93	9,101,358.76	(210,513.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	11-jul-19	4,200,000.00	4,860,413.27	4,698,060.71	(162,352.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	11-jul-19	1,600,000.00	1,711,722.87	1,693,340.26	(18,382.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-jun-19	11-jul-19	350,000.00	353,148.99	353,721.64	572.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	11-jul-19	3,700,000.00	4,008,800.16	3,915,700.86	(93,099.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	11-jul-19	2,500,000.00	2,938,136.28	2,796,464.71	(141,671.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	10-jun-19	11-jul-19	1,300,000.00	1,433,155.87	1,360,013.96	(73,141.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	11-jul-19	17,700,000.00	19,226,910.27	18,731,866.29	(495,043.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-jun-19	11-jul-19	240,000.00	249,302.43	239,721.68	(9,580.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	8,300,000.00	9,023,555.47	8,783,869.50	(239,685.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	7,700,000.00	8,426,738.63	8,148,890.98	(277,847.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	900,000.00	959,913.02	952,467.78	(7,445.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	1,100,000.00	1,200,703.43	1,164,127.28	(36,576.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	3,600,000.00	3,876,540.98	3,809,871.11	(66,669.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	6,600,000.00	7,139,738.74	6,985,028.55	(154,710.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	5,600,000.00	6,081,677.19	5,926,466.17	(155,211.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	11-jul-19	2,400,000.00	2,768,101.32	2,684,706.71	(83,394.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	12-jun-19	11-jul-19	66,790,000.00	68,230,608.46	66,256,912.40	(1,973,696.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-abr-19	11-jul-19	7,400,000.00	8,035,106.20	7,831,401.73	(203,704.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-abr-19	11-jul-19	3,900,000.00	4,172,648.57	4,127,516.87	(45,131.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-abr-19	11-jul-19	13,500,000.00	14,399,118.05	14,287,558.41	(111,559.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-abr-19	11-jul-19	1,300,000.00	1,411,982.19	1,375,786.79	(36,195.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-abr-19	11-jul-19	140,000.00	139,139.06	141,483.38	2,344.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	26-jun-19	11-jul-19	31,800,000.00	34,167,807.09	33,655,137.58	(512,669.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	11-jun-19	11-jul-19	13,400,000.00	14,515,642.46	14,018,605.40	(497,037.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	11-jun-19	11-jul-19	1,600,000.00	1,781,684.18	1,673,863.33	(107,820.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	9,200,000.00	9,929,756.18	9,736,706.47	(193,049.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	1,800,000.00	1,918,675.35	1,904,935.55	(13,739.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	8,800,000.00	9,606,860.28	9,313,018.27	(293,842.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11-jun-19	11-jul-19	800,000.00	945,418.88	894,868.71	(50,550.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-may-19	12-jul-19	11,300,000.00	12,168,518.51	11,821,376.91	(347,141.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	12-jul-19	3,400,000.00	3,661,992.20	3,598,252.96	(63,739.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-may-19	12-jul-19	5,800,000.00	6,295,536.64	6,067,609.39	(227,927.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	12-jul-19	1,800,000.00	1,988,336.55	1,904,879.64	(83,456.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	4,400,000.00	4,803,968.56	4,656,372.46	(147,596.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	3,000,000.00	3,296,503.14	3,174,799.41	(121,703.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	900,000.00	959,233.93	952,439.82	(6,794.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	4,400,000.00	4,800,269.93	4,656,372.46	(143,897.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	600,000.00	627,370.14	634,959.88	7,589.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	12-jul-19	480,000.00	490,722.99	479,412.97	(11,310.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	13,200,000.00	14,396,494.73	13,969,117.38	(427,377.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	12-jul-19	900,000.00	1,018,476.32	1,006,783.85	(11,692.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	12-jul-19	46,100,000.00	53,294,553.42	51,569,705.90	(1,724,847.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	12-jun-19	12-jul-19	43,490,000.00	45,619,623.20	43,084,158.21	(2,535,464.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	12-jun-19	12-jul-19	1,170,000.00	1,229,394.90	1,159,081.75	(70,313.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	12-jun-19	12-jul-19	5,760,000.00	6,044,268.22	5,706,248.59	(338,019.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-may-19	12-jul-19	1,900,000.00	2,035,902.61	1,987,665.14	(48,237.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	900,000.00	958,946.26	952,439.82	(6,506.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	21-jun-19	12-jul-19	90,000.00	96,843.68	89,466.12	(7,377.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	7,500,000.00	8,176,532.24	7,936,998.51	(239,533.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	800,000.00	829,744.61	846,613.17	16,868.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	2,600,000.00	2,884,021.29	2,751,492.82	(132,528.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	1,600,000.00	1,727,613.72	1,693,226.35	(34,387.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	1,800,000.00	1,919,289.75	1,904,879.64	(14,410.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	3,400,000.00	3,649,657.78	3,598,252.96	(51,404.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	12-jul-19	12,400,000.00	13,520,119.55	13,122,504.21	(397,615.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	12-jul-19	450,000.00	460,098.17	449,449.66	(10,648.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	10-jun-19	12-jul-19	260,000.00	260,435.32	262,720.24	2,284.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	12-jul-19	3,600,000.00	3,897,182.24	3,809,759.29	(87,422.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	17-may-19	12-jul-19	94,480,000.00	96,567,852.87	93,724,322.26	(2,843,530.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-may-19	12-jul-19	470,000.00	473,947.82	474,917.36	969.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	12-jul-19	5,900,000.00	6,280,016.37	6,244,027.20	(35,989.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	13-may-19	12-jul-19	280,000.00	289,825.30	277,760.48	(12,064.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	12-jul-19	1,800,000.00	1,963,421.85	1,904,879.64	(58,542.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	28-jun-19	12-jul-19	83,400,000.00	90,519,427.68	87,248,038.46	(3,271,389.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ene-19	12-jul-19	700,000.00	693,390.76	740,786.53	47,395.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	14-ene-19	12-jul-19	6,800,000.00	7,298,243.23	7,329,644.84	31,401.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-ene-19	12-jul-19	2,000,000.00	1,962,200.72	2,116,576.16	154,375.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-18	12-jul-19	1,000,000.00	956,332.19	1,058,266.47	101,934.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	15-ene-19	12-jul-19	220,000.00	220,956.93	222,306.20	1,349.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-ene-19	12-jul-19	500,000.00	494,911.99	529,133.23	34,221.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-ene-19	15-jul-19	2,000,000.00	1,962,419.28	2,116,004.73	153,585.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	15-jul-19	9,400,000.00	9,856,768.51	9,944,987.35	88,218.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-ene-19	15-jul-19	2,900,000.00	2,882,269.23	3,068,206.85	185,937.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	16-may-19	15-jul-19	37,700,000.00	40,043,123.74	39,436,629.90	(606,493.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-jun-19	15-jul-19	1,500,000.00	1,625,119.64	1,569,096.68	(56,022.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	15-jul-19	4,200,000.00	4,851,917.66	4,697,220.01	(154,697.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-may-19	15-jul-19	1,300,000.00	1,463,638.77	1,453,901.43	(9,737.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-jun-19	15-jul-19	140,000.00	146,286.30	139,817.85	(6,468.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-jun-19	15-jul-19	900,000.00	966,366.44	941,458.01	(24,908.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	15-jul-19	190,000.00	196,328.70	189,752.80	(6,575.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	15-jul-19	900,000.00	1,019,745.62	1,006,547.15	(13,198.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	15-jul-19	900,000.00	959,087.72	952,157.15	(6,930.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	15-jul-19	900,000.00	959,350.73	952,157.15	(7,193.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	15-jul-19	8,900,000.00	9,666,476.12	9,415,776.30	(250,699.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-jun-19	15-jul-19	490,000.00	494,305.69	494,930.89	625.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-jun-19	15-jul-19	1,100,000.00	1,209,701.87	1,150,670.90	(59,030.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-jun-19	15-jul-19	1,300,000.00	1,452,489.76	1,359,883.79	(92,605.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-jun-19	15-jul-19	270,000.00	277,129.58	269,681.66	(7,447.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-mar-19	15-jul-19	7,500,000.00	7,898,937.92	7,934,830.33	35,892.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	16-abr-19	15-jul-19	1,000,000.00	1,052,190.45	1,039,488.24	(12,702.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	12-jun-19	15-jul-19	600,000.00	603,531.17	606,067.40	2,536.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-jun-19	15-jul-19	650,000.00	651,971.13	656,573.01	4,601.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-jun-19	15-jul-19	250,000.00	249,346.32	252,528.08	3,181.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-jun-19	15-jul-19	440,000.00	441,156.01	444,427.74	3,271.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	15-jul-19	4,300,000.00	5,015,089.37	4,809,294.47	(205,794.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-jun-19	15-jul-19	390,000.00	392,552.21	393,924.59	1,372.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	15-jul-19	1,000,000.00	1,200,404.89	1,118,440.58	(81,964.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	12-jun-19	15-jul-19	44,500,000.00	48,379,914.38	46,549,868.18	(1,830,046.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	15-jul-19	900,000.00	970,799.32	952,157.15	(18,642.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-abr-19	15-jul-19	500,000.00	537,100.36	559,192.86	22,092.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	15-jul-19	900,000.00	972,525.35	952,157.15	(20,368.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	15-jul-19	14,400,000.00	15,593,939.73	15,234,514.47	(359,425.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	15-jul-19	8,800,000.00	9,609,112.33	9,309,981.07	(299,131.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-abr-19	15-jul-19	300,000.00	344,485.45	335,556.86	(8,928.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-abr-19	15-jul-19	220,000.00	220,283.29	219,713.77	(569.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	28-jun-19	15-jul-19	5,000,000.00	5,415,600.00	5,312,268.75	(103,331.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-abr-19	15-jul-19	800,000.00	839,024.26	846,361.91	7,337.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	16-ene-19	15-jul-19	700,000.00	685,262.51	740,584.16	55,321.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	16-jul-19	3,200,000.00	3,536,343.12	3,385,475.99	(150,867.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-abr-19	16-jul-19	3,100,000.00	3,492,958.44	3,467,020.67	(25,937.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-abr-19	16-jul-19	500,000.00	496,943.72	499,362.30	2,418.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-may-19	16-jul-19	14,400,000.00	15,269,528.33	15,062,967.67	(206,560.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	16-jul-19	5,700,000.00	6,191,254.54	5,962,424.70	(228,829.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-abr-19	16-jul-19	4,500,000.00	5,033,871.08	5,032,771.94	(1,099.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-abr-19	16-jul-19	3,000,000.00	3,190,567.90	3,173,883.74	(16,684.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	16-jul-19	900,000.00	1,001,976.85	1,006,502.10	4,525.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	16-jul-19	2,700,000.00	3,023,218.77	3,019,898.49	(3,320.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-may-19	16-jul-19	6,000,000.00	6,451,152.32	6,276,236.53	(174,915.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	16-jul-19	380,000.00	389,500.42	379,544.81	(9,955.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	14-jun-19	16-jul-19	41,900,000.00	48,454,479.98	44,687,311.96	(3,767,168.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-jun-19	16-jul-19	670,000.00	678,040.45	676,688.00	(1,352.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	16-jul-19	280,000.00	283,649.01	279,628.42	(4,020.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	16-jul-19	8,900,000.00	9,689,501.51	9,415,384.10	(274,117.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	14-jun-19	16-jul-19	45,600,000.00	48,521,093.26	46,893,060.36	(1,628,032.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
NO0325	14-jun-19	16-jul-19	44,690,000.00	47,186,669.22	44,266,807.58	(2,919,861.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-jun-19	16-jul-19	2,500,000.00	2,757,584.47	2,615,098.55	(142,485.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	16-jul-19	2,900,000.00	3,386,740.93	3,243,173.43	(143,567.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	16-jul-19	15,600,000.00	17,019,016.75	16,503,369.89	(515,646.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	16-jul-19	1,400,000.00	1,566,029.39	1,565,669.93	(359.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	16-jul-19	26,500,000.00	28,778,925.00	28,034,570.64	(744,354.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	16-jul-19	110,000.00	114,783.03	109,854.02	(4,929.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	16-jul-19	9,200,000.00	9,979,542.93	9,732,756.60	(246,786.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	16-jul-19	4,300,000.00	4,957,421.53	4,808,843.36	(148,578.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	1,300,000.00	1,400,732.55	1,375,349.62	(25,382.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	400,000.00	446,918.19	423,184.50	(23,733.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	500,000.00	540,961.11	528,980.62	(11,980.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	1,600,000.00	1,729,083.17	1,692,738.00	(36,345.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	1,200,000.00	1,297,304.83	1,269,553.50	(27,751.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-jun-19	16-jul-19	2,500,000.00	2,913,063.44	2,795,839.16	(117,224.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-abr-19	16-jul-19	900,000.00	1,025,618.93	1,006,632.83	(18,986.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	16-jul-19	900,000.00	994,859.43	952,117.49	(42,741.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	13-jun-19	16-jul-19	3,000,000.00	3,446,746.49	3,355,007.00	(91,739.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-jun-19	16-jul-19	19,100,000.00	20,782,813.02	19,979,352.95	(803,460.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-jun-19	16-jul-19	1,600,000.00	1,815,395.45	1,789,337.06	(26,058.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-abr-19	16-jul-19	900,000.00	1,048,121.03	1,006,502.10	(41,618.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-abr-19	16-jul-19	1,700,000.00	1,967,584.25	1,901,170.63	(66,413.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	16-jul-19	1,500,000.00	1,632,165.34	1,586,862.49	(45,302.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-abr-19	16-jul-19	460,000.00	462,479.73	464,567.75	2,088.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	16-abr-19	16-jul-19	1,500,000.00	1,556,603.23	1,559,196.29	2,593.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	16-jul-19	9,900,000.00	10,668,125.77	10,473,292.43	(194,833.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	16-jul-19	800,000.00	954,631.00	894,668.53	(59,962.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	16-jul-19	6,000,000.00	6,450,160.88	6,347,449.96	(102,710.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	2,800,000.00	3,285,970.15	3,131,199.71	(154,770.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	17-jul-19	36,500,000.00	39,043,609.81	38,614,084.74	(429,525.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	17-jul-19	1,900,000.00	2,082,191.16	2,009,942.09	(72,249.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	17-jul-19	36,500,000.00	39,043,609.81	38,614,084.74	(429,525.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	17-jul-19	1,800,000.00	1,811,682.12	1,904,155.66	92,473.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	17-jul-19	8,500,000.00	8,594,075.62	8,992,321.10	398,245.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	18-ene-19	17-jul-19	1,900,000.00	1,983,126.02	2,009,995.16	26,869.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-ene-19	17-jul-19	250,000.00	255,834.79	252,449.19	(3,385.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	18-ene-19	17-jul-19	120,000.00	122,212.75	119,262.85	(2,949.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	17-jul-19	2,900,000.00	2,974,167.13	3,067,806.34	93,639.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	18-ene-19	17-jul-19	120,000.00	122,212.75	119,262.85	(2,949.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-jun-19	17-jul-19	9,700,000.00	10,466,059.21	10,146,339.58	(319,719.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-jun-19	17-jul-19	330,000.00	333,076.19	329,553.47	(3,522.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-jun-19	17-jul-19	1,400,000.00	1,476,489.87	1,464,420.14	(12,069.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-jun-19	17-jul-19	1,400,000.00	1,511,610.41	1,464,420.14	(47,190.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	17-jun-19	17-jul-19	70,000.00	77,075.83	69,569.99	(7,505.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-jun-19	17-jul-19	17,800,000.00	19,318,303.08	18,619,056.13	(699,246.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-jun-19	17-jul-19	1,200,000.00	1,327,848.82	1,255,217.27	(72,631.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	900,000.00	957,237.82	952,077.83	(5,159.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	1,100,000.00	1,190,169.85	1,163,650.68	(26,519.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	900,000.00	958,141.93	952,077.83	(6,064.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	1,100,000.00	1,311,193.21	1,230,114.17	(81,079.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	6,600,000.00	7,629,969.52	7,380,685.03	(249,284.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	17-jun-19	17-jul-19	4,300,000.00	4,990,280.25	4,808,628.12	(181,652.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	2,400,000.00	2,793,274.26	2,684,253.54	(109,020.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	8,800,000.00	9,631,787.03	9,309,205.45	(322,581.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-jun-19	17-jul-19	26,700,000.00	29,009,508.91	27,928,584.19	(1,080,924.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-jun-19	17-jul-19	8,100,000.00	8,832,554.95	8,472,716.55	(359,838.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	1,500,000.00	1,748,158.26	1,677,658.46	(70,499.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	1,700,000.00	1,929,828.34	1,901,085.54	(28,742.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	11,000,000.00	11,984,287.94	11,636,506.81	(347,781.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	600,000.00	718,737.26	670,971.37	(47,765.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	2,300,000.00	2,720,445.33	2,572,056.90	(148,388.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	17-jul-19	15,700,000.00	17,034,358.70	16,609,346.04	(425,012.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	900,000.00	1,055,318.48	1,006,457.05	(48,861.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	17-jul-19	1,000,000.00	1,214,860.35	1,118,285.61	(96,574.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	17-jul-19	5,000,000.00	5,825,346.40	5,591,428.05	(233,918.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	2,100,000.00	2,478,492.87	2,348,528.60	(129,964.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	17-jul-19	8,900,000.00	9,632,277.06	9,415,489.16	(216,787.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	17-jul-19	12,200,000.00	13,242,215.38	12,905,943.91	(336,271.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	17-abr-19	17-jul-19	600,000.00	709,595.42	670,971.37	(38,624.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	17-jul-19	13,200,000.00	14,408,609.08	13,963,808.17	(444,800.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	600,000.00	712,252.40	670,971.37	(41,281.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	17-jul-19	440,000.00	453,338.86	439,404.63	(13,934.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	17-jul-19	490,000.00	494,384.30	489,363.71	(5,020.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	1,700,000.00	1,937,908.48	1,901,085.54	(36,822.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	17-jul-19	900,000.00	1,029,264.03	1,006,457.05	(22,806.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-jun-19	17-jul-19	1,800,000.00	2,002,124.35	1,904,155.66	(97,968.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-jun-19	18-jul-19	600,000.00	605,805.02	605,798.15	(6.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	19-jun-19	18-jul-19	84,100,000.00	100,504,690.82	90,625,877.34	(9,878,813.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	19-jun-19	18-jul-19	29,130,000.00	29,787,358.13	29,092,953.28	(694,404.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19-jun-19	18-jul-19	59,800,000.00	70,259,113.33	64,213,478.64	(6,045,634.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-jun-19	18-jul-19	550,000.00	552,442.21	555,314.97	2,872.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	5,000,000.00	5,819,263.03	5,591,177.75	(228,085.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	5,900,000.00	6,769,684.98	6,597,970.80	(171,714.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-jun-19	18-jul-19	380,000.00	389,452.80	379,475.92	(9,976.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	2,100,000.00	2,424,877.47	2,348,294.66	(76,582.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0921	18-jun-19	18-jul-19	220,000.00	224,506.78	219,696.58	(4,810.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-jun-19	18-jul-19	520,000.00	525,453.41	525,055.24	(398.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	18-jul-19	800,000.00	847,321.83	846,303.21	(1,018.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	18-jul-19	20,300,000.00	22,065,381.86	21,473,749.68	(591,632.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	3,300,000.00	3,881,316.19	3,690,177.32	(191,138.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	18-jul-19	3,700,000.00	4,015,330.34	3,870,160.62	(145,169.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-jun-19	18-jul-19	390,000.00	397,503.10	389,518.15	(7,984.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	18-jul-19	10,600,000.00	11,500,058.22	11,212,893.92	(287,164.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	18-jul-19	900,000.00	957,583.92	952,038.16	(5,545.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	18-jul-19	14,700,000.00	15,938,001.40	15,376,043.55	(561,957.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	1,500,000.00	1,696,083.52	1,677,353.33	(18,730.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	1,500,000.00	1,746,222.75	1,677,353.33	(68,869.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	4,000,000.00	4,637,826.86	4,472,942.20	(164,884.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	1,300,000.00	1,451,979.96	1,453,706.22	1,726.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	900,000.00	989,364.43	1,006,412.00	17,047.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	1,100,000.00	1,222,690.43	1,230,059.11	7,368.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	18-jul-19	6,700,000.00	7,242,775.34	7,008,128.69	(234,646.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0921	18-jun-19	18-jul-19	480,000.00	486,742.11	479,406.95	(7,335.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	18-jun-19	18-jul-19	4,100,000.00	4,231,129.34	4,196,865.20	(34,264.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	18-jun-19	18-jul-19	110,400,000.00	114,598,067.12	113,008,272.68	(1,589,794.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-jun-19	18-jul-19	720,000.00	734,720.60	719,048.37	(15,672.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	2,200,000.00	2,521,483.00	2,460,118.21	(61,364.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-jun-19	18-jul-19	1,300,000.00	1,452,719.69	1,453,706.22	986.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	18-jul-19	500,000.00	551,681.48	528,939.50	(22,741.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	900,000.00	1,068,121.99	1,006,366.94	(61,755.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	4,200,000.00	4,845,290.93	4,696,379.05	(148,911.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	13,500,000.00	14,621,205.05	14,280,811.49	(340,393.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	19-jun-19	19-jul-19	35,500,000.00	38,620,319.19	37,131,733.53	(1,488,585.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	19-jun-19	19-jul-19	30,700,000.00	31,869,496.38	31,424,832.87	(444,663.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	3,900,000.00	4,532,783.57	4,360,923.40	(171,860.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	19-jul-19	100,000.00	103,626.39	99,859.48	(3,766.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-may-19	19-jul-19	1,300,000.00	1,528,261.07	1,453,641.13	(74,619.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	20-may-19	19-jul-19	400,000.00	448,569.06	430,802.91	(17,766.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	20-may-19	19-jul-19	65,900,000.00	70,313,578.98	68,929,049.01	(1,384,529.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	20-may-19	19-jul-19	18,300,000.00	19,914,984.11	19,141,147.15	(773,836.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	4-jun-19	19-jul-19	87,900,000.00	94,971,148.63	91,940,264.16	(3,030,884.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	19-jul-19	19,400,000.00	19,788,072.61	20,520,856.40	732,783.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	19-jul-19	4,000,000.00	4,065,277.54	4,231,227.98	165,950.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	22-ene-19	19-jul-19	440,000.00	439,093.86	444,193.39	5,099.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	19-jun-19	19-jul-19	220,000.00	230,186.43	218,629.99	(11,556.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	19-jul-19	9,530,000.00	9,732,670.60	9,516,608.36	(216,062.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	19-jul-19	6,030,000.00	6,158,848.64	6,021,526.59	(137,322.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	19-jun-19	19-jul-19	1,100,000.00	1,165,183.29	1,150,560.76	(14,622.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	19-jun-19	19-jul-19	700,000.00	772,973.28	732,175.03	(40,798.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	19-jun-19	19-jul-19	1,900,000.00	1,998,159.62	1,944,859.36	(53,300.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	2,500,000.00	2,909,918.60	2,795,463.72	(114,454.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	2,500,000.00	2,909,178.88	2,795,463.72	(113,715.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	15,700,000.00	17,059,536.33	16,608,054.84	(451,481.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	900,000.00	1,054,690.54	1,006,366.94	(48,323.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	19-jul-19	100,000.00	101,421.02	99,859.48	(1,561.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	5,900,000.00	6,893,228.01	6,597,294.38	(295,933.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
NO0325	19-jun-19	19-jul-19	57,680,000.00	60,379,523.30	57,127,843.08	(3,251,680.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	7,300,000.00	8,421,864.80	8,162,754.06	(259,110.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	1,600,000.00	1,800,920.54	1,789,096.78	(11,823.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	7,200,000.00	8,371,770.75	8,051,423.89	(320,346.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	2,500,000.00	2,908,562.44	2,795,463.72	(113,098.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	1,000,000.00	1,188,040.43	1,118,185.49	(69,854.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	14,500,000.00	15,828,667.81	15,337,753.49	(490,914.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	3,300,000.00	3,881,381.17	3,690,012.11	(191,369.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	22,000,000.00	23,965,739.84	23,271,074.26	(694,665.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	600,000.00	678,207.24	670,911.29	(7,295.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	900,000.00	1,067,760.36	1,006,366.94	(61,393.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	19-jul-19	450,000.00	457,331.46	449,367.66	(7,963.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-jun-19	19-jul-19	480,000.00	486,267.40	484,574.61	(1,692.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-jul-19	800,000.00	910,946.35	894,548.39	(16,397.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	13,200,000.00	14,373,279.53	13,962,644.56	(410,634.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	19-jun-19	19-jul-19	65,010,000.00	68,053,294.62	64,387,674.73	(3,665,619.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	19-jun-19	19-jul-19	37,200,000.00	38,937,375.51	36,843,893.25	(2,093,482.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC1022	19-jun-19	19-jul-19	8,350,000.00	8,808,199.40	8,520,830.30	(287,369.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	19-jul-19	4,300,000.00	4,935,345.73	4,808,489.26	(126,856.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-may-19	19-jul-19	560,000.00	561,197.20	565,337.04	4,139.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	19-jul-19	800,000.00	826,631.00	846,270.31	19,639.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ene-19	22-jul-19	5,600,000.00	5,755,139.99	5,922,805.55	167,665.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ene-19	22-jul-19	4,200,000.00	4,168,412.89	4,442,400.94	273,988.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ene-19	22-jul-19	2,400,000.00	2,473,345.22	2,538,345.23	65,000.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-ene-19	22-jul-19	340,000.00	331,305.95	339,507.39	8,201.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-ene-19	22-jul-19	550,000.00	532,162.69	549,203.13	17,040.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-ene-19	22-jul-19	700,000.00	742,283.77	740,400.16	(1,883.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	23-ene-19	22-jul-19	52,300,000.00	58,258,567.61	56,348,112.40	(1,910,455.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	22-jul-19	2,000,000.00	2,000,198.31	2,115,358.35	115,160.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	22-jul-19	1,000,000.00	1,000,680.66	1,057,714.51	57,033.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	94,300,000.00	101,249,823.45	98,627,354.24	(2,622,469.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	1,700,000.00	1,937,260.72	1,900,659.97	(36,600.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	6,300,000.00	7,270,068.56	7,043,622.23	(226,446.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	3,000,000.00	3,529,183.48	3,354,105.83	(175,077.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	21-jun-19	22-jul-19	900,000.00	1,012,069.19	1,006,231.75	(5,837.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	22-jul-19	44,000,000.00	47,872,630.13	46,536,329.30	(1,336,300.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	3,400,000.00	3,905,583.17	3,801,319.94	(104,263.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	900,000.00	1,019,703.13	1,006,231.75	(13,471.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	1,700,000.00	1,936,751.13	1,900,659.97	(36,091.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-may-19	22-jul-19	500,000.00	571,524.38	559,114.62	(12,409.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	22-jul-19	10,900,000.00	11,672,645.94	11,400,192.59	(272,453.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-abr-19	22-jul-19	2,500,000.00	2,721,715.53	2,644,109.62	(77,605.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-may-19	22-jul-19	480,000.00	489,613.52	479,287.99	(10,325.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	22-may-19	22-jul-19	4,600,000.00	4,905,388.78	4,811,090.45	(94,298.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-jun-19	22-jul-19	12,900,000.00	14,948,213.07	14,425,157.08	(523,055.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-mar-19	22-jul-19	7,600,000.00	8,511,459.79	8,498,542.15	(12,917.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	2,700,000.00	2,893,598.63	2,823,900.92	(69,697.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	900,000.00	964,532.87	941,300.31	(23,232.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	6,700,000.00	7,237,974.66	7,007,457.83	(230,516.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	1,600,000.00	1,839,873.84	1,788,856.44	(51,017.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	22-jul-19	1,300,000.00	1,528,852.78	1,453,445.86	(75,406.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	21-jun-19	22-jul-19	670,000.00	680,936.99	676,117.73	(4,819.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	1,800,000.00	1,928,641.10	1,882,600.61	(46,040.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	22-jul-19	3,100,000.00	3,377,656.19	3,242,256.61	(135,399.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	22-jul-19	1,200,000.00	1,313,872.54	1,269,172.62	(44,699.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	22-jul-19	410,000.00	416,682.80	409,391.82	(7,290.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-may-19	22-jul-19	5,900,000.00	6,425,842.28	6,240,098.70	(185,743.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-abr-19	22-jul-19	8,400,000.00	9,186,805.83	8,884,208.32	(302,597.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-abr-19	22-jul-19	290,000.00	295,808.59	289,569.82	(6,238.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	22-abr-19	22-jul-19	9,300,000.00	9,988,244.55	9,726,769.82	(261,474.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	23-abr-19	22-jul-19	400,000.00	401,403.59	403,652.38	2,248.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	22-jul-19	9,000,000.00	9,702,842.86	9,518,794.63	(184,048.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-abr-19	22-jul-19	400,000.00	475,228.50	447,291.69	(27,936.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-abr-19	22-jul-19	500,000.00	559,202.93	559,114.62	(88.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	22-ene-19	22-jul-19	470,000.00	478,695.88	474,291.54	(4,404.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	22-jul-19	1,900,000.00	1,980,780.47	2,009,590.44	28,809.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-ene-19	22-jul-19	700,000.00	747,819.94	740,350.69	(7,469.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-jun-19	23-jul-19	4,800,000.00	5,201,742.88	5,020,148.14	(181,594.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	21-jun-19	23-jul-19	2,100,000.00	2,422,521.94	2,347,768.91	(74,753.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	23-jul-19	1,700,000.00	1,937,096.33	1,900,574.83	(36,521.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	23-jul-19	2,700,000.00	3,099,013.31	3,018,560.03	(80,453.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	23-jul-19	8,700,000.00	9,572,250.20	9,201,117.87	(371,132.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-jun-19	23-jul-19	480,000.00	485,682.32	484,318.93	(1,363.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	23-jul-19	10,500,000.00	11,497,128.09	11,104,797.43	(392,330.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	23-jul-19	2,900,000.00	3,133,926.72	3,067,039.29	(66,887.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-abr-19	23-jul-19	9,200,000.00	10,467,393.39	10,287,323.00	(180,070.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-abr-19	23-jul-19	24,300,000.00	26,538,323.79	25,699,674.06	(838,649.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-abr-19	23-jul-19	800,000.00	872,471.62	846,079.80	(26,391.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-jun-19	23-jul-19	7,500,000.00	8,702,498.29	8,384,888.97	(317,609.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	23-jul-19	480,000.00	486,402.26	479,275.48	(7,126.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	23-jul-19	33,100,000.00	38,075,836.49	35,012,644.85	(3,063,191.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	23-jul-19	13,100,000.00	14,301,938.46	13,854,556.80	(447,381.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	24-may-19	23-jul-19	8,300,000.00	8,869,391.60	8,680,672.83	(188,718.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	23-abr-19	23-jul-19	1,800,000.00	2,022,483.32	2,012,373.35	(10,109.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	23-jul-19	2,300,000.00	2,451,757.04	2,432,479.44	(19,277.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	24-ene-19	23-jul-19	1,000,000.00	989,253.43	1,057,599.76	68,346.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-ene-19	23-jul-19	390,000.00	396,512.87	393,523.29	(2,989.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-jun-19	24-jul-19	480,000.00	489,377.79	479,262.97	(10,114.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-jun-19	24-jul-19	240,000.00	242,928.38	239,631.48	(3,296.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-jun-19	24-jul-19	240,000.00	248,782.24	239,631.48	(9,150.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	5,000,000.00	5,814,082.95	5,589,675.57	(224,407.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	900,000.00	970,553.11	951,869.02	(18,684.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-jun-19	24-jul-19	530,000.00	533,074.69	534,698.24	1,623.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	2,700,000.00	3,097,591.68	3,018,424.81	(79,166.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	1,100,000.00	1,238,372.39	1,229,728.63	(8,643.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
DR0223	24-jun-19	24-jul-19	22,400,000.00	23,073,311.88	22,395,193.18	(678,118.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	900,000.00	956,180.48	951,800.09	(4,380.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	5,000,000.00	5,811,863.77	5,589,675.57	(222,188.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jun-19	24-jul-19	14,000,000.00	15,318,341.10	14,805,779.24	(512,561.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	1,300,000.00	1,449,908.22	1,453,315.65	3,407.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-jun-19	24-jul-19	580,000.00	582,612.60	585,141.47	2,528.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	9,200,000.00	10,048,512.33	9,729,512.07	(319,000.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	10,500,000.00	11,493,703.77	11,104,334.43	(389,369.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	900,000.00	956,180.48	951,800.09	(4,380.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	24-jul-19	6,700,000.00	7,744,319.83	7,490,165.26	(254,154.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-jun-19	24-jul-19	1,100,000.00	1,216,744.05	1,163,311.23	(53,432.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-abr-19	24-jul-19	7,600,000.00	8,655,431.33	8,497,904.53	(157,526.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	24-abr-19	24-jul-19	160,000.00	168,760.71	163,239.33	(5,521.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-abr-19	24-jul-19	490,000.00	494,741.73	494,380.67	(361.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-abr-19	24-jul-19	240,000.00	246,397.21	239,631.48	(6,765.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	24-jul-19	6,700,000.00	7,746,619.63	7,490,165.26	(256,454.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	24-jul-19	2,500,000.00	2,906,398.20	2,794,837.79	(111,560.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-abr-19	24-jul-19	1,700,000.00	1,962,083.52	1,900,489.69	(61,593.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-abr-19	24-jul-19	500,000.00	504,434.19	504,470.07	35.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-ene-19	24-jul-19	1,500,000.00	1,524,078.98	1,586,333.49	62,254.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	25-ene-19	24-jul-19	230,000.00	232,824.69	232,056.23	(768.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-jun-19	25-jul-19	3,600,000.00	3,971,022.26	3,822,714.04	(148,308.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-jun-19	25-jul-19	700,000.00	769,814.74	743,305.51	(26,509.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-jun-19	25-jul-19	1,400,000.00	1,515,542.36	1,486,611.02	(28,931.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	25-jun-19	25-jul-19	1,400,000.00	1,529,628.71	1,480,516.19	(49,112.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	25-jun-19	25-jul-19	680,000.00	685,255.72	685,937.36	681.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	2,300,000.00	2,631,111.95	2,571,135.56	(59,976.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	7,000,000.00	8,106,422.68	7,825,195.19	(281,227.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	25-jul-19	1,200,000.00	1,224,387.73	1,198,126.14	(26,261.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	4,600,000.00	5,327,063.20	5,142,271.13	(184,792.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	900,000.00	1,051,445.07	1,006,096.53	(45,348.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	25-jun-19	25-jul-19	520,000.00	526,092.16	524,540.34	(1,551.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	25-jun-19	25-jul-19	520,000.00	527,593.42	524,540.34	(3,053.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	900,000.00	1,051,207.58	1,006,096.53	(45,111.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	25-jun-19	25-jul-19	47,500,000.00	51,532,925.62	49,676,171.27	(1,856,754.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	25-jul-19	1,460,000.00	1,489,390.96	1,457,833.57	(31,557.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	25-jul-19	3,700,000.00	4,218,623.93	4,136,174.60	(82,449.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	26-jun-19	25-jul-19	9,700,000.00	10,414,560.47	10,144,397.08	(270,163.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	25-jul-19	3,500,000.00	4,057,206.82	3,912,597.60	(144,609.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	25-jul-19	4,500,000.00	5,214,337.44	5,030,482.63	(183,854.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	25-jul-19	9,500,000.00	10,305,384.90	10,046,359.83	(259,025.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	26-jun-19	25-jul-19	9,500,000.00	10,305,384.90	10,046,359.83	(259,025.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	25-jul-19	9,500,000.00	10,305,384.90	10,046,359.83	(259,025.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	25-jul-19	9,500,000.00	10,305,384.90	10,046,359.83	(259,025.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	26-jun-19	25-jul-19	1,800,000.00	1,985,920.55	1,911,357.02	(74,563.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jun-19	25-jul-19	16,700,000.00	18,157,009.72	17,660,443.07	(496,566.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	25-jul-19	480,000.00	485,438.65	479,343.69	(6,094.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	25-jul-19	480,000.00	485,438.65	479,343.69	(6,094.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	25-jul-19	7,000,000.00	8,031,240.07	7,825,195.19	(206,044.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	25-jul-19	9,600,000.00	10,482,172.40	10,152,110.99	(330,061.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	25-jul-19	4,900,000.00	5,611,797.23	5,477,636.64	(134,160.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	26-jun-19	25-jul-19	580,000.00	582,464.93	585,064.22	2,599.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	25-jul-19	1,000,000.00	1,111,447.68	1,117,885.03	6,437.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jun-19	25-jul-19	43,000,000.00	47,177,160.74	45,472,997.12	(1,704,163.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-jun-19	25-jul-19	8,800,000.00	9,572,619.18	9,306,101.74	(266,517.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	25-jul-19	2,100,000.00	2,418,743.02	2,347,558.56	(71,184.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-abr-19	25-jul-19	1,600,000.00	1,703,378.85	1,692,145.78	(11,233.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-abr-19	25-jul-19	900,000.00	1,019,396.46	1,006,096.53	(13,299.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	26-abr-19	25-jul-19	340,000.00	338,995.14	342,968.68	3,973.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	26-abr-19	25-jul-19	390,000.00	393,230.68	393,405.25	174.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-may-19	26-jul-19	5,600,000.00	6,117,115.48	5,921,817.77	(195,297.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	26-jul-19	8,200,000.00	9,262,977.42	9,168,103.77	(94,873.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27-may-19	26-jul-19	500,000.00	512,574.15	531,040.44	18,466.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-mar-19	26-jul-19	1,100,000.00	1,247,004.43	1,229,618.43	(17,386.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-mar-19	26-jul-19	2,900,000.00	3,047,229.43	3,066,655.63	19,426.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	26-jul-19	800,000.00	929,767.71	894,340.42	(35,427.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	26-jul-19	1,000,000.00	1,047,619.51	1,057,467.46	9,847.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	26-jul-19	6,100,000.00	6,141,902.59	6,451,054.84	309,152.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-ene-19	26-jul-19	3,800,000.00	3,955,092.51	4,018,376.34	63,283.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-ene-19	26-jul-19	700,000.00	754,532.96	740,227.22	(14,305.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	26-jul-19	1,900,000.00	2,173,071.49	2,123,886.38	(49,185.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	26-jul-19	800,000.00	929,579.36	894,340.42	(35,238.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-may-19	26-jul-19	4,300,000.00	4,661,046.58	4,547,464.89	(113,581.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-jun-19	26-jul-19	480,000.00	485,436.30	479,334.66	(6,101.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	2,000,000.00	2,356,061.57	2,235,669.88	(120,391.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	26-jun-19	26-jul-19	3,400,000.00	3,869,414.02	3,800,638.79	(68,775.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	26-jun-19	26-jul-19	640,000.00	643,000.00	645,554.96	2,554.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	5,200,000.00	5,914,860.48	5,813,212.74	(101,647.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	26-jun-19	26-jul-19	51,620,000.00	52,443,422.04	51,177,267.79	(1,266,154.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	26-jun-19	26-jul-19	21,250,000.00	22,204,221.48	21,676,603.37	(527,618.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0224	26-jun-19	26-jul-19	28,240,000.00	29,695,871.89	28,719,505.28	(976,366.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	26-jun-19	26-jul-19	5,400,000.00	5,958,772.60	5,733,876.06	(224,896.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	26-jun-19	26-jul-19	4,500,000.00	4,813,691.78	4,706,050.95	(107,640.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	26-jun-19	26-jul-19	900,000.00	963,149.31	941,210.19	(21,939.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	800,000.00	969,704.66	894,267.95	(75,436.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	26-jul-19	500,000.00	508,653.74	528,733.73	20,079.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	1,700,000.00	1,933,638.51	1,900,319.39	(33,319.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	900,000.00	1,065,644.25	1,006,051.44	(59,592.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-jun-19	26-jul-19	430,000.00	441,223.98	429,317.33	(11,906.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	3,400,000.00	3,892,732.87	3,800,638.79	(92,094.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	26-jul-19	1,400,000.00	1,595,233.92	1,564,968.91	(30,265.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-jun-19	26-jul-19	240,000.00	245,008.29	239,618.97	(5,389.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	26-jun-19	26-jul-19	8,700,000.00	9,570,405.14	9,199,966.89	(370,438.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-jun-19	26-jul-19	16,300,000.00	17,695,742.13	17,236,719.57	(459,022.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-may-19	26-jul-19	220,000.00	218,643.56	221,891.61	3,248.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-jun-19	26-jul-19	250,000.00	249,790.51	249,623.24	(167.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	26-jul-19	10,600,000.00	11,481,992.47	11,209,155.06	(272,837.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-jun-19	26-jul-19	290,000.00	291,341.71	289,539.59	(1,802.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	26-jul-19	1,000,000.00	1,167,610.69	1,117,834.94	(49,775.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	26-jul-19	1,500,000.00	1,750,656.50	1,676,752.41	(73,904.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27-jun-19	26-jul-19	62,800,000.00	68,571,407.74	66,682,854.97	(1,888,552.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	26-jul-19	4,500,000.00	5,145,436.79	5,030,257.22	(115,179.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	26-jul-19	2,900,000.00	3,337,474.24	3,241,721.32	(95,752.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-may-19	26-jul-19	600,000.00	671,986.86	670,700.96	(1,285.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	27-jun-19	29-jul-19	27,700,000.00	29,310,757.19	28,604,785.63	(705,971.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	1,400,000.00	1,630,326.61	1,564,182.96	(66,143.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	29-may-19	29-jul-19	390,000.00	393,655.22	393,088.59	(566.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	5,500,000.00	6,328,045.59	6,145,556.29	(182,489.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	28-jun-19	29-jul-19	30,990,000.00	31,617,598.11	30,931,289.16	(686,308.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	28-jun-19	29-jul-19	34,900,000.00	37,327,539.30	36,481,935.23	(845,604.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	29-jul-19	1,000,000.00	1,025,961.59	1,056,960.66	30,999.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	29-jul-19	8,600,000.00	8,900,069.74	9,089,861.69	189,791.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-abr-19	29-jul-19	2,600,000.00	3,003,402.07	2,904,911.21	(98,490.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30-abr-19	29-jul-19	430,000.00	428,691.79	433,366.60	4,674.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-abr-19	29-jul-19	1,100,000.00	1,233,049.97	1,229,111.26	(3,938.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	6-may-19	29-jul-19	23,300,000.00	25,022,322.04	24,356,134.41	(666,187.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-abr-19	29-jul-19	2,400,000.00	2,685,709.84	2,681,697.29	(4,012.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	2,500,000.00	2,902,357.31	2,793,183.85	(109,173.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	1,300,000.00	1,449,304.50	1,452,455.60	3,151.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	4,200,000.00	4,836,757.27	4,692,548.87	(144,208.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	5,100,000.00	5,800,179.78	5,698,095.06	(102,084.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	29-jul-19	9,300,000.00	10,038,834.25	9,829,734.16	(209,100.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	29-jul-19	9,700,000.00	10,517,930.29	10,252,518.42	(265,411.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	29-jul-19	14,200,000.00	15,294,949.64	15,010,139.13	(284,810.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-jun-19	29-jul-19	900,000.00	1,055,862.08	1,005,546.19	(50,315.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-jun-19	29-jul-19	350,000.00	351,083.84	352,740.26	1,656.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	27-jun-19	29-jul-19	1,700,000.00	1,932,691.89	1,899,365.02	(33,326.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30-may-19	29-jul-19	210,000.00	209,836.12	211,644.16	1,808.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-jun-19	29-jul-19	240,000.00	248,358.64	239,533.85	(8,824.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	28-jun-19	29-jul-19	7,700,000.00	8,219,800.56	8,049,022.96	(170,777.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27-jun-19	29-jul-19	2,900,000.00	3,226,863.02	3,077,886.83	(148,976.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-jun-19	29-jul-19	210,000.00	217,368.42	209,620.24	(7,748.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27-jun-19	29-jul-19	5,400,000.00	5,957,835.62	5,731,237.54	(226,598.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27-jun-19	29-jul-19	3,600,000.00	3,969,435.62	3,820,825.03	(148,610.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-jun-19	29-jul-19	520,000.00	522,697.63	524,071.24	1,373.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	30-jul-19	2,000,000.00	2,324,074.69	2,234,420.35	(89,654.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-may-19	30-jul-19	260,000.00	262,779.92	259,461.95	(3,317.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	28-jun-19	30-jul-19	19,950,000.00	20,048,682.08	19,812,978.76	(235,703.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	30-ene-19	30-jul-19	10,400,000.00	11,447,946.67	11,196,825.71	(251,120.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31-ene-19	30-jul-19	320,000.00	314,361.09	322,488.73	8,127.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-ene-19	30-jul-19	110,000.00	104,885.75	109,772.36	4,886.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	30-ene-19	30-jul-19	1,000,000.00	1,057,480.23	1,076,617.86	19,137.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-may-19	30-jul-19	1,800,000.00	1,963,704.37	1,902,597.89	(61,106.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	1-may-19	30-jul-19	10,000,000.00	11,296,145.66	11,174,691.86	(121,453.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	1-may-19	30-jul-19	20,500,000.00	23,679,993.54	22,070,666.07	(1,609,327.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-abr-19	30-jul-19	1,100,000.00	1,198,115.72	1,162,594.92	(35,520.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	30-abr-19	30-jul-19	41,700,000.00	43,865,811.70	42,851,205.57	(1,014,606.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	30-abr-19	30-jul-19	15,600,000.00	17,184,328.55	16,795,238.57	(389,089.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	30-abr-19	30-jul-19	12,000,000.00	13,225,676.42	12,919,414.29	(306,262.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	1,900,000.00	2,183,780.07	2,122,896.16	(60,883.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	28-jun-19	30-jul-19	3,200,000.00	3,428,575.56	3,304,420.93	(124,154.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1121	28-jun-19	30-jul-19	38,910,000.00	39,616,424.36	38,834,899.56	(781,524.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-jun-19	30-jul-19	190,000.00	195,761.12	189,606.81	(6,154.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-may-19	30-jul-19	300,000.00	320,176.86	317,071.34	(3,105.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-may-19	30-jul-19	210,000.00	210,210.30	211,613.68	1,403.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	1,700,000.00	1,933,184.64	1,899,257.30	(33,927.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-jun-19	30-jul-19	740,000.00	740,888.08	745,755.18	4,867.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	30-jul-19	900,000.00	1,042,904.48	1,005,489.16	(37,415.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-jun-19	30-jul-19	560,000.00	562,420.11	564,303.15	1,883.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	2,500,000.00	2,901,271.79	2,793,025.44	(108,246.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0326	28-jun-19	30-jul-19	14,200,000.00	15,026,206.85	14,663,367.86	(362,838.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31-may-19	30-jul-19	480,000.00	488,598.35	483,688.42	(4,909.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-jun-19	30-jul-19	8,800,000.00	9,559,756.17	9,300,759.32	(258,996.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	30-jul-19	5,000,000.00	5,844,661.29	5,586,050.89	(258,610.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	4,400,000.00	5,024,964.54	4,915,724.78	(109,239.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	5,300,000.00	6,048,931.03	5,921,213.94	(127,717.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	4,700,000.00	5,371,756.35	5,250,887.83	(120,868.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	3,400,000.00	3,870,928.20	3,798,514.60	(72,413.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-jun-19	30-jul-19	57,500,000.00	62,197,739.05	60,772,006.94	(1,425,732.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-jun-19	30-jul-19	9,000,000.00	9,741,160.83	9,512,989.44	(228,171.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-jun-19	30-jul-19	8,800,000.00	9,564,139.74	9,300,759.32	(263,380.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-jun-19	30-jul-19	8,900,000.00	9,661,290.49	9,406,449.77	(254,840.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	4,200,000.00	4,841,074.10	4,692,282.74	(148,791.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	30-jul-19	600,000.00	682,742.36	670,326.11	(12,416.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	1-feb-19	31-jul-19	280,000.00	283,043.29	282,110.95	(932.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	2-may-19	31-jul-19	490,000.00	490,378.36	493,694.16	3,315.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-feb-19	31-jul-19	3,000,000.00	3,135,335.75	3,170,544.81	35,209.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	31-jul-18	31-jul-19	9,400,000.00	9,740,138.36	9,934,373.75	194,235.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-may-19	31-jul-19	1,200,000.00	1,279,153.51	1,268,334.72	(10,818.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-may-19	31-jul-19	5,500,000.00	6,198,994.25	6,145,776.85	(53,217.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-may-19	1-ago-19	2,800,000.00	2,919,556.24	2,926,602.48	7,046.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-may-19	1-ago-19	25,500,000.00	27,225,475.80	26,652,986.90	(572,488.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30-abr-19	1-ago-19	360,000.00	363,210.12	362,661.83	(548.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	1-ago-19	4,300,000.00	4,890,452.87	4,804,642.67	(85,810.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	6-may-19	1-ago-19	23,100,000.00	24,819,410.96	24,144,470.48	(674,940.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-may-19	1-ago-19	510,000.00	512,732.86	513,821.39	1,088.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ago-18	1-ago-19	100,000.00	149,696.52	105,684.22	(44,012.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-may-19	1-ago-19	1,900,000.00	1,998,461.27	2,007,904.94	9,443.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-may-19	1-ago-19	290,000.00	294,719.18	292,144.25	(2,574.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	2-ago-19	7,100,000.00	7,700,853.26	7,502,824.66	(198,028.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-jun-19	2-ago-19	200,000.00	203,827.31	199,563.39	(4,263.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	2-ago-19	1,500,000.00	1,771,404.92	1,675,530.09	(95,874.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	2-ago-19	2,400,000.00	2,798,270.52	2,680,848.15	(117,422.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	28-jun-19	2-ago-19	10,000,000.00	10,994,698.65	10,740,482.62	(254,216.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	4-jun-19	2-ago-19	5,100,000.00	5,449,819.54	5,330,406.15	(119,413.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	2-ago-19	900,000.00	1,022,826.55	1,005,420.10	(17,406.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-ago-18	2-ago-19	1,200,000.00	1,176,179.36	1,268,206.97	92,027.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	2-ago-19	900,000.00	1,022,826.55	1,005,420.10	(17,406.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	2-ago-19	900,000.00	1,022,826.55	1,005,420.10	(17,406.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	2-ago-19	9,000,000.00	9,704,181.39	9,511,552.27	(192,629.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-feb-19	2-ago-19	560,000.00	569,583.95	564,087.88	(5,496.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-feb-19	2-ago-19	140,000.00	151,811.18	139,023.15	(12,788.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-feb-19	2-ago-19	600,000.00	658,023.55	634,072.50	(23,951.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-feb-19	5-ago-19	3,200,000.00	3,255,893.03	3,381,015.16	125,122.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-feb-19	5-ago-19	500,000.00	492,817.46	528,311.67	35,494.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-feb-19	5-ago-19	7,900,000.00	8,180,368.71	8,346,881.17	166,512.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-feb-19	5-ago-19	4,200,000.00	4,204,671.97	4,438,053.63	233,381.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-feb-19	5-ago-19	6,500,000.00	6,689,008.79	6,867,687.03	178,678.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-feb-19	5-ago-19	2,200,000.00	2,250,748.67	2,324,694.76	73,946.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-may-19	5-ago-19	400,000.00	491,036.71	446,855.16	(44,181.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	5-jun-19	5-ago-19	510,000.00	513,230.34	513,474.88	244.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	7-may-19	5-ago-19	11,400,000.00	12,199,456.04	12,046,145.58	(153,310.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	5-ago-19	2,700,000.00	2,878,785.75	2,852,731.54	(26,054.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	27-may-19	5-ago-19	11,800,000.00	12,608,536.33	12,331,769.27	(276,767.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-may-19	5-ago-19	900,000.00	1,011,777.30	1,005,257.78	(6,519.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-may-19	5-ago-19	2,800,000.00	3,035,199.49	2,958,388.26	(76,811.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-may-19	5-ago-19	1,900,000.00	2,042,483.26	2,007,690.93	(34,792.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-may-19	5-ago-19	3,800,000.00	4,040,411.81	4,014,955.50	(25,456.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-may-19	5-ago-19	1,200,000.00	1,343,740.08	1,340,565.49	(3,174.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-may-19	5-ago-19	700,000.00	772,558.30	781,996.54	9,438.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	6-may-19	5-ago-19	150,000.00	160,501.56	148,891.66	(11,609.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-jun-19	5-ago-19	180,000.00	178,947.76	179,586.58	638.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	28-jun-19	5-ago-19	700,000.00	770,961.10	731,545.63	(39,415.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-ago-19	4,100,000.00	4,349,278.61	4,331,925.67	(17,352.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-ago-19	9,400,000.00	10,106,640.16	9,931,732.02	(174,908.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-feb-19	6-ago-19	3,300,000.00	3,497,706.72	3,486,486.36	(11,220.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-feb-19	6-ago-19	1,000,000.00	1,088,312.33	1,056,568.61	(31,743.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-feb-19	6-ago-19	500,000.00	502,531.88	528,255.51	25,723.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	7-feb-19	6-ago-19	1,000,000.00	1,002,876.92	1,056,511.02	53,634.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-may-19	6-ago-19	1,600,000.00	1,742,503.97	1,690,417.63	(52,086.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-may-19	6-ago-19	1,300,000.00	1,468,579.33	1,451,796.48	(16,782.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	6-ago-19	270,000.00	272,704.09	269,369.64	(3,334.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	6-ago-19	100,000.00	103,711.27	99,766.53	(3,944.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-abr-19	6-ago-19	400,000.00	445,019.00	446,757.19	1,738.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-may-19	7-ago-19	2,000,000.00	2,139,877.86	2,112,909.60	(26,968.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-feb-19	7-ago-19	1,500,000.00	1,520,538.35	1,584,770.81	64,232.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-feb-19	7-ago-19	2,500,000.00	2,546,938.12	2,641,432.39	94,494.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	7-ago-19	16,400,000.00	17,505,601.34	17,137,839.33	(367,762.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-feb-19	7-ago-19	1,400,000.00	1,469,009.99	1,479,119.42	10,109.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	8-feb-19	7-ago-19	500,000.00	551,612.54	519,223.77	(32,388.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-may-19	7-ago-19	1,000,000.00	1,064,559.46	1,056,454.80	(8,104.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-may-19	7-ago-19	1,500,000.00	1,641,945.40	1,584,682.20	(57,263.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-jun-19	8-ago-19	3,050,000.00	3,111,103.17	3,042,648.09	(68,455.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	8-ago-19	2,300,000.00	2,498,125.62	2,429,995.34	(68,130.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	8-ago-19	900,000.00	964,505.33	950,758.72	(13,746.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0921	10-may-19	8-ago-19	280,000.00	287,492.44	279,325.07	(8,167.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	10-may-19	8-ago-19	490,000.00	495,774.29	488,876.84	(6,897.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-jun-19	8-ago-19	410,000.00	422,624.83	409,011.71	(13,613.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-may-19	8-ago-19	1,000,000.00	1,127,438.49	1,116,639.73	(10,798.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	9-ago-19	15,400,000.00	16,673,269.10	16,269,583.63	(403,685.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	9-ago-19	290,000.00	293,808.04	289,289.97	(4,518.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	16-may-19	9-ago-19	46,100,000.00	48,760,041.78	48,170,591.31	(589,450.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	21-may-19	9-ago-19	8,200,000.00	8,745,804.49	8,568,304.75	(177,499.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	9-ago-19	9,800,000.00	10,605,454.66	10,353,371.40	(252,083.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	9-ago-19	1,300,000.00	1,441,066.23	1,373,245.05	(67,821.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	9-ago-19	600,000.00	642,516.54	633,879.88	(8,636.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-jun-19	9-ago-19	510,000.00	509,866.81	513,241.24	3,374.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	9-ago-19	2,200,000.00	2,475,964.54	2,456,767.72	(19,196.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-ago-18	9-ago-19	900,000.00	945,512.29	950,708.11	5,195.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-feb-19	9-ago-19	4,800,000.00	5,019,092.49	5,070,443.27	51,350.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-feb-19	9-ago-19	510,000.00	508,447.77	513,241.24	4,793.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-feb-19	9-ago-19	490,000.00	491,603.68	493,084.14	1,480.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	11-jun-19	9-ago-19	7,700,000.00	8,281,064.91	8,045,847.14	(235,217.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-feb-19	9-ago-19	180,000.00	181,852.22	181,121.93	(730.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-mar-19	12-ago-19	500,000.00	543,521.09	558,375.71	14,854.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-feb-19	12-ago-19	7,400,000.00	7,647,926.64	7,816,669.75	168,743.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12-feb-19	12-ago-19	500,000.00	551,450.60	519,133.18	(32,317.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	12-feb-19	12-ago-19	3,000,000.00	3,247,007.55	3,132,706.73	(114,300.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-18	12-ago-19	1,000,000.00	954,938.36	1,056,173.65	101,235.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	12-ago-19	130,000.00	132,101.92	129,666.92	(2,435.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	12-ago-19	4,500,000.00	4,828,869.90	4,752,781.41	(76,088.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-may-19	12-ago-19	800,000.00	920,237.80	893,108.89	(27,128.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-may-19	12-ago-19	490,000.00	488,357.95	492,840.78	4,482.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	12-ago-19	240,000.00	244,971.10	239,385.09	(5,586.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-may-19	12-ago-19	900,000.00	1,083,080.22	1,004,747.50	(78,332.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-may-19	12-ago-19	590,000.00	591,954.39	593,420.53	1,466.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	12-ago-19	5,000,000.00	5,308,885.22	5,281,533.61	(27,351.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-may-19	12-ago-19	310,000.00	314,491.07	311,837.92	(2,653.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	12-ago-19	900,000.00	994,797.32	950,676.05	(44,121.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	13-may-19	12-ago-19	900,000.00	1,016,312.96	1,004,747.50	(11,565.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-may-19	12-ago-19	50,200,000.00	57,446,707.46	52,420,625.88	(5,026,081.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	12-ago-19	480,000.00	489,942.20	478,770.18	(11,172.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	12-ago-19	240,000.00	244,971.10	239,385.09	(5,586.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	6-mar-19	12-ago-19	+3,000,000.00	3,113,829.07	3,096,638.74	(17,190.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-jun-19	12-ago-19	430,000.00	437,880.38	429,038.03	(8,842.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-may-19	12-ago-19	2,600,000.00	2,937,690.11	2,902,983.73	(34,706.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	12-ago-19	2,000,000.00	2,223,682.83	2,112,347.29	(111,335.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-may-19	12-ago-19	2,000,000.00	2,241,673.43	2,232,772.22	(8,901.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-may-19	12-ago-19	800,000.00	874,645.92	893,108.89	18,462.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	12-ago-19	1,000,000.00	1,149,109.41	1,116,532.20	(32,577.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	12-ago-19	2,000,000.00	2,287,965.76	2,233,064.41	(54,901.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-feb-19	13-ago-19	1,000,000.00	1,026,521.58	1,056,185.43	29,663.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	14-feb-19	13-ago-19	900,000.00	1,035,298.38	968,187.02	(67,111.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-may-19	13-ago-19	10,600,000.00	11,601,655.62	11,194,844.49	(406,811.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-may-19	13-ago-19	4,300,000.00	4,876,575.97	4,800,187.58	(76,388.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-may-19	13-ago-19	4,200,000.00	4,472,201.21	4,436,264.57	(35,936.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	15-may-19	13-ago-19	1,100,000.00	1,240,183.52	1,227,954.96	(12,228.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	13-ago-19	10,800,000.00	12,403,279.40	12,057,898.34	(345,381.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-jun-19	13-ago-19	540,000.00	540,172.50	543,124.74	2,952.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-may-19	13-ago-19	4,100,000.00	4,675,908.18	4,578,454.44	(97,453.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-may-19	13-ago-19	290,000.00	295,161.47	289,284.52	(5,876.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-feb-19	14-ago-19	310,000.00	314,414.22	311,707.23	(2,706.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	14-ago-19	1,400,000.00	1,472,270.42	1,478,680.30	6,409.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	15-feb-19	14-ago-19	570,000.00	561,058.67	573,217.28	12,158.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	14-ago-19	1,000,000.00	1,022,467.83	1,056,061.16	33,593.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	14-ago-19	3,500,000.00	3,723,031.36	3,696,214.06	(26,817.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	14-ago-19	3,600,000.00	3,765,611.63	3,801,820.18	36,208.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	16-may-19	14-ago-19	510,000.00	517,004.52	512,808.67	(4,195.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-may-19	14-ago-19	3,000,000.00	3,430,014.00	3,349,235.79	(80,778.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-may-19	14-ago-19	800,000.00	887,083.37	893,129.54	6,046.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	14-ago-19	2,200,000.00	2,532,078.74	2,455,770.40	(76,308.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-may-19	14-ago-19	2,600,000.00	2,945,989.21	2,902,274.11	(43,715.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	16-may-19	14-ago-19	390,000.00	390,288.21	392,147.81	1,859.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	16-may-19	14-ago-19	1,700,000.00	1,949,650.43	1,897,640.76	(52,009.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-may-19	15-ago-19	630,000.00	634,467.00	633,378.08	(1,088.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	17-abr-19	15-ago-19	8,700,000.00	10,090,673.94	9,226,505.40	(864,168.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-feb-19	15-ago-19	1,000,000.00	1,005,898.18	1,056,004.91	50,106.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	15-ago-19	1,500,000.00	1,610,294.42	1,584,007.37	(26,287.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-abr-19	15-ago-19	15,900,000.00	18,164,920.12	17,753,713.88	(411,206.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-may-19	15-ago-19	480,000.00	489,809.11	478,715.57	(11,093.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-may-19	15-ago-19	480,000.00	489,192.67	478,715.57	(10,477.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	15-ago-19	1,500,000.00	1,751,306.94	1,674,878.67	(76,428.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-may-19	15-ago-19	123,370,000.00	125,822,681.31	123,082,667.99	(2,740,013.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	15-ago-19	1,200,000.00	1,391,376.52	1,339,435.02	(51,941.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-jun-19	15-ago-19	740,000.00	746,073.23	743,967.91	(2,105.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	15-ago-19	3,000,000.00	3,469,106.57	3,349,055.37	(120,051.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-jun-19	15-ago-19	480,000.00	484,677.95	482,573.78	(2,104.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	15-ago-19	1,200,000.00	1,336,664.46	1,267,205.89	(69,458.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	20-may-19	19-ago-19	300,000.00	309,955.05	308,051.40	(1,903.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	19-ago-19	5,900,000.00	6,430,924.56	6,229,101.36	(201,823.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	18-jun-19	19-ago-19	500,000.00	510,422.46	527,889.95	17,467.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	18-jun-19	19-ago-19	1,200,000.00	1,377,765.42	1,290,476.57	(87,288.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-jun-19	19-ago-19	130,000.00	129,855.72	129,632.41	(223.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-feb-19	19-ago-19	3,300,000.00	3,471,835.40	3,484,073.64	12,238.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-feb-19	19-ago-19	3,800,000.00	3,884,615.09	4,012,548.85	127,933.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-feb-19	19-ago-19	1,300,000.00	1,316,650.65	1,372,714.08	56,063.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-feb-19	19-ago-19	480,000.00	472,866.63	482,367.97	9,501.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-feb-19	19-ago-19	1,200,000.00	1,259,298.33	1,266,935.87	7,637.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-jun-19	19-ago-19	1,100,000.00	1,304,311.17	1,227,722.33	(76,588.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21-may-19	19-ago-19	3,400,000.00	3,894,204.41	3,795,640.75	(98,563.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21-may-19	19-ago-19	440,000.00	438,284.79	442,103.80	3,819.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-may-19	19-ago-19	220,000.00	227,456.95	219,377.92	(8,079.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	19-ago-19	44,900,000.00	50,374,526.56	50,124,785.22	(249,741.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-may-19	19-ago-19	2,700,000.00	3,103,798.05	3,013,500.26	(90,297.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	20-may-19	19-ago-19	10,500,000.00	12,196,635.69	11,291,670.00	(904,965.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-may-19	20-ago-19	350,000.00	348,399.65	351,622.66	3,223.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-feb-19	20-ago-19	1,900,000.00	1,964,371.95	2,006,024.04	41,652.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0921	21-jun-19	20-ago-19	210,000.00	217,071.78	209,398.23	(7,673.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	20-ago-19	500,000.00	496,513.69	527,940.32	31,426.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-may-19	20-ago-19	2,100,000.00	2,435,793.16	2,343,345.23	(92,447.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-may-19	20-ago-19	2,700,000.00	3,088,656.36	3,012,872.44	(75,783.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-abr-19	20-ago-19	1,600,000.00	1,846,902.55	1,785,405.89	(61,496.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-may-19	20-ago-19	1,100,000.00	1,265,529.51	1,227,940.69	(37,588.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	20-ago-19	900,000.00	961,169.38	950,151.26	(11,018.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	21-jun-19	20-ago-19	1,000,000.00	1,052,207.78	1,031,955.30	(20,252.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	20-ago-19	900,000.00	954,940.41	950,151.26	(4,789.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-may-19	20-ago-19	5,700,000.00	6,118,867.06	6,017,624.67	(101,242.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-may-19	20-ago-19	2,100,000.00	2,435,815.59	2,343,345.23	(92,470.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	22-feb-19	21-ago-19	480,000.00	477,185.65	478,606.30	1,420.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-may-19	21-ago-19	900,000.00	957,926.37	950,244.63	(7,681.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-may-19	22-ago-19	4,700,000.00	5,279,551.08	5,244,874.50	(34,676.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-may-19	22-ago-19	4,300,000.00	4,923,587.71	4,797,732.68	(125,855.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-mar-19	22-ago-19	100,000.00	99,375.89	99,713.81	337.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-feb-19	22-ago-19	900,000.00	951,853.28	950,049.98	(1,803.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	22-ago-18	22-ago-19	600,000.00	576,078.08	633,366.65	57,288.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-ago-18	22-ago-19	1,200,000.00	1,201,720.55	1,266,831.11	65,110.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-abr-19	22-ago-19	1,400,000.00	1,565,940.03	1,562,052.50	(3,887.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-abr-19	23-ago-19	310,000.00	310,412.81	309,076.37	(1,336.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-feb-19	23-ago-19	900,000.00	953,299.87	1,004,283.53	50,983.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-feb-19	23-ago-19	800,000.00	849,067.22	844,576.66	(4,490.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	23-ago-19	16,800,000.00	18,821,591.59	18,751,220.46	(70,371.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-jun-19	23-ago-19	4,500,000.00	4,956,164.50	4,770,588.77	(185,575.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	23-ago-19	800,000.00	890,133.92	892,550.67	2,416.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-jun-19	23-ago-19	6,400,000.00	7,428,795.27	7,141,571.76	(287,223.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-feb-19	23-ago-19	7,200,000.00	7,382,458.20	7,601,189.95	218,731.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-jun-19	26-ago-19	600,000.00	680,866.67	633,231.58	(47,635.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	27-may-19	26-ago-19	5,100,000.00	5,960,097.11	5,482,346.45	(477,750.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-feb-19	26-ago-19	1,500,000.00	1,582,955.24	1,583,078.96	123.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-feb-19	26-ago-19	2,800,000.00	2,944,043.84	2,955,080.72	11,036.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	26-feb-19	26-ago-19	5,400,000.00	5,785,970.87	5,543,472.10	(242,498.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-may-19	26-ago-19	1,000,000.00	1,144,782.20	1,115,497.95	(29,284.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0921	28-may-19	26-ago-19	270,000.00	273,089.31	269,164.80	(3,924.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-may-19	26-ago-19	590,000.00	590,978.54	592,323.24	1,344.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-may-19	26-ago-19	5,600,000.00	6,073,216.59	5,911,141.57	(162,075.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-may-19	27-ago-19	510,000.00	511,346.92	508,491.71	(2,855.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-feb-19	27-ago-19	460,000.00	467,706.31	461,665.13	(6,041.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	28-feb-19	27-ago-19	1,900,000.00	2,063,759.98	1,950,407.88	(113,352.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28-feb-19	27-ago-19	8,400,000.00	9,320,832.43	8,903,473.55	(417,358.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-feb-19	27-ago-19	7,800,000.00	8,553,189.56	8,235,043.96	(318,145.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-feb-19	27-ago-19	2,400,000.00	2,465,599.12	2,533,218.51	67,619.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	28-may-19	27-ago-19	25,800,000.00	28,690,255.32	27,732,648.51	(957,606.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	28-may-19	27-ago-19	61,400,000.00	68,199,601.78	65,999,403.83	(2,200,197.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	28-may-19	27-ago-19	59,400,000.00	65,992,384.26	63,849,586.11	(2,142,798.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-may-19	27-ago-19	13,800,000.00	14,904,000.65	14,566,006.43	(337,994.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-may-19	27-ago-19	800,000.00	931,061.41	892,738.58	(38,322.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-may-19	27-ago-19	1,600,000.00	1,789,006.80	1,784,695.18	(4,311.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-may-19	27-ago-19	480,000.00	485,774.79	481,737.53	(4,037.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-mar-19	28-ago-19	2,000,000.00	2,069,052.73	2,112,473.60	43,420.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	30-may-19	28-ago-19	3,500,000.00	4,003,454.69	3,907,500.36	(95,954.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	29-ago-19	2,600,000.00	2,999,641.82	2,902,594.58	(97,047.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	29-ago-19	1,600,000.00	1,845,779.29	1,787,021.20	(58,758.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-mar-19	30-ago-19	480,000.00	480,435.89	482,043.83	1,607.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	30-may-19	30-ago-19	430,000.00	439,199.58	429,022.38	(10,177.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-mar-19	30-ago-19	270,000.00	266,776.53	271,124.72	4,348.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	4-mar-19	30-ago-19	460,000.00	465,823.57	461,916.19	(3,907.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	30-ago-19	1,300,000.00	1,463,778.95	1,451,237.30	(12,541.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	6-mar-19	2-sep-19	106,000,000.00	114,223,280.12	114,014,212.91	(209,067.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-sep-18	2-sep-19	4,500,000.00	4,431,830.06	4,752,595.61	320,765.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	2-sep-19	600,000.00	704,487.77	669,718.75	(34,769.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	3-jun-19	2-sep-19	110,000.00	111,490.60	109,795.19	(1,695.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	2-sep-19	900,000.00	970,878.11	950,430.80	(20,447.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	2-sep-19	30,800,000.00	34,439,141.50	34,395,492.92	(43,648.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	2-sep-19	26,700,000.00	29,009,287.08	28,196,113.80	(813,173.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-jun-19	2-sep-19	500,000.00	582,526.44	558,368.39	(24,158.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-jun-19	2-sep-19	280,000.00	285,366.45	279,344.46	(6,021.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	6-mar-19	2-sep-19	6,500,000.00	6,844,019.12	6,864,222.46	20,203.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-mar-19	2-sep-19	1,900,000.00	1,960,957.90	2,006,465.03	45,507.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-mar-19	2-sep-19	1,600,000.00	1,659,072.60	1,689,811.77	30,739.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-mar-19	2-sep-19	2,600,000.00	2,700,844.98	2,746,199.32	45,354.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-mar-19	2-sep-19	4,700,000.00	4,897,192.05	4,963,822.08	66,630.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	7-mar-19	3-sep-19	54,200,000.00	61,965,348.15	58,295,398.32	(3,669,949.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	3-jun-19	3-sep-19	200,000.00	202,131.55	205,848.70	3,717.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	14-mar-19	3-sep-19	54,200,000.00	58,855,587.59	58,295,398.32	(560,189.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	3-sep-19	800,000.00	972,473.63	892,921.40	(79,552.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	3-sep-19	1,000,000.00	1,096,512.69	1,055,993.70	(40,518.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-may-19	3-sep-19	1,800,000.00	1,929,167.06	1,900,788.66	(28,378.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-mar-19	4-sep-19	12,700,000.00	13,028,978.13	13,411,889.92	382,911.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	8-mar-19	4-sep-19	650,000.00	653,282.20	652,351.16	(931.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-jun-19	4-sep-19	800,000.00	906,058.54	845,167.30	(60,891.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	4-sep-19	5,200,000.00	5,924,929.19	5,804,904.09	(120,025.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	4-sep-19	1,100,000.00	1,256,231.81	1,227,716.15	(28,515.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-mar-19	4-sep-19	24,400,000.00	26,633,778.97	27,246,529.60	612,750.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	8-mar-19	4-sep-19	1,300,000.00	1,346,518.81	1,372,870.62	26,351.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	6-sep-19	2,900,000.00	2,994,822.65	3,062,029.09	67,206.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	6-sep-19	3,300,000.00	3,425,139.44	3,484,721.72	59,582.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	6-sep-19	2,900,000.00	3,108,095.96	3,062,029.09	(46,066.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	6-sep-19	4,700,000.00	4,891,604.47	4,963,088.51	71,484.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	6-sep-19	4,700,000.00	4,891,604.47	4,963,088.51	71,484.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	6-sep-19	1,600,000.00	1,719,275.72	1,689,562.05	(29,713.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	11-jun-19	9-sep-19	1,120,000.00	1,173,272.34	1,140,734.73	(32,537.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-jun-19	9-sep-19	290,000.00	291,348.66	289,275.20	(2,073.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	10-jun-19	9-sep-19	90,000.00	97,865.15	89,265.27	(8,599.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	9-sep-19	400,000.00	404,528.88	399,085.22	(5,443.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	9-sep-19	340,000.00	347,698.01	339,222.44	(8,475.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	9-sep-19	600,000.00	622,390.30	633,450.28	11,059.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-jun-19	9-sep-19	5,900,000.00	6,802,846.14	6,578,629.25	(224,216.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	13-mar-19	9-sep-19	300,000.00	307,534.40	308,145.80	611.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-mar-19	9-sep-19	16,200,000.00	18,078,973.20	18,068,855.63	(10,117.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-mar-19	9-sep-19	16,200,000.00	18,078,973.20	18,068,855.63	(10,117.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	12-mar-19	9-sep-19	3,100,000.00	3,265,583.01	3,272,826.46	7,243.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-mar-19	9-sep-19	400,000.00	420,391.42	446,008.76	25,617.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-mar-19	9-sep-19	6,800,000.00	6,953,622.01	7,180,581.94	226,959.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-sep-18	9-sep-19	2,400,000.00	2,328,618.27	2,534,323.04	205,704.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-sep-18	9-sep-19	100,000.00	123,046.68	105,575.05	(17,471.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	12-jun-19	10-sep-19	138,800,000.00	142,035,641.95	142,075,823.32	40,181.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-jun-19	10-sep-19	900,000.00	967,995.99	950,138.93	(17,857.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-mar-19	10-sep-19	5,300,000.00	5,449,902.63	5,595,846.82	145,944.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-mar-19	10-sep-19	1,000,000.00	1,036,291.25	1,055,820.16	19,528.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-sep-18	10-sep-19	600,000.00	572,381.51	633,425.95	61,044.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-jun-19	11-sep-19	180,000.00	177,250.20	179,413.06	2,162.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-jun-19	11-sep-19	290,000.00	297,472.77	289,054.38	(8,418.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-18	11-sep-19	1,000,000.00	953,232.88	1,055,669.37	102,436.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-jun-19	11-sep-19	150,000.00	150,943.41	149,479.75	(1,463.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	11-sep-19	18,100,000.00	19,545,182.99	19,111,661.32	(433,521.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	11-sep-19	2,600,000.00	2,773,771.60	2,745,321.52	(28,450.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-jun-19	11-sep-19	240,000.00	243,164.92	239,167.60	(3,997.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	12-jun-19	12-sep-19	1,000,000.00	1,093,609.33	1,055,628.81	(37,980.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	12-sep-19	700,000.00	803,412.76	780,228.92	(23,183.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-sep-18	12-sep-19	500,000.00	477,502.92	527,927.68	50,424.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	12-sep-19	16,400,000.00	18,343,619.43	17,119,311.11	(1,224,308.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	12-sep-19	3,500,000.00	4,035,824.38	3,901,969.63	(133,854.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-jun-19	12-sep-19	2,800,000.00	3,188,068.43	3,120,915.70	(67,152.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	12-sep-19	240,000.00	249,548.55	239,159.21	(10,389.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-sep-18	13-sep-19	700,000.00	665,402.74	738,911.77	73,509.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18-mar-19	13-sep-19	300,000.00	331,846.44	322,451.51	(9,394.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-mar-19	13-sep-19	300,000.00	297,053.38	298,938.54	1,885.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	16-sep-19	14,300,000.00	15,413,916.38	15,096,585.06	(317,331.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-jun-19	16-sep-19	500,000.00	502,871.56	527,733.27	24,861.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-sep-18	16-sep-19	4,400,000.00	4,389,971.03	4,644,577.88	254,606.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-sep-18	16-sep-19	1,900,000.00	1,883,087.76	2,005,839.97	122,752.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	17-jun-19	16-sep-19	270,000.00	271,818.96	269,016.40	(2,802.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-mar-19	16-sep-19	1,200,000.00	1,210,568.93	1,266,703.06	56,134.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	16-sep-19	6,300,000.00	6,799,198.14	6,650,943.07	(148,255.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	19-mar-19	16-sep-19	1,300,000.00	1,407,030.07	1,448,679.47	41,649.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	16-sep-19	2,100,000.00	2,287,310.72	2,216,479.74	(70,830.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	16-sep-19	1,000,000.00	1,090,442.45	1,055,466.54	(34,975.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	20-mar-19	17-sep-19	9,400,000.00	10,378,981.60	10,104,359.57	(274,622.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	17-sep-19	1,000,000.00	1,061,923.70	1,055,425.97	(6,497.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	17-sep-19	900,000.00	975,966.65	949,883.37	(26,083.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	17-sep-19	520,000.00	525,724.25	518,087.49	(7,636.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	17-sep-19	12,400,000.00	13,259,234.21	13,090,279.66	(168,954.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-mar-19	17-sep-19	1,400,000.00	1,528,196.86	1,560,207.01	32,010.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-mar-19	17-sep-19	600,000.00	587,592.79	633,255.58	45,662.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	19-jun-19	17-sep-19	290,000.00	291,273.03	288,933.41	(2,339.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	19-sep-19	32,900,000.00	36,014,627.68	34,720,844.11	(1,293,783.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	19-sep-19	32,900,000.00	36,014,627.68	34,720,844.11	(1,293,783.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	22-may-19	19-sep-19	13,100,000.00	15,165,220.59	14,080,430.38	(1,084,790.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-mar-19	20-sep-19	7,200,000.00	7,529,100.79	7,598,190.38	69,089.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-mar-19	20-sep-19	4,300,000.00	4,397,853.25	4,538,886.92	141,033.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-mar-19	20-sep-19	7,000,000.00	7,267,909.59	7,388,885.68	120,976.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	25-mar-19	20-sep-19	6,800,000.00	7,100,896.57	7,176,068.69	75,172.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-mar-19	20-sep-19	4,100,000.00	4,305,116.05	4,326,747.30	21,631.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-sep-18	20-sep-19	1,900,000.00	1,906,941.10	2,005,078.02	98,136.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	25-mar-19	20-sep-19	14,000,000.00	15,616,229.85	15,047,159.21	(569,070.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-mar-19	23-sep-19	700,000.00	741,111.04	738,809.72	(2,301.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	23-sep-19	2,900,000.00	3,387,250.72	3,230,431.26	(156,819.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	24-jun-19	23-sep-19	15,200,000.00	16,553,012.35	16,112,407.26	(440,605.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	23-sep-19	1,300,000.00	1,516,838.98	1,448,124.36	(68,714.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-jun-19	23-sep-19	270,000.00	271,235.57	268,950.35	(2,285.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-mar-19	23-sep-19	7,000,000.00	7,264,407.82	7,388,097.22	123,689.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	23-sep-19	990,000.00	1,004,816.42	986,151.29	(18,665.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	29-mar-19	25-sep-19	500,000.00	511,673.13	513,391.75	1,718.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
DR0223	27-jun-19	25-sep-19	1,000,000.00	1,078,006.11	1,000,156.88	(77,849.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-mar-19	25-sep-19	700,000.00	789,562.53	779,673.84	(9,888.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-mar-19	25-sep-19	900,000.00	983,052.06	1,002,437.80	19,385.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-jun-19	26-sep-19	520,000.00	529,748.13	517,923.92	(11,824.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	28-jun-19	26-sep-19	13,900,000.00	15,363,820.01	14,331,160.90	(1,032,659.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0828	29-may-19	26-sep-19	22,400,000.00	24,955,161.36	23,371,623.29	(1,583,538.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-abr-19	27-sep-19	24,600,000.00	28,389,971.06	27,408,593.96	(981,377.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	2-abr-19	30-sep-19	360,000.00	362,447.87	358,434.19	(4,013.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-abr-19	30-sep-19	500,000.00	563,336.50	556,708.87	(6,627.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-abr-19	30-sep-19	1,500,000.00	1,612,371.00	1,670,346.19	57,975.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-abr-19	30-sep-19	10,500,000.00	12,446,538.31	11,697,036.66	(749,501.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-abr-19	30-sep-19	500,000.00	514,808.70	527,402.53	12,593.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-abr-19	30-sep-19	900,000.00	982,069.64	1,001,944.27	19,874.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-abr-19	30-sep-19	2,300,000.00	2,432,849.65	2,425,728.12	(7,121.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-abr-19	30-sep-19	2,300,000.00	2,429,926.68	2,425,728.12	(4,198.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-abr-19	30-sep-19	500,000.00	553,725.31	556,635.70	2,910.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-abr-19	1-oct-19	1,000,000.00	1,088,439.30	1,113,503.68	25,064.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-jun-19	1-oct-19	9,000,000.00	9,777,441.19	9,491,591.59	(285,849.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	1-oct-19	21,800,000.00	23,027,136.17	22,996,944.04	(30,192.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-abr-19	1-oct-19	1,400,000.00	1,468,327.29	1,476,867.97	8,540.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-abr-19	2-oct-19	2,400,000.00	2,462,845.09	2,531,677.53	68,832.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-oct-18	3-oct-19	400,000.00	399,538.39	421,930.23	22,391.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
NO0325	5-jun-19	3-oct-19	34,570,000.00	38,049,880.15	34,108,435.29	(3,941,444.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-abr-19	4-oct-19	4,600,000.00	4,836,110.98	4,852,013.40	15,902.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	3-may-19	4-oct-19	400,000.00	410,841.79	415,064.88	4,223.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	8-abr-19	4-oct-19	540,000.00	544,293.04	537,570.73	(6,722.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-abr-19	4-oct-19	900,000.00	972,632.52	949,042.74	(23,589.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-abr-19	7-oct-19	250,000.00	247,299.96	248,917.67	1,617.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-abr-19	7-oct-19	8,900,000.00	10,222,411.22	9,556,616.06	(665,795.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-abr-19	7-oct-19	8,100,000.00	8,757,499.44	8,540,336.66	(217,162.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-abr-19	7-oct-19	500,000.00	588,153.90	556,570.48	(31,583.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-abr-19	7-oct-19	700,000.00	806,487.34	778,978.15	(27,509.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-oct-18	7-oct-19	1,300,000.00	1,278,895.51	1,370,671.32	91,775.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	7-oct-19	2,300,000.00	2,416,580.87	2,425,730.27	9,149.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-abr-19	7-oct-19	24,500,000.00	25,922,025.82	25,839,300.71	(82,725.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-abr-19	7-oct-19	510,000.00	501,628.32	507,792.04	6,163.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-abr-19	7-oct-19	700,000.00	779,607.74	778,978.15	(629.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-abr-19	8-oct-19	490,000.00	493,100.51	487,722.54	(5,377.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-abr-19	8-oct-19	1,200,000.00	1,259,531.92	1,265,183.30	5,651.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
MH0134	11-abr-19	8-oct-19	27,000,000.00	30,689,057.03	28,990,699.77	(1,698,357.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-abr-19	8-oct-19	340,000.00	345,343.17	338,419.72	(6,923.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-ene-19	8-oct-19	490,000.00	523,459.43	485,034.99	(38,424.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-ene-19	8-oct-19	490,000.00	523,459.43	485,034.99	(38,424.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-abr-19	8-oct-19	4,900,000.00	5,351,595.67	5,166,165.13	(185,430.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-abr-19	9-oct-19	2,200,000.00	2,385,487.72	2,319,407.81	(66,079.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	12-abr-19	9-oct-19	27,300,000.00	31,527,446.63	29,311,522.88	(2,215,923.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-18	10-oct-19	1,000,000.00	952,811.65	1,054,233.13	101,421.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-oct-18	10-oct-19	9,600,000.00	9,572,241.20	10,122,135.44	549,894.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	14-dic-18	10-oct-19	80,000.00	80,023.83	79,124.63	(899.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-may-19	11-oct-19	310,000.00	313,106.56	308,524.45	(4,582.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-oct-18	11-oct-19	500,000.00	509,483.42	527,252.53	17,769.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-jun-19	11-oct-19	3,900,000.00	4,232,966.99	4,112,569.72	(120,397.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-oct-18	11-oct-19	900,000.00	909,428.76	948,770.99	39,342.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-abr-19	14-oct-19	500,000.00	500,564.53	527,030.26	26,465.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	14-oct-19	500,000.00	491,628.06	527,030.26	35,402.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	14-oct-19	2,100,000.00	2,232,835.66	2,213,527.11	(19,308.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	16-abr-19	14-oct-19	800,000.00	877,105.92	890,174.15	13,068.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-abr-19	14-oct-19	700,000.00	808,243.51	778,666.20	(29,577.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-abr-19	14-oct-19	410,000.00	405,725.74	408,002.56	2,276.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	14-oct-19	900,000.00	969,937.33	948,654.47	(21,282.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	17-ene-19	14-oct-19	400,000.00	459,007.55	429,325.63	(29,681.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-abr-19	14-oct-19	330,000.00	331,391.88	328,392.30	(2,999.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	14-oct-19	4,300,000.00	4,612,261.24	4,532,460.27	(79,800.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-abr-19	14-oct-19	2,300,000.00	2,490,058.59	2,424,339.21	(65,719.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	15-oct-19	13,500,000.00	14,585,948.63	14,229,234.46	(356,714.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	17-abr-19	15-oct-19	142,700,000.00	149,362,549.87	141,625,110.54	(7,737,439.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	15-oct-19	400,000.00	414,814.49	421,606.95	6,792.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	17-abr-19	15-oct-19	221,100,000.00	258,870,732.84	237,328,158.44	(21,542,574.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	15-oct-19	1,400,000.00	1,486,167.61	1,476,082.64	(10,084.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-oct-18	16-oct-19	1,000,000.00	951,243.15	1,053,974.20	102,731.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-abr-19	18-oct-19	1,000,000.00	1,162,425.87	1,112,125.54	(50,300.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-abr-19	18-oct-19	3,600,000.00	3,884,622.43	3,793,996.32	(90,626.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-oct-18	18-oct-19	200,000.00	261,299.75	210,945.96	(50,353.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	22-abr-19	18-oct-19	1,500,000.00	1,616,663.97	1,581,336.73	(35,327.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	21-mar-19	18-oct-19	21,200,000.00	22,742,430.81	22,753,005.50	10,574.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-abr-19	21-oct-19	900,000.00	965,675.28	948,382.50	(17,292.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-abr-19	21-oct-19	3,300,000.00	3,511,054.62	3,477,402.50	(33,652.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	21-oct-19	1,000,000.00	1,069,646.19	1,053,758.33	(15,887.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	21-oct-19	3,300,000.00	3,574,500.39	3,477,402.50	(97,097.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-abr-19	21-oct-19	2,300,000.00	2,407,558.09	2,424,439.67	16,881.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-oct-18	21-oct-19	400,000.00	431,317.81	421,503.33	(9,814.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-abr-19	22-oct-19	4,500,000.00	4,833,203.73	4,741,718.16	(91,485.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-abr-19	22-oct-19	2,700,000.00	3,210,740.10	3,004,502.93	(206,237.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-abr-19	23-oct-19	2,100,000.00	2,446,560.57	2,334,794.77	(111,765.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-abr-19	25-oct-19	4,300,000.00	4,824,194.72	4,780,222.29	(43,972.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-may-19	28-oct-19	4,200,000.00	4,515,117.12	4,424,515.05	(90,602.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-abr-19	28-oct-19	1,800,000.00	1,933,864.64	1,896,220.73	(37,643.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-abr-19	28-oct-19	2,000,000.00	2,185,763.37	2,106,911.93	(78,851.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-abr-19	28-oct-19	1,200,000.00	1,366,544.63	1,333,786.12	(32,758.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-abr-19	28-oct-19	6,300,000.00	6,757,167.49	6,639,087.95	(118,079.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	30-abr-19	28-oct-19	700,000.00	731,853.47	737,419.18	5,565.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-may-19	28-oct-19	3,600,000.00	3,853,011.87	3,792,441.47	(60,570.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	1-may-19	28-oct-19	190,000.00	196,180.81	188,974.99	(7,205.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-may-19	29-oct-19	5,300,000.00	5,537,083.47	5,585,051.87	47,968.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-may-19	29-oct-19	1,900,000.00	2,052,850.23	2,002,188.41	(50,661.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	2-may-19	29-oct-19	6,800,000.00	7,462,658.76	6,974,768.78	(487,889.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-may-19	30-oct-19	13,900,000.00	15,804,305.53	14,910,327.09	(893,978.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-may-19	30-oct-19	700,000.00	789,177.58	750,879.78	(38,297.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-may-19	30-oct-19	4,600,000.00	4,795,567.48	4,847,218.98	51,651.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-may-19	1-nov-19	480,000.00	489,201.64	477,338.72	(11,862.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-nov-18	1-nov-19	500,000.00	493,990.27	526,641.55	32,651.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-jun-19	1-nov-19	160,000.00	157,496.77	159,169.36	1,672.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-may-19	1-nov-19	1,700,000.00	2,050,618.50	1,890,777.76	(159,840.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-may-19	5-nov-19	2,700,000.00	2,887,157.79	2,843,397.50	(43,760.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-nov-19	4,800,000.00	5,090,222.83	5,056,812.14	(33,410.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-may-19	5-nov-19	1,600,000.00	1,751,014.52	1,685,604.05	(65,410.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-may-19	6-nov-19	15,300,000.00	16,296,367.52	16,117,974.72	(178,392.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	10-may-19	6-nov-19	1,300,000.00	1,374,118.87	1,368,987.03	(5,131.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	10-may-19	6-nov-19	190,000.00	196,264.58	187,643.66	(8,620.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-may-19	6-nov-19	190,000.00	195,640.08	188,911.05	(6,729.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	8-nov-19	520,000.00	520,162.12	517,174.79	(2,987.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	8-nov-19	610,000.00	614,663.93	606,685.81	(7,978.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	13-may-19	8-nov-19	150,000.00	156,042.10	148,123.50	(7,918.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-may-19	8-nov-19	390,000.00	389,322.91	387,881.09	(1,441.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	8-nov-19	10,500,000.00	11,226,016.56	11,056,294.85	(169,721.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	8-nov-19	900,000.00	960,145.30	947,682.42	(12,462.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-may-19	8-nov-19	460,000.00	463,059.08	457,500.78	(5,558.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-may-19	8-nov-19	2,900,000.00	3,115,258.41	3,053,643.34	(61,615.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-may-19	11-nov-19	1,000,000.00	1,135,904.88	1,111,023.50	(24,881.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	11-nov-19	2,400,000.00	2,604,830.75	2,526,841.69	(77,989.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	11-nov-19	1,900,000.00	2,097,769.76	2,000,416.34	(97,353.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-may-19	11-nov-19	3,600,000.00	3,850,100.98	3,790,262.54	(59,838.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-may-19	11-nov-19	600,000.00	703,028.56	666,357.52	(36,671.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-may-19	11-nov-19	390,000.00	391,087.16	387,691.82	(3,395.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	16-may-19	12-nov-19	2,100,000.00	2,172,212.79	2,211,765.32	39,552.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-may-19	12-nov-19	4,500,000.00	4,801,426.13	4,737,633.51	(63,792.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-may-19	12-nov-19	240,000.00	244,309.11	238,570.60	(5,738.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-may-19	12-nov-19	1,300,000.00	1,454,142.51	1,443,691.70	(10,450.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-may-19	13-nov-19	2,000,000.00	2,087,133.11	2,106,362.88	19,229.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-may-19	13-nov-19	1,700,000.00	1,940,566.37	1,887,796.10	(52,770.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-nov-18	15-nov-19	400,000.00	442,441.37	421,155.74	(21,285.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	15-nov-19	9,600,000.00	10,389,375.62	10,105,705.42	(283,670.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-may-19	18-nov-19	510,000.00	516,336.24	506,847.96	(9,488.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	22-may-19	18-nov-19	5,600,000.00	6,543,726.59	6,001,988.03	(541,738.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-may-19	18-nov-19	1,300,000.00	1,487,122.65	1,443,194.10	(43,928.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-may-19	18-nov-19	900,000.00	960,397.16	947,293.04	(13,104.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	23-may-19	19-nov-19	100,000.00	102,081.64	98,689.46	(3,392.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-may-19	20-nov-19	2,200,000.00	2,405,388.71	2,315,414.74	(89,973.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	24-may-19	20-nov-19	23,800,000.00	26,738,309.53	24,778,635.12	(1,959,674.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-may-19	20-nov-19	240,000.00	244,033.95	238,498.71	(5,535.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-may-19	20-nov-19	500,000.00	560,324.73	555,582.29	(4,742.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	26-nov-18	21-nov-19	900,000.00	958,991.46	947,176.16	(11,815.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-may-19	25-nov-19	4,500,000.00	4,780,701.62	4,737,147.93	(43,553.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-may-19	25-nov-19	270,000.00	275,638.94	268,260.47	(7,378.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-may-19	25-nov-19	2,700,000.00	2,875,575.69	2,841,060.84	(34,514.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-nov-18	25-nov-19	5,300,000.00	5,133,661.14	5,579,307.57	445,646.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-may-19	25-nov-19	2,500,000.00	2,662,378.67	2,630,611.89	(31,766.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-may-19	26-nov-19	900,000.00	981,744.67	946,981.30	(34,763.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-may-19	26-nov-19	4,800,000.00	5,214,784.69	5,050,566.94	(164,217.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-may-19	26-nov-19	29,100,000.00	31,629,416.54	30,619,062.11	(1,010,354.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	27-nov-19	18,600,000.00	20,321,713.17	19,570,141.31	(751,571.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	27-nov-19	600,000.00	684,512.11	665,744.94	(18,767.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-may-19	27-nov-19	2,000,000.00	2,120,609.56	2,105,238.39	(15,371.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31-may-19	27-nov-19	900,000.00	1,038,501.93	998,617.41	(39,884.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	5-dic-18	29-nov-19	80,000.00	81,550.16	79,489.95	(2,060.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-jun-19	29-nov-19	1,600,000.00	1,888,961.90	1,714,018.35	(174,943.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	2-dic-19	400,000.00	484,326.27	443,702.26	(40,624.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	2-dic-19	400,000.00	483,807.36	443,702.26	(40,105.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	5-jun-19	2-dic-19	600,000.00	691,326.53	665,553.39	(25,773.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-jun-19	2-dic-19	800,000.00	834,467.12	841,934.63	7,467.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-dic-18	3-dic-19	1,400,000.00	1,374,092.59	1,473,329.35	99,236.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-jun-19	4-dic-19	500,000.00	562,162.26	554,563.97	(7,598.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	4-dic-19	1,300,000.00	1,432,725.30	1,367,411.31	(65,313.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	4-dic-19	480,000.00	484,145.92	476,745.57	(7,400.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-jun-19	4-dic-19	15,400,000.00	16,381,166.27	16,206,003.93	(175,162.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-dic-18	4-dic-19	9,400,000.00	9,477,252.05	9,889,705.51	412,453.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	9-dic-19	100,000.00	97,381.16	99,303.24	1,922.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-18	9-dic-19	700,000.00	655,317.49	736,321.23	81,003.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	9-dic-19	700,000.00	804,234.40	776,165.99	(28,068.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11-jun-19	9-dic-19	700,000.00	791,991.06	776,165.99	(15,825.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	9-dic-19	7,500,000.00	8,113,466.96	7,887,285.85	(226,181.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-feb-19	10-dic-19	4,700,000.00	4,902,797.94	4,942,495.35	39,697.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-feb-19	10-dic-19	4,800,000.00	5,037,680.01	5,047,654.82	9,974.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-mar-19	10-dic-19	600,000.00	687,946.20	665,246.81	(22,699.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13-jun-19	10-dic-19	1,100,000.00	1,282,316.37	1,219,619.14	(62,697.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BC0224	13-jun-19	10-dic-19	400,000.00	444,104.27	403,860.48	(40,243.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-mar-19	10-dic-19	500,000.00	553,395.38	554,372.34	976.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-jun-19	11-dic-19	490,000.00	497,528.85	486,549.10	(10,979.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-dic-18	12-dic-19	14,100,000.00	14,215,557.53	14,829,845.88	614,288.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-dic-18	13-dic-19	900,000.00	908,083.52	946,778.51	38,694.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	13-dic-19	25,100,000.00	25,607,172.85	26,391,762.96	784,590.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	13-dic-19	1,000,000.00	1,043,131.24	1,051,464.66	8,333.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-dic-18	13-dic-19	4,900,000.00	4,690,982.61	5,154,682.99	463,700.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-jun-19	13-dic-19	1,600,000.00	1,744,254.34	1,682,343.46	(61,910.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-dic-18	16-dic-19	100,000.00	96,096.90	99,301.16	3,204.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	16-dic-19	1,000,000.00	1,105,379.49	1,051,334.53	(54,044.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19-jun-19	16-dic-19	500,000.00	566,585.37	534,075.66	(32,509.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	18-jun-19	16-dic-19	22,700,000.00	25,840,875.14	23,611,542.76	(2,229,332.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	17-dic-19	1,900,000.00	2,193,374.47	2,106,801.10	(86,573.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	27-jun-19	18-dic-19	490,000.00	500,868.70	486,420.36	(14,448.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	18-dic-19	700,000.00	770,423.97	775,763.42	5,339.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-jun-19	18-dic-19	900,000.00	1,034,321.65	997,903.86	(36,417.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	26-jun-19	18-dic-19	1,500,000.00	1,646,103.22	1,662,350.19	16,246.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-may-19	18-dic-19	490,000.00	492,983.04	486,420.36	(6,562.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-dic-18	20-dic-19	120,000.00	120,076.16	119,114.34	(961.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	24-jun-19	20-dic-19	600,000.00	652,324.20	632,601.23	(19,722.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0123	1-may-19	20-dic-19	1,240,000.00	1,316,625.32	1,224,323.93	(92,301.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-dic-18	27-dic-19	5,600,000.00	5,427,351.83	5,878,073.58	450,721.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-ene-19	2-ene-20	200,000.00	191,193.79	198,142.56	6,948.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-jun-19	3-ene-20	2,900,000.00	3,367,729.40	3,205,407.81	(162,321.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-ene-19	7-ene-20	1,200,000.00	1,132,930.18	1,258,928.55	125,998.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-abr-19	8-ene-20	180,000.00	177,788.62	178,230.06	441.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-ene-19	8-ene-20	3,700,000.00	3,569,169.55	3,881,511.70	312,342.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-ene-19	10-ene-20	3,000,000.00	3,012,683.49	3,145,073.73	132,390.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	13-ene-20	700,000.00	735,667.73	734,165.35	(1,502.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-ene-19	13-ene-20	200,000.00	201,531.17	209,639.72	8,108.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-ene-19	13-ene-20	1,100,000.00	1,068,955.59	1,153,353.33	84,397.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-abr-19	15-ene-20	38,000,000.00	39,864,219.58	39,752,274.71	(111,944.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	22-ene-19	22-ene-20	1,100,000.00	1,298,798.88	1,170,132.77	(128,666.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	23-ene-19	23-ene-20	500,000.00	476,579.99	522,804.91	46,224.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-ene-19	24-ene-20	700,000.00	685,145.09	731,455.36	46,310.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	24-ene-20	49,400,000.00	48,733,003.18	51,634,930.71	2,901,927.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	24-ene-20	50,800,000.00	50,202,234.37	53,098,268.84	2,896,034.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-ene-19	29-ene-20	2,300,000.00	2,304,987.02	2,402,595.55	97,608.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	13-feb-20	7,400,000.00	7,474,112.48	7,725,257.29	251,144.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-feb-19	13-feb-20	1,400,000.00	1,466,107.92	1,461,535.16	(4,572.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-feb-19	26-feb-20	1,000,000.00	1,078,023.38	1,042,760.27	(35,263.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-mar-19	4-mar-20	900,000.00	978,754.12	938,068.43	(40,685.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-mar-19	12-mar-20	270,000.00	271,586.13	265,826.18	(5,759.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	21-mar-19	20-mar-20	500,000.00	532,838.50	508,129.40	(24,709.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-abr-19	27-mar-20	1,600,000.00	1,605,894.61	1,665,890.17	59,995.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-abr-19	30-mar-20	700,000.00	782,738.88	766,515.38	(16,223.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-abr-19	30-mar-20	2,400,000.00	2,454,673.46	2,499,348.03	44,674.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	10-abr-19	3-abr-20	500,000.00	565,293.71	507,798.39	(57,495.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	10-abr-20	9,000,000.00	9,275,111.91	9,366,319.74	91,207.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,563,404.92	392,931.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,563,404.92	392,931.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-abr-19	13-abr-20	53,400,000.00	55,170,473.26	55,563,404.92	392,931.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	23-abr-19	22-abr-20	1,100,000.00	1,212,071.03	1,124,872.96	(87,198.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	9-may-19	4-may-20	150,000.00	154,085.57	145,687.81	(8,397.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-may-19	11-may-20	53,200,000.00	54,928,681.41	55,261,416.05	332,734.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-may-19	14-may-20	4,600,000.00	5,207,039.38	4,725,970.79	(481,068.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	14-may-20	24,300,000.00	25,139,731.51	25,236,989.72	97,258.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	14-may-20	2,700,000.00	2,868,610.79	2,801,528.60	(67,082.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-may-19	15-may-20	480,000.00	485,309.09	470,615.61	(14,693.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	24-may-19	18-may-20	5,200,000.00	6,311,635.91	5,488,205.99	(823,429.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-may-19	19-may-20	11,000,000.00	11,870,280.23	11,409,991.29	(460,288.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-may-19	22-may-20	800,000.00	883,290.40	872,274.44	(11,015.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-may-19	22-may-20	2,000,000.00	2,128,509.73	2,074,146.29	(54,363.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	31-may-19	25-may-20	90,000.00	96,778.40	87,269.52	(9,508.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	31-may-19	25-may-20	480,000.00	487,591.04	470,334.59	(17,256.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	28-may-20	1,000,000.00	1,110,801.27	1,089,812.77	(20,988.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-jun-19	28-may-20	1,000,000.00	1,110,801.27	1,089,812.77	(20,988.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 o centralización de negociación
MH0332	6-jun-19	1-jun-20	1,100,000.00	1,223,374.79	1,199,561.94	(23,812.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-jun-19	3-jun-20	140,000.00	143,512.53	135,787.69	(7,724.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-jun-19	5-jun-20	1,600,000.00	1,774,411.50	1,742,568.88	(31,842.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-jun-19	15-jun-20	7,500,000.00	7,819,496.48	7,774,052.20	(45,444.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	15-jun-20	580,000.00	571,891.90	568,178.16	(3,713.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-jun-19	15-jun-20	480,000.00	479,293.03	469,743.98	(9,549.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	28-jun-19	22-jun-20	5,400,000.00	6,135,627.72	5,477,837.24	(657,790.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			9,681,150,000.00	10,443,873,624.74	10,164,203,492.78	- 279,670,131.96		

Nota: Tasa al cierre de mes 50.8187

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 o centralización de negociación
BO0327	1-may-19	2-jul-19	16,000.00	17,844.48	17,539.95	(304.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	31-may-19	2-jul-19	76,000.00	83,759.26	83,314.77	(444.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4427	31-may-19	2-jul-19	476,927.00	507,891.52	500,490.06	(7,401.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	3-abr-19	2-jul-19	9,000.00	9,489.81	9,866.22	376.42	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

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
BO0327	4-ene-19	3-jul-19	10,000.00	10,727.63	10,958.93	231.30	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	26-jun-19	3-jul-19	485,000.00	525,923.06	523,671.60	(2,251.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	3-jun-19	3-jul-19	8,000.00	8,679.29	8,767.14	87.85	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-jul-18	4-jul-19	19,000.00	22,547.30	20,820.62	(1,726.68)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4327	4-jun-19	4-jul-19	201,352.00	214,418.73	211,208.46	(3,210.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4427	4-jun-19	4-jul-19	240,970.00	256,607.36	252,765.81	(3,841.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP1027	4-jun-19	4-jul-19	135,227.00	145,704.37	143,658.46	(2,045.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-jun-19	5-jul-19	91,000.00	99,538.47	99,713.36	174.88	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	6-jun-19	8-jul-19	46,000.00	50,665.73	50,394.78	(270.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	7-jun-19	8-jul-19	24,000.00	26,306.71	26,292.93	(13.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	9-abr-19	8-jul-19	6,000.00	7,054.65	6,573.23	(481.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	3-may-19	9-jul-19	9,000.00	9,863.15	9,859.21	(3.94)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	9-ene-19	9-jul-19	92,000.00	103,109.32	100,783.04	(2,326.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	10-jun-19	9-jul-19	5,000.00	6,016.98	5,477.34	(539.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	18-jun-19	9-jul-19	4,000.00	3,924.63	4,381.87	457.24	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	10-jun-19	10-jul-19	6,000.00	6,503.61	6,572.38	68.77	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP5127	12-jun-19	10-jul-19	800,458.00	848,220.00	834,842.79	(13,377.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4727	12-jun-19	12-jul-19	410,048.00	436,580.48	429,871.86	(6,708.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

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
BO0327	12-jun-19	15-jul-19	9,000.00	9,508.00	9,855.39	347.38	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	15-abr-19	15-jul-19	11,000.00	12,574.28	12,045.47	(528.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4127	18-jun-19	16-jul-19	653,004.00	695,277.77	684,375.70	(10,902.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4727	18-jun-19	16-jul-19	1,772,440.00	1,887,182.51	1,857,591.78	(29,590.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4427	29-may-19	16-jul-19	121,603.00	129,416.08	127,445.07	(1,971.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4627	29-may-19	16-jul-19	233,852.00	248,877.07	245,086.75	(3,790.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	14-jun-19	16-jul-19	18,000.00	19,662.59	19,709.50	46.90	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	18-ene-19	17-jul-19	6,000.00	6,470.42	6,569.41	98.99	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	19-jun-19	19-jul-19	9,000.00	10,007.77	9,852.84	(154.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	22-abr-19	22-jul-19	5,000.00	5,039.01	5,472.73	433.72	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	4-mar-19	22-jul-19	4,000.00	4,513.76	4,515.58	1.82	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	22-ene-19	22-jul-19	287,000.00	315,369.68	314,134.98	(1,234.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	25-mar-19	23-jul-19	6,000.00	6,259.25	6,566.86	307.61	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4327	25-abr-19	24-jul-19	473,802.00	510,206.60	496,277.25	(13,929.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	4-mar-19	24-jul-19	4,000.00	4,499.07	4,312.85	(186.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	27-mar-19	25-jul-19	18,000.00	19,967.19	19,698.02	(269.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	28-jun-19	30-jul-19	3,000.00	3,136.49	3,283.11	146.62	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4127	31-may-19	30-jul-19	420,818.00	447,470.06	440,743.87	(6,726.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

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
BO0327	1-feb-19	31-jul-19	4,000.00	3,952.84	4,377.24	424.41	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	10-jun-19	2-ago-19	50,000.00	55,106.10	54,709.69	(396.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-jun-19	2-ago-19	152,000.00	166,552.82	166,317.47	(235.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4627	4-jun-19	2-ago-19	123,999.00	131,851.08	129,846.50	(2,004.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4127	4-jun-19	2-ago-19	28,311.00	30,104.02	29,646.08	(457.94)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP0927	4-jun-19	2-ago-19	199,999.00	215,150.50	212,079.61	(3,070.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	11-feb-19	9-ago-19	9,000.00	10,207.29	9,844.05	(363.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	3-may-19	14-ago-19	203,000.00	219,943.05	221,978.46	2,035.41	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	22-may-19	20-ago-19	5,000.00	4,911.12	5,465.69	554.57	USD	Alpha Sociedad de Valores
CR0820	5-jun-19	26-ago-19	573,000.00	580,800.98	604,373.77	23,572.79	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	3-abr-19	30-ago-19	9,000.00	10,093.17	9,837.00	(256.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	5-mar-19	2-sep-19	9,000.00	10,036.04	9,835.61	(200.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	28-jun-19	4-sep-19	4,000.00	4,486.78	4,370.97	(115.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-mar-19	9-sep-19	194,000.00	217,095.08	211,898.71	(5,196.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	13-jun-19	11-sep-19	40,000.00	45,067.05	43,686.09	(1,380.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	6-may-19	20-sep-19	282,000.00	197,379.06	196,933.04	(446.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	29-mar-19	25-sep-19	9,000.00	10,139.07	9,822.49	(316.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	5-jun-19	3-oct-19	18,000.00	20,483.55	19,620.33	(863.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

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
BO0327	15-abr-19	11-oct-19	58,000.00	65,660.83	63,191.28	(2,469.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	24-may-19	20-nov-19	5,000.00	5,021.37	5,434.68	413.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	6-jun-19	3-dic-19	11,000.00	12,038.02	11,947.12	(90.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	24-jun-19	20-dic-19	12,000.00	13,275.00	13,020.12	(254.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	14-ene-19	9-ene-20	356,000.00	407,223.94	386,373.37	(20,850.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
			9,581,810.00	10,173,392.88	10,049,971.32	- 123,421.56		

Tasa de cambio
DOP/USD

50.8187

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 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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	28-ene-19	22-jul-19	700,000.00	743,963.12	744,628.58	665.46	DOP	N/A
MH0134	5-mar-19	5-ago-19	60,900,000.00	64,727,079.99	65,196,161.23	469,081.24	DOP	N/A
CE1019	3-may-19	9-ago-19	510,000.00	530,548.31	531,544.13	995.82	DOP	N/A
MH0332	3-may-19	9-sep-19	400,000.00	420,909.86	423,253.20	2,343.34	DOP	N/A
BO0126	14-may-19	12-jul-19	5,900,000.00	6,594,662.21	6,589,958.90	(4,703.31)	DOP	N/A
BO0126	16-may-19	15-oct-19	1,400,000.00	1,525,065.94	1,541,068.66	16,002.72	DOP	N/A
CE1019	17-may-19	10-jul-19	330,000.00	337,832.68	338,079.97	247.29	DOP	N/A
BO0126	19-jun-19	17-jul-19	15,700,000.00	17,048,391.32	17,046,597.77	(1,793.55)	DOP	N/A
MH0332	24-jun-19	30-sep-19	500,000.00	567,434.83	571,993.31	4,558.48	DOP	N/A
MH0332	28-jun-19	26-jul-19	800,000.00	967,378.63	964,701.39	(2,677.24)	DOP	N/A
Total			87,140,000.00	93,463,266.89	93,947,987.14	484,720.25		

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	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 venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1019	5-jun-19	2-jul-19	490,000.00	492,643.84	496,039.74	(3,395.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	31-may-19	2-jul-19	17,400,000.00	19,000,382.40	18,612,153.60	388,228.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

BO0222	23-abr-19	3-jul-19	30,100,000.00	35,968,069.54	35,489,113.73	478,955.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	8-mar-19	3-jul-19	24,400,000.00	24,672,352.80	25,099,606.56	(427,253.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	7-mar-19	3-jul-19	48,700,000.00	49,243,345.90	50,096,345.88	(852,999.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29-may-19	3-jul-19	900,000.00	1,028,297.68	1,007,032.51	21,265.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-may-19	3-jul-19	1,200,000.00	1,260,682.79	1,270,184.96	(9,502.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	25-jun-19	4-jul-19	8,200,000.00	8,227,198.11	8,394,619.05	(167,420.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0325	18-jun-19	5-jul-19	140,000,000.00	146,345,456.99	138,709,749.92	7,635,707.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-mar-19	9-jul-19	2,000,000.00	2,052,165.95	2,116,462.47	(64,296.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-jun-19	9-jul-19	45,800,000.00	49,140,404.05	48,466,990.46	673,413.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0922	19-jun-19	9-jul-19	69,440,000.00	72,938,657.22	70,883,052.06	2,055,605.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	17-may-19	10-jul-19	330,000.00	327,326.93	333,497.11	(6,170.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-jun-19	10-jul-19	300,000.00	298,667.38	317,456.56	(18,789.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	18-jun-19	11-jul-19	35,900,000.00	39,077,184.82	38,310,804.12	766,380.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-jun-19	11-jul-19	140,000.00	139,139.05	141,463.45	(2,324.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-jun-19	11-jul-19	8,600,000.00	9,311,871.64	9,100,054.06	211,817.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-may-19	12-jul-19	5,900,000.00	6,280,002.28	6,242,808.37	37,193.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0121	12-jun-19	12-jul-19	39,970,000.00	40,188,827.59	39,717,143.79	471,683.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-mar-19	15-jul-19	9,400,000.00	9,856,767.96	9,942,979.54	(86,211.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28-jun-19	15-jul-19	5,000,000.00	5,418,665.00	5,309,538.86	109,126.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	14-jun-19	16-jul-19	41,900,000.00	45,148,213.70	44,673,263.43	474,950.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	14-jun-19	16-jul-19	45,600,000.00	46,222,941.60	46,878,334.58	(655,392.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

BO0126	18-feb-19	17-jul-19	1,900,000.00	1,983,125.35	2,009,541.69	(26,416.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	6-mar-19	17-jul-19	250,000.00	255,834.78	252,397.22	3,437.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-jun-19	17-jul-19	15,700,000.00	17,034,358.10	16,605,160.26	429,197.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	17-jul-19	1,100,000.00	1,311,192.27	1,229,859.68	81,332.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0125	21-jun-19	18-jul-19	87,720,000.00	91,017,736.03	86,928,956.55	4,088,779.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-jun-19	19-jul-19	100,000.00	101,421.02	99,836.74	1,584.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0125	21-jun-19	19-jul-19	87,720,000.00	91,015,299.17	86,923,663.42	4,091,635.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-ene-19	22-jul-19	700,000.00	742,294.63	740,164.51	2,130.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	7-jun-19	22-jul-19	480,000.00	489,613.52	479,163.30	10,450.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	26-abr-19	22-jul-19	400,000.00	401,135.36	403,547.44	(2,412.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-jun-19	26-jul-19	800,000.00	929,767.67	893,995.59	35,772.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	5-mar-19	5-ago-19	60,900,000.00	64,248,698.84	65,543,842.47	(1,295,143.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-may-19	9-ago-19	180,000.00	181,852.22	181,177.40	674.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-may-19	9-ago-19	510,000.00	508,443.65	513,335.98	(4,892.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	6-mar-19	12-ago-19	500,000.00	551,450.52	519,134.31	32,316.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	6-mar-19	12-ago-19	3,000,000.00	3,247,005.11	3,132,713.32	114,291.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-may-19	20-ago-19	2,100,000.00	2,435,792.07	2,344,256.48	91,535.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-mar-19	22-ago-19	600,000.00	576,078.14	633,612.87	(57,534.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	14-mar-19	3-sep-19	54,200,000.00	61,965,263.08	58,295,398.32	3,669,864.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	9-sep-19	400,000.00	420,385.27	446,144.58	(25,759.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-jun-19	30-sep-19	500,000.00	563,336.47	557,001.75	6,334.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

BC0224	10-jun-19	3-oct-19	11,170,000.00	11,835,602.09	11,316,517.46	519,084.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-may-19	8-oct-19	490,000.00	493,100.57	488,070.68	5,029.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-may-19	8-oct-19	340,000.00	345,343.14	338,661.29	6,681.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-may-19	15-oct-19	1,400,000.00	1,486,273.47	1,476,770.64	9,502.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-jun-19	1-nov-19	1,700,000.00	2,050,618.48	1,890,777.76	159,840.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-may-19	30-mar-20	700,000.00	782,737.73	767,995.56	14,742.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	27-may-19	18-may-20	5,200,000.00	6,311,582.25	5,488,205.99	823,376.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			922,430,000.00	975,924,606.23	952,108,598.04	23,816,008.19		

Nota: Tasa al cierre de mes

Contratos de venta forward
USD:

50.8187

b) Títulos Valores de Deuda

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
CR0923	26-jun-19	3-jul-19	536,530.00	535,809.85	536,244.87	(435.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP3527	13-jun-19	11-jul-19	394,522.00	431,167.70	419,873.74	11,293.96	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP3227	13-jun-19	11-jul-19	210,000.00	229,505.81	223,494.47	6,011.34	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0127	13-jun-19	11-jul-19	481,000.00	508,973.80	519,073.49	(10,099.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4127	13-jun-19	11-jul-19	598,328.00	644,454.00	627,299.63	17,154.37	USD	Alpha Sociedad de Valores
DP4727	13-jun-19	11-jul-19	1,797,150.00	1,935,694.84	1,884,169.76	51,525.08	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	5-mar-19	5-ago-19	864,000.00	878,010.00	890,629.92	(12,619.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	5-jun-19	26-ago-19	574,000.00	590,599.50	590,522.47	77.03	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

BR0223	25-feb-19	26-ago-19	767,000.00	772,113.08	789,077.93	(16,964.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CR0820	25-feb-19	26-ago-19	573,000.00	580,800.98	604,373.77	(23,572.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			6,795,530.00	7,107,129.57	7,084,760.06	22,369.51		

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
BO0126	2-Jul-18	2-Jul-19	500,000.00	588,274.76	592,487.52	4,212.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Jul-18	1-Jul-19	4,500,000.00	4,755,615.93	4,785,107.17	29,491.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Aug-18	2-Aug-19	1,200,000.00	1,182,972.51	1,194,112.74	11,140.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Sep-18	2-Sep-19	4,500,000.00	4,498,867.73	4,559,503.92	60,636.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Sep-18	9-Sep-19	2,400,000.00	2,369,377.17	2,399,006.26	29,629.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Sep-18	12-Sep-19	500,000.00	486,441.28	479,780.82	6,660.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Sep-18	16-Sep-19	1,900,000.00	1,919,317.90	1,945,282.99	25,965.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Oct-18	3-Oct-19	400,000.00	409,191.81	416,409.94	7,218.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Oct-18	11-Oct-19	500,000.00	522,741.98	532,494.50	9,752.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	25-Nov-19	5,300,000.00	5,345,261.82	5,452,368.32	107,106.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Dec-18	3-Dec-19	1,400,000.00	1,433,324.10	1,462,902.33	29,578.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	13-Dec-19	900,000.00	948,842.42	970,603.54	21,761.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	13-Dec-19	4,900,000.00	4,912,892.20	5,011,795.00	98,902.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Dec-18	27-Dec-19	5,600,000.00	5,704,321.69	5,790,340.34	86,018.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Jan-19	2-Jul-19	500,000.00	489,204.08	490,086.59	882.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	3-Jan-19	2-Jul-19	9,100,000.00	9,524,297.80	9,515,235.59	9,062.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jan-19	3-Jul-19	500,000.00	529,095.61	530,763.08	1,667.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jan-19	3-Jul-19	15,800,000.00	16,476,196.63	16,495,586.49	19,389.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Jan-19	7-Jan-20	1,200,000.00	1,196,213.74	1,220,746.91	24,533.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Jan-19	8-Jan-20	3,700,000.00	3,765,396.26	3,839,362.15	73,965.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	9-Jan-19	8-Jul-19	240,000.00	249,165.41	249,365.45	200.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	9-Jan-19	8-Jul-19	4,500,000.00	4,904,162.76	4,915,832.41	11,669.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jan-19	9-Jul-19	500,000.00	489,218.06	491,235.13	2,017.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-Jan-19	8-Oct-19	490,000.00	524,021.73	529,485.26	5,463.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	11-Jan-19	8-Oct-19	490,000.00	524,021.73	529,485.26	5,463.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Jan-19	10-Jul-19	1,700,000.00	1,778,844.12	1,784,706.19	5,862.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Jan-19	10-Jul-19	330,000.00	337,835.41	338,082.70	247.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Jan-19	12-Jul-19	2,000,000.00	2,068,865.10	2,071,860.94	2,995.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Jan-19	15-Jul-19	2,000,000.00	1,963,015.17	1,964,103.84	1,088.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Jan-19	15-Jul-19	2,900,000.00	2,883,133.27	2,888,702.57	5,569.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Jan-19	13-Jan-20	1,100,000.00	1,128,931.96	1,150,279.45	21,347.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jan-19	17-Jul-19	8,500,000.00	8,601,673.22	8,609,212.01	7,538.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jan-19	13-Jan-20	700,000.00	773,834.51	787,084.29	13,249.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Jan-19	22-Jul-19	1,000,000.00	1,003,064.22	1,006,132.80	3,068.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-Jan-19	22-Jul-19	550,000.00	552,189.86	553,879.12	1,689.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Jan-19	22-Jul-19	700,000.00	743,952.26	744,617.71	665.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Jan-19	22-Jul-19	4,200,000.00	4,178,423.85	4,181,340.99	2,917.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Jan-19	23-Jan-20	500,000.00	477,917.08	486,538.68	8,621.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
CE1019	25-Jan-19	24-Jul-19	230,000.00	241,381.95	238,447.44	2,934.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Jan-19	26-Jul-19	6,100,000.00	6,163,712.18	6,173,184.58	9,472.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Jan-19	24-Jan-20	50,800,000.00	50,353,176.99	51,328,152.60	974,975.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Jan-19	24-Jan-20	49,400,000.00	48,879,785.97	49,826,232.68	946,446.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31-Jan-19	30-Jul-19	320,000.00	327,003.28	327,421.78	418.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Feb-19	2-Aug-19	600,000.00	661,420.13	662,801.29	1,381.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Feb-19	5-Aug-19	4,200,000.00	4,232,202.11	4,246,963.78	14,761.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Feb-19	5-Aug-19	2,200,000.00	2,265,169.22	2,272,177.37	7,008.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Feb-19	7-Aug-19	1,400,000.00	1,479,020.95	1,483,423.74	4,402.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Feb-19	7-Aug-19	1,500,000.00	1,531,264.38	1,535,521.31	4,256.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Feb-19	7-Aug-19	2,500,000.00	2,564,814.83	2,570,936.04	6,121.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	11-Feb-19	9-Aug-19	510,000.00	530,552.43	531,548.26	995.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Feb-19	12-Aug-19	7,400,000.00	7,711,865.68	7,735,599.16	23,733.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	15-Feb-19	14-Aug-19	570,000.00	586,857.03	588,248.24	1,391.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Feb-19	14-Aug-19	1,400,000.00	1,485,201.24	1,489,013.87	3,812.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Feb-19	13-Feb-20	7,400,000.00	7,540,075.59	7,710,361.20	170,285.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Feb-19	19-Aug-19	1,300,000.00	1,330,594.49	1,335,975.06	5,380.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Feb-19	19-Aug-19	3,800,000.00	3,925,373.99	3,940,474.21	15,100.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19-Feb-19	19-Aug-19	480,000.00	495,512.11	497,711.09	2,198.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-Feb-19	23-Aug-19	7,200,000.00	7,468,266.42	7,496,703.15	28,436.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-Feb-19	23-Aug-19	800,000.00	858,601.47	861,870.75	3,269.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-Feb-19	23-Aug-19	900,000.00	1,003,897.13	1,007,719.64	3,822.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Feb-19	27-Aug-19	2,400,000.00	2,497,062.13	2,508,928.79	11,866.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0227	4-Mar-19	5-Jul-19	200,000.00	231,701.90	231,411.74	290.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Mar-19	2-Sep-19	2,600,000.00	2,739,577.86	2,717,987.33	21,590.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Mar-19	2-Sep-19	1,600,000.00	1,682,908.22	1,691,889.76	8,981.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Mar-19	4-Sep-19	12,700,000.00	13,225,741.14	13,313,218.28	87,477.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Mar-19	9-Sep-19	6,800,000.00	7,069,105.57	7,114,032.51	44,926.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Mar-19	9-Sep-19	400,000.00	420,916.01	423,259.39	2,343.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Mar-19	10-Sep-19	5,300,000.00	5,541,490.99	5,580,795.22	39,304.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Mar-19	4-Sep-19	24,400,000.00	28,101,789.93	28,243,347.62	141,557.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Mar-19	16-Sep-19	1,200,000.00	1,233,451.12	1,241,328.65	7,877.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	20-Mar-19	17-Sep-19	9,400,000.00	10,579,823.13	10,648,926.44	69,103.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-Mar-19	20-Sep-19	4,300,000.00	4,484,972.43	4,513,566.87	28,594.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25-Mar-19	20-Sep-19	7,000,000.00	7,409,731.51	7,459,891.66	50,160.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	25-Mar-19	20-Sep-19	14,000,000.00	15,928,552.25	16,039,519.37	110,967.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Mar-19	23-Sep-19	7,000,000.00	7,412,486.59	7,486,397.51	73,910.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Mar-19	23-Sep-19	700,000.00	755,918.92	761,662.74	5,743.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-Apr-19	27-Sep-19	24,600,000.00	28,567,413.68	28,800,859.71	233,446.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Apr-19	27-Mar-20	1,600,000.00	1,640,599.53	1,674,759.12	34,159.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-Apr-19	30-Sep-19	1,500,000.00	1,624,666.08	1,636,757.65	12,091.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-Apr-19	30-Sep-19	500,000.00	567,434.86	571,993.34	4,558.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	4-Apr-19	3-Jul-19	150,000.00	156,038.77	154,729.93	1,308.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Apr-19	3-Jul-19	4,800,000.00	5,266,361.14	5,269,446.93	3,085.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Apr-19	3-Jul-19	9,400,000.00	10,256,465.05	10,268,535.27	12,070.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Apr-19	1-Oct-19	21,800,000.00	23,540,257.40	23,380,883.08	159,374.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	4-Apr-19	1-Oct-19	1,400,000.00	1,501,280.03	1,512,384.29	11,104.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Apr-19	3-Jul-19	6,700,000.00	7,804,732.25	7,801,631.14	3,101.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Apr-19	1-Oct-19	1,000,000.00	1,096,963.89	1,104,645.94	7,682.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Apr-19	4-Jul-19	2,500,000.00	2,691,778.31	2,689,557.43	2,220.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Apr-19	2-Oct-19	2,400,000.00	2,520,050.57	2,541,553.30	21,502.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Apr-19	30-Mar-20	2,400,000.00	2,508,870.18	2,560,590.34	51,720.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-Apr-19	4-Jul-19	2,200,000.00	2,564,083.06	2,560,961.46	3,121.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Apr-19	4-Oct-19	4,600,000.00	4,948,495.91	4,990,261.75	41,765.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Apr-19	15-Jan-20	38,000,000.00	39,875,510.56	39,762,809.73	112,700.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	8-Apr-19	9-Jul-19	73,100,000.00	83,720,680.27	83,817,883.30	97,203.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	8-Apr-19	6-Aug-19	400,000.00	465,271.05	466,134.27	863.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-Apr-19	7-Oct-19	510,000.00	505,370.17	509,266.84	3,896.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	9-Apr-19	7-Oct-19	250,000.00	249,134.20	251,055.16	1,920.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Apr-19	8-Jul-19	2,300,000.00	2,587,343.86	2,587,386.20	42.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Apr-19	8-Jul-19	1,200,000.00	1,317,772.19	1,318,311.76	539.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Apr-19	8-Jul-19	6,400,000.00	7,205,615.00	7,207,148.87	1,533.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Apr-19	7-Oct-19	2,300,000.00	2,474,829.16	2,497,325.04	22,495.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Apr-19	7-Oct-19	24,500,000.00	26,542,496.71	26,773,294.05	230,797.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Apr-19	9-Jul-19	16,900,000.00	18,993,574.88	19,015,627.17	22,052.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Apr-19	9-Jul-19	44,900,000.00	50,346,505.87	50,404,960.16	58,454.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Apr-19	9-Jul-19	2,700,000.00	3,075,790.25	3,079,361.36	3,571.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-Apr-19	9-Jul-19	12,700,000.00	14,560,776.44	14,569,086.75	8,310.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	10-Apr-19	10-Jul-19	45,600,000.00	52,257,280.90	52,326,385.21	69,104.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0332	10-Apr-19	7-Oct-19	500,000.00	593,399.80	598,092.02	4,692.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Apr-19	10-Jul-19	7,300,000.00	8,205,226.58	8,216,077.06	10,850.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	11-Apr-19	8-Oct-19	27,000,000.00	31,444,098.01	31,716,057.32	271,959.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Apr-19	11-Jul-19	3,900,000.00	4,379,482.13	4,381,671.57	2,189.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Apr-19	11-Jul-19	13,500,000.00	15,115,080.38	15,137,506.72	22,426.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Apr-19	16-Jul-19	3,000,000.00	3,192,355.57	3,197,150.80	4,795.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15-Apr-19	16-Jul-19	4,500,000.00	5,230,638.20	5,237,465.95	6,827.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	16-Apr-19	16-Jul-19	500,000.00	514,335.02	515,411.44	1,076.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Apr-19	16-Jul-19	1,200,000.00	1,298,019.90	1,300,736.45	2,716.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Apr-19	16-Jul-19	1,600,000.00	1,730,036.59	1,733,316.47	3,279.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Apr-19	16-Jul-19	500,000.00	541,259.06	542,285.20	1,026.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Apr-19	16-Jul-19	400,000.00	447,156.55	448,004.29	847.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Apr-19	16-Jul-19	1,300,000.00	1,401,507.21	1,404,164.25	2,657.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0124	16-Apr-19	10-Jul-19	300,000.00	314,554.57	314,537.54	17.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-Apr-19	16-Jul-19	3,100,000.00	3,628,509.12	3,631,818.51	3,309.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-Apr-19	14-Oct-19	800,000.00	887,335.43	895,112.16	7,776.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	16-Jul-19	3,200,000.00	3,538,249.97	3,519,360.09	18,889.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	17-Jul-19	36,500,000.00	39,076,234.81	39,202,851.30	126,616.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	17-Jul-19	36,500,000.00	39,076,234.81	39,202,851.30	126,616.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	15-Oct-19	1,400,000.00	1,524,960.08	1,540,961.69	16,001.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	10-Apr-20	9,000,000.00	9,507,765.60	9,732,302.50	224,536.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	57,945,739.48	1,347,253.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	57,945,739.48	1,347,253.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	17-Apr-19	13-Apr-20	53,400,000.00	56,598,485.56	57,945,739.48	1,347,253.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Apr-19	18-Oct-19	1,500,000.00	1,659,568.08	1,680,361.04	20,792.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22-Apr-19	23-Jul-19	9,200,000.00	10,890,845.44	10,913,041.69	22,196.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	23-Apr-19	3-Jul-19	200,000.00	204,563.90	204,804.64	240.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Apr-19	21-Oct-19	2,300,000.00	2,475,400.21	2,499,699.78	24,299.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-Apr-19	24-Jul-19	490,000.00	512,972.41	514,201.32	1,228.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	24-Apr-19	24-Jul-19	500,000.00	523,036.93	524,289.96	1,253.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Apr-19	25-Jul-19	1,600,000.00	1,708,622.69	1,715,011.90	6,389.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Apr-19	28-Oct-19	6,300,000.00	6,956,135.30	7,035,851.98	79,716.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-Apr-19	29-Jul-19	1,100,000.00	1,285,849.97	1,290,101.22	4,251.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30-Apr-19	29-Jul-19	2,400,000.00	2,800,909.84	2,808,513.86	7,604.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-May-19	30-Jul-19	1,800,000.00	1,972,285.19	1,977,913.15	5,627.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	1-May-19	30-Jul-19	10,000,000.00	11,779,433.33	11,810,725.85	31,292.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-May-19	31-Jul-19	1,200,000.00	1,285,231.59	1,289,077.24	3,845.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-May-19	29-Oct-19	5,300,000.00	5,706,048.20	5,777,940.29	71,892.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-May-19	29-Oct-19	1,900,000.00	2,113,422.49	2,139,213.32	25,790.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	2-May-19	31-Jul-19	5,500,000.00	6,466,610.69	6,489,784.99	23,174.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-May-19	30-Oct-19	4,600,000.00	4,943,586.66	5,008,574.14	64,987.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	3-May-19	1-Aug-19	510,000.00	533,272.59	535,257.64	1,985.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-May-19	2-Jul-19	400,000.00	459,364.11	459,920.97	556.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	3-May-19	30-Oct-19	13,900,000.00	16,289,096.51	16,496,774.59	207,678.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-May-19	19-Aug-19	44,900,000.00	52,839,721.08	53,283,330.60	443,609.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	3-May-19	23-Aug-19	16,800,000.00	19,766,073.78	19,915,502.49	149,428.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0332	3-May-19	2-Sep-19	30,800,000.00	36,271,952.46	36,652,241.00	380,288.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-May-19	1-Aug-19	25,500,000.00	28,517,242.92	28,444,464.36	72,778.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-May-19	5-Aug-19	1,900,000.00	2,054,937.37	2,050,825.53	4,111.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	6-May-19	5-Jul-19	10,500,000.00	12,084,164.21	12,130,948.00	46,783.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	6-May-19	29-Jul-19	23,300,000.00	26,182,055.60	26,160,622.67	21,432.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	6-May-19	1-Aug-19	23,100,000.00	25,989,600.00	25,968,929.63	20,670.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-May-19	5-Jul-19	1,800,000.00	2,030,431.85	2,027,093.25	3,338.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-May-19	8-Jul-19	3,600,000.00	4,044,938.92	4,050,575.66	5,636.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-May-19	5-Aug-19	11,400,000.00	12,274,180.70	12,278,403.73	4,223.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-May-19	5-Nov-19	4,800,000.00	5,253,258.45	5,247,987.27	5,271.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-May-19	5-Nov-19	1,600,000.00	1,805,359.73	1,805,984.97	625.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-May-19	5-Jul-19	250,000.00	262,699.23	262,215.82	483.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-May-19	5-Aug-19	900,000.00	1,057,048.53	1,054,521.42	2,527.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-May-19	8-Jul-19	23,600,000.00	25,628,737.95	25,573,889.65	54,848.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	9-May-19	8-Jul-19	2,300,000.00	2,644,011.83	2,639,388.21	4,623.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0831	10-May-19	8-Aug-19	490,000.00	515,880.27	517,081.36	1,201.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0836	10-May-19	8-Aug-19	2,300,000.00	2,515,257.47	2,524,083.67	8,826.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0837	10-May-19	6-Nov-19	15,300,000.00	16,820,602.11	16,832,167.05	11,564.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-May-19	8-Nov-19	520,000.00	528,499.08	528,610.76	111.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-May-19	8-Nov-19	460,000.00	470,434.08	471,260.74	826.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-May-19	8-Nov-19	610,000.00	624,443.82	624,575.77	131.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-May-19	12-Jul-19	5,900,000.00	6,594,676.30	6,589,972.98	4,703.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-May-19	12-Aug-19	900,000.00	1,002,573.69	1,001,142.41	1,431.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	13-May-19	12-Aug-19	5,000,000.00	5,352,087.27	5,342,360.16	9,727.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	13-May-19	12-Aug-19	310,000.00	328,283.95	327,687.31	596.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	13-May-19	12-Jul-19	1,900,000.00	2,120,960.14	2,119,031.73	1,928.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-May-19	12-Jul-19	3,400,000.00	3,843,321.65	3,841,334.24	1,987.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-May-19	12-Aug-19	2,600,000.00	3,074,457.23	3,095,455.57	20,998.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-May-19	11-Nov-19	1,000,000.00	1,157,872.09	1,174,719.40	16,847.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-May-19	12-Jul-19	11,300,000.00	12,674,387.00	12,715,240.67	40,853.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	15-May-19	13-Aug-19	290,000.00	307,454.95	309,171.36	1,716.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-May-19	13-Aug-19	4,200,000.00	4,509,742.31	4,533,135.98	23,393.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	15-May-19	14-May-20	4,600,000.00	5,334,390.06	5,485,769.93	151,379.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-May-19	12-Nov-19	2,100,000.00	2,247,920.67	2,279,627.83	31,707.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-May-19	14-Aug-19	800,000.00	929,691.59	934,275.62	4,584.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16-May-19	14-Aug-19	3,000,000.00	3,589,794.82	3,607,495.00	17,700.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	16-May-19	15-Jul-19	37,700,000.00	41,764,154.56	41,919,008.01	154,853.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	16-May-19	9-Aug-19	46,100,000.00	51,203,973.29	51,532,391.02	328,417.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-May-19	13-Nov-19	2,000,000.00	2,159,831.74	2,191,048.15	31,216.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-May-19	11-May-20	53,200,000.00	56,793,951.90	58,304,661.01	1,510,709.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-May-19	15-Aug-19	1,500,000.00	1,831,690.50	1,839,890.86	8,200.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	17-May-19	16-Jul-19	14,400,000.00	15,931,139.29	15,986,483.22	55,343.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-May-19	17-Sep-19	12,400,000.00	13,499,378.05	13,608,860.39	109,482.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-May-19	14-May-20	24,300,000.00	26,013,386.22	26,715,312.87	701,926.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20-May-19	19-Aug-19	2,700,000.00	3,252,039.15	3,269,036.96	16,997.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	20-May-19	19-Jul-19	65,900,000.00	73,399,594.73	73,661,098.17	261,503.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0134	22-May-19	19-Sep-19	13,100,000.00	15,453,349.01	15,601,517.86	148,168.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-May-19	21-Aug-19	900,000.00	968,116.10	974,017.46	5,901.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	24-May-19	8-Nov-19	390,000.00	395,575.63	401,782.06	6,206.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24-May-19	22-Aug-19	4,700,000.00	5,542,236.01	5,576,785.41	34,549.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-May-19	26-Aug-19	5,600,000.00	6,144,961.80	6,186,661.86	41,700.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-May-19	27-Aug-19	13,800,000.00	15,084,912.98	15,183,394.49	98,481.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	27-May-19	26-Aug-19	590,000.00	620,397.72	624,239.78	3,842.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	27-May-19	5-Aug-19	11,800,000.00	13,220,196.60	13,204,061.25	16,135.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-May-19	26-Jul-19	4,300,000.00	4,676,420.55	4,692,814.29	16,393.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	29-May-19	27-Aug-19	510,000.00	534,906.70	537,870.57	2,963.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-May-19	25-Nov-19	4,500,000.00	4,960,362.58	5,042,933.62	82,571.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	29-May-19	29-Jul-19	390,000.00	408,913.30	410,830.57	1,917.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	29-May-19	26-Sep-19	22,400,000.00	25,265,232.59	25,508,137.44	242,904.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-May-19	2-Jul-19	1,600,000.00	1,781,192.22	1,785,812.70	4,620.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-May-19	27-Nov-19	2,000,000.00	2,201,650.66	2,232,408.77	30,758.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0134	31-May-19	1-Jul-19	4,300,000.00	5,132,250.86	5,137,642.22	5,391.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	31-May-19	2-Jul-19	18,200,000.00	20,357,823.91	20,406,609.46	48,785.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	3-Jun-19	3-Jul-19	4,600,000.00	5,093,361.18	5,099,355.25	5,994.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1024	4-Jun-19	3-Jun-20	140,000.00	145,922.37	149,019.34	3,096.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jun-19	4-Jul-19	2,400,000.00	2,738,934.36	2,740,981.75	2,047.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jun-19	4-Jul-19	3,100,000.00	3,514,234.13	3,516,861.07	2,626.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jun-19	4-Jul-19	4,800,000.00	5,407,699.73	5,411,742.06	4,042.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jun-19	2-Aug-19	9,000,000.00	9,755,130.02	9,781,258.68	26,128.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	4-Jun-19	2-Dec-19	800,000.00	868,075.34	879,819.89	11,744.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Jun-19	2-Aug-19	900,000.00	1,067,210.11	1,069,858.52	2,648.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Jun-19	2-Aug-19	900,000.00	1,067,210.11	1,069,858.52	2,648.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	4-Jun-19	2-Aug-19	900,000.00	1,067,210.11	1,069,858.52	2,648.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	4-Jun-19	2-Aug-19	5,100,000.00	5,709,675.02	5,733,974.95	24,299.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Jun-19	5-Jul-19	5,700,000.00	6,490,638.75	6,501,655.51	11,016.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-Jun-19	4-Jul-19	2,200,000.00	2,651,140.79	2,653,122.55	1,981.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	5-Jun-19	4-Jul-19	600,000.00	764,631.31	765,202.88	571.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	6-Jun-19	1-Nov-19	160,000.00	159,757.64	161,432.01	1,674.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Jun-19	8-Jul-19	700,000.00	767,096.45	768,014.33	917.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	6-Jun-19	1-Jun-20	1,100,000.00	1,255,112.49	1,281,679.59	26,567.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Jun-19	9-Jul-19	4,600,000.00	5,195,352.07	5,193,213.83	2,138.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Jun-19	9-Jul-19	22,500,000.00	25,623,315.61	25,612,769.89	10,545.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Jun-19	4-Dec-19	15,400,000.00	17,037,301.20	17,259,425.55	222,124.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	7-Jun-19	8-Jul-19	490,000.00	510,872.87	510,780.88	91.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	7-Jun-19	4-Sep-19	5,200,000.00	6,237,783.98	6,272,890.57	35,106.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	7-Jun-19	9-Jul-19	13,600,000.00	15,299,135.44	15,316,898.34	17,762.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jun-19	10-Jul-19	900,000.00	1,030,516.96	1,030,258.84	258.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jun-19	11-Jul-19	1,600,000.00	1,796,577.66	1,795,711.86	865.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jun-19	9-Aug-19	15,400,000.00	16,792,566.36	16,820,788.45	28,222.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jun-19	9-Aug-19	600,000.00	647,164.49	648,125.13	960.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Jun-19	11-Jul-19	350,000.00	364,425.70	364,321.58	104.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Jun-19	9-Aug-19	510,000.00	531,971.47	532,761.12	789.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0332	10-Jun-19	11-Jul-19	2,400,000.00	2,869,098.58	2,868,842.06	256.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-Jun-19	9-Aug-19	2,200,000.00	2,589,520.70	2,592,856.52	- 3,335.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10-Jun-19	9-Sep-19	5,900,000.00	6,810,583.84	6,841,803.47	- 31,219.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	11-Jun-19	11-Jul-19	240,000.00	257,324.17	257,301.16	23.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Jun-19	11-Jul-19	9,200,000.00	10,417,671.25	10,418,785.54	- 1,114.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Jun-19	11-Jul-19	6,600,000.00	7,489,764.77	7,489,095.13	669.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Jun-19	9-Aug-19	9,800,000.00	10,681,371.10	10,699,322.53	- 17,951.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	11-Jun-19	9-Aug-19	7,700,000.00	8,689,270.39	8,705,579.81	- 16,309.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	12-Jun-19	10-Jul-19	84,700,000.00	95,634,547.35	95,311,166.95	323,380.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-Jun-19	9-Sep-19	340,000.00	364,605.62	366,492.00	- 1,886.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-Jun-19	9-Sep-19	400,000.00	424,420.18	425,782.79	- 1,362.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	12-Jun-19	11-Sep-19	180,000.00	177,299.11	178,058.83	- 759.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Jun-19	12-Jul-19	3,400,000.00	3,830,987.23	3,829,757.72	1,229.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Jun-19	15-Jul-19	250,000.00	257,784.68	257,624.14	160.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Jun-19	15-Jul-19	650,000.00	673,910.86	674,152.24	- 241.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12-Jun-19	15-Jul-19	600,000.00	623,783.22	624,006.64	- 223.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Jun-19	15-Jul-19	1,000,000.00	1,243,802.15	1,243,027.56	774.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Jun-19	12-Aug-19	2,000,000.00	2,393,171.24	2,395,367.79	- 2,196.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Jun-19	12-Aug-19	1,000,000.00	1,201,712.15	1,203,993.43	- 2,281.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Jun-19	12-Jul-19	46,100,000.00	55,249,698.63	55,037,526.21	212,172.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12-Jun-19	15-Jul-19	4,300,000.00	5,201,697.59	5,203,560.70	- 1,863.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0626	12-Jun-19	10-Sep-19	138,800,000.00	145,606,850.28	146,409,980.77	- 803,130.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	13-Jun-19	11-Sep-19	290,000.00	297,551.57	298,593.11	- 1,041.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
BO0126	13-Jun-19	11-Sep-19	18,100,000.00	19,863,358.67	19,944,573.79	81,215.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Jun-19	11-Sep-19	2,600,000.00	2,819,476.39	2,831,004.36	11,527.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Jun-19	11-Oct-19	3,900,000.00	4,336,383.77	4,368,166.11	31,782.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	14-Jun-19	17-Jul-19	490,000.00	511,560.93	511,106.09	454.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Jun-19	17-Jul-19	8,900,000.00	9,640,232.20	9,639,218.02	1,014.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Jun-19	16-Jul-19	670,000.00	700,912.23	701,000.83	88.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14-Jun-19	13-Aug-19	540,000.00	564,405.92	565,001.73	595.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Jun-19	17-Jul-19	2,100,000.00	2,571,007.94	2,570,737.46	270.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Jun-19	13-Aug-19	10,800,000.00	12,974,939.67	12,986,094.83	11,155.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14-Jun-19	12-Sep-19	3,500,000.00	4,043,857.17	4,059,390.79	15,533.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-Jun-19	17-Jul-19	9,700,000.00	10,914,584.55	10,907,017.89	7,566.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	14-Jun-19	17-Jul-19	8,100,000.00	9,207,096.73	9,206,128.11	968.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Jun-19	17-Jul-19	15,700,000.00	17,048,391.92	17,046,598.37	1,793.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Jun-19	16-Sep-19	6,300,000.00	6,919,329.65	6,948,559.78	29,230.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17-Jun-19	15-Aug-19	3,000,000.00	3,629,873.69	3,635,417.31	5,543.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Jun-19	3-Jul-19	90,000.00	92,007.92	91,683.05	324.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	18-Jun-19	18-Jul-19	720,000.00	760,155.38	759,006.52	1,148.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jun-19	8-Jul-19	500,000.00	556,115.23	554,381.68	1,733.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jun-19	18-Jul-19	800,000.00	848,275.25	848,155.98	119.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jun-19	18-Jul-19	500,000.00	552,277.37	551,226.77	1,050.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Jun-19	16-Sep-19	14,300,000.00	15,686,595.83	15,740,565.24	53,969.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	18-Jun-19	18-Jul-19	520,000.00	543,603.55	542,781.97	821.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18-Jun-19	18-Jul-19	5,900,000.00	7,031,547.99	7,018,171.86	13,376.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
MH0828	18-Jun-19	16-Jul-19	5,700,000.00	6,453,142.21	6,437,535.65	15,606.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jun-19	19-Jul-19	15,700,000.00	17,082,925.03	17,056,507.09	26,417.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jun-19	19-Jul-19	13,500,000.00	14,641,316.35	14,615,812.33	25,504.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jun-19	19-Jul-19	800,000.00	827,822.78	826,380.78	1,442.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-Jun-19	19-Jul-19	7,200,000.00	8,693,699.52	8,678,555.78	15,143.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19-Jun-19	19-Aug-19	1,100,000.00	1,364,705.69	1,365,670.17	- 964.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	21-Jun-19	15-Jun-20	580,000.00	587,179.94	599,493.63	12,313.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Jun-19	20-Aug-19	500,000.00	502,025.68	501,860.80	164.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Jun-19	15-Jun-20	7,500,000.00	8,160,454.46	8,318,817.73	- 158,363.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	21-Jun-19	20-Aug-19	1,000,000.00	1,099,676.96	1,099,745.29	- 68.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-Jun-19	24-Jul-19	900,000.00	973,234.62	972,700.23	534.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	24-Jun-19	23-Sep-19	15,200,000.00	17,061,483.58	17,144,135.90	- 82,652.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	25-Jun-19	25-Jul-19	1,460,000.00	1,543,744.22	1,535,924.63	7,819.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25-Jun-19	23-Aug-19	6,400,000.00	7,788,598.01	7,793,812.87	- 5,214.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	25-Jun-19	25-Jul-19	47,500,000.00	53,841,230.41	53,788,693.80	52,536.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	25-Jun-19	25-Jul-19	1,400,000.00	1,537,060.17	1,535,860.97	1,199.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	26-Jun-19	9-Jul-19	240,000.00	255,977.80	254,871.58	1,106.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Jun-19	11-Jul-19	31,800,000.00	35,854,296.13	35,696,892.24	157,403.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	26-Jun-19	26-Jul-19	640,000.00	667,302.47	665,455.70	1,846.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-Jun-19	19-Jul-19	4,300,000.00	5,127,608.74	5,110,672.66	16,936.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-Jun-19	26-Jul-19	5,200,000.00	6,159,331.71	6,144,686.39	14,645.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	26-Jun-19	18-Dec-19	900,000.00	1,065,010.17	1,074,831.67	- 9,821.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Jun-19	29-Jul-19	14,200,000.00	15,358,411.97	15,315,855.34	42,556.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
DR0223	27-Jun-19	25-Sep-19	1,000,000.00	1,087,895.00	1,089,438.22	1,543.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-Jun-19	26-Jul-19	800,000.00	967,378.67	964,701.43	2,677.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27-Jun-19	29-Jul-19	5,500,000.00	6,592,045.59	6,554,569.34	37,476.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27-Jun-19	26-Jul-19	62,800,000.00	69,555,561.16	69,390,175.76	165,385.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-Jun-19	26-Jul-19	250,000.00	259,165.51	258,448.26	717.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	28-Jun-19	29-Jul-19	240,000.00	257,554.29	256,941.04	613.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Jun-19	30-Jul-19	9,000,000.00	9,784,064.94	9,756,397.46	27,667.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	28-Jun-19	30-Jul-19	740,000.00	770,123.15	768,095.44	2,027.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-Jun-19	26-Jul-19	800,000.00	967,190.32	964,702.06	2,488.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-Jun-19	30-Jul-19	1,900,000.00	2,275,604.73	2,270,500.38	5,104.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28-Jun-19	17-Dec-19	1,900,000.00	2,257,538.40	2,278,465.63	20,927.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0828	28-Jun-19	12-Jul-19	83,400,000.00	94,253,005.76	93,964,561.37	288,444.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			2,680,310,000.00	2,956,545,281.11	2,971,742,682.33	- 15,197,401.22		

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-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
FT1219	19/6/2019	16/12/2019	5,000.00	489,829.24	490,450.00	620.76	USD	Bolsa de Valores de Chicago
FT0620	19/6/2019	15/6/2020	10,000.00	982,997.37	983,800.00	802.63	USD	Bolsa de Valores de Chicago
FT0620	21/6/2019	15/6/2020	12,500.00	1,228,746.71	1,229,750.00	1,003.29	USD	Bolsa de Valores de Chicago
Total			27,500.00	2,701,573.32	2,704,000.00	2,426.68		

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 negociación
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 negociación
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

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 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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

c) Divisas Cuenta 6.1.3

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

e) Oro Cuenta 6.1.4

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

10. Inversiones en otras obligaciones DOP

Codigo ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Porcentaje de participacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	DOP	N/A
Total		-	-				0%

11. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Codigo ISIN	Títulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
DO1002218720	BCRD 10.50% 14-FEB-2025	81,000,000.00	N/A	80,296,110.00	N/A	DOP	OTC	2%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	18,000,000.00	N/A	18,325,098.00	N/A	DOP	OTC	1%
DO1002215825	BCRD 11% 14-OCT-22	12,000,000.00	N/A	12,256,236.00	N/A	DOP	OTC	0%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	63,000,000.00	N/A	62,510,868.00	N/A	DOP	OTC	2%
DO1002218522	NOTAS BCRD 10.00% 13-ENE-2023	65,000,000.00	N/A	64,495,340.00	N/A	DOP	OTC	2%
DO1002216526	BCRD 10% 10-SEPT-2021	60,000,000.00	N/A	59,948,460.00	N/A	DOP	OTC	2%
DO1002218621	NOTAS BCRD 10.50% 17-ENE-2025	135,000,000.00	N/A	133,945,515.00	N/A	DOP	OTC	4%
DO1005206722	MHRD 11.50% 11-ENE-2034	461,000,000.00	N/A	497,221,231.00	N/A	DOP	OTC	15%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	448,000,000.00	N/A	468,827,520.00	N/A	DOP	OTC	15%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	100,000,000.00	N/A	105,870,100.00	N/A	DOP	OTC	3%
DO1005206623	MHRD 10.25% 11-ENE-2024	280,000,000.00	N/A	288,074,360.00	N/A	DOP	OTC	9%
DO1005206623	MHRD 10.25% 11-ENE-2024	79,000,000.00	N/A	81,278,123.00	N/A	DOP	OTC	3%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	100,000,000.00	N/A	107,793,200.00	N/A	DOP	OTC	3%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	390,200,000.00	N/A	408,340,398.00	N/A	DOP	OTC	13%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	120,000,000.00	N/A	128,966,520.00	N/A	DOP	OTC	4%
DO1005206722	MHRD 11.50% 11-ENE-2034	85,000,000.00	N/A	91,678,535.00	N/A	DOP	OTC	3%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	200,000,000.00	N/A	209,298,000.00	N/A	DOP	OTC	6%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	90,000,000.00	N/A	95,655,600.00	N/A	DOP	OTC	3%
DO1005206516	MHRD 10.75% 11-AGOS-2028	80,000,000.00	N/A	83,719,200.00	N/A	DOP	OTC	3%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	45,000,000.00	N/A	48,362,445.00	N/A	DOP	OTC	1%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	30,000,000.00	N/A	31,885,200.00	N/A	DOP	OTC	1%
DO2003700120	ASOCIACION CIBAO 10.30% 16-MAY	130,000,000.00	N/A	130,026,910.00	N/A	DOP	OTC	4%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	20,000,000.00	N/A	22,200,780.00	N/A	DOP	OTC	1%
		3,092,200,000.00		3,230,975,749.00				100%

a) Titulos Valores de Deuda USD

Nota: Tasa al cierre de mes

50.8187

Codigo ISIN	Titulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
		-	-	-	-			0%

b) Acciones

Codigo ISIN	Acciones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participacion
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) Inversiones en otras obligaciones

Codigo ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Total		-	-	-	-	-	-	0%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 participación
N/A	Banco Santa Cruz	848,976,109	848,976,109	848,976,109	-	DOP	100.00%
Total		848,976,109	848,976,109	848,976,109	-		

2 Acciones

Acciones euro (EU)

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

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
US74348A1604	Proshares UltraPro SQQQ	750	19,794.67	12,570.00	(7,224.67)	USD	N/A	1%
DO9014000119	Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	118.00	126,491.21	118,073.16	(8,418.05)	USD	N/A	9%
N/A	Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 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%
DO8013900121	JMMB Fondo de Inversion Cerrado	128.00	131,949.65	133,679.10	1,729.45	USD	N/A	10%
Total		4,984.46	1,360,860.39	1,354,065.97	(6,794.42)			100%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 dias	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 dias	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 negociacion	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%

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%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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 10.55	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%

31 de diciembre de 2018

3. Títulos valores de deuda

Deuda en USD

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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%

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
---------------------	----------------	----------------	---------------	----------------	------------------	------------------------	------------------------	---------------------------------------

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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		-	-	-	-	-		

5 Contratos de Venta spot:

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	18-Oct-18	16-Apr-19	800,000.00	757,154.55	817,591.48	60,436.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	3-Dec-18	3-Jan-19	800,000.00	764,369.86	820,952.80	56,582.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	29-Nov-18	28-May-19	200,000.00	148,029.78	204,062.68	56,032.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Nov-18	29-May-19	300,000.00	250,709.74	306,213.63	55,503.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Oct-18	15-Apr-19	700,000.00	660,904.03	715,634.53	54,730.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Dec-18	31-May-19	500,000.00	455,521.27	510,207.90	54,686.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	4-Dec-18	4-Jan-19	900,000.00	869,593.11	923,333.83	53,740.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Aug-18	5-Feb-19	400,000.00	356,053.13	409,791.75	53,738.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	2-Nov-18	30-Apr-19	400,000.00	356,742.18	408,642.72	51,900.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	21-Sep-18	20-Mar-19	600,000.00	560,290.46	612,015.14	51,724.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	28-May-19	300,000.00	254,602.07	306,159.35	51,557.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	18-Jan-19	700,000.00	666,644.19	717,369.43	50,725.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	28-Nov-18	26-Feb-19	600,000.00	562,990.17	613,144.78	50,154.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Oct-18	24-Apr-19	300,000.00	256,788.03	306,601.03	49,812.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	4-Dec-18	31-May-19	500,000.00	460,321.10	510,096.73	49,775.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Nov-18	21-May-19	300,000.00	256,846.31	306,177.95	49,331.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	10-Jul-18	8-Jan-19	500,000.00	465,470.18	512,919.00	47,448.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	19-Feb-19	800,000.00	770,954.77	817,832.66	46,877.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Oct-18	7-Jun-19	600,000.00	565,168.15	611,948.07	46,779.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	8-Aug-18	4-Feb-19	600,000.00	568,014.42	614,107.04	46,092.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	5-Sep-18	4-Mar-19	900,000.00	873,471.57	919,147.98	45,676.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	20-Aug-18	15-Feb-19	600,000.00	568,276.97	613,640.99	45,364.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	600,000.00	569,937.53	614,685.52	44,747.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	11-Dec-18	11-Mar-19	500,000.00	467,556.00	511,917.21	44,361.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	12-Nov-18	12-Feb-19	400,000.00	366,005.82	409,658.49	43,652.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	24-Oct-18	22-Jan-19	700,000.00	673,764.39	717,133.11	43,368.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	263,640.94	306,844.13	43,203.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jul-18	5-Jul-19	300,000.00	261,666.06	304,588.25	42,922.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Nov-18	20-May-19	300,000.00	263,283.00	306,189.94	42,906.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Oct-18	10-Jan-19	500,000.00	470,288.93	512,859.88	42,570.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	5-Sep-18	4-Mar-19	300,000.00	265,911.46	307,166.66	41,255.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	30-Aug-18	26-Feb-19	200,000.00	163,703.33	204,663.13	40,959.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Sep-18	11-Mar-19	300,000.00	266,323.33	307,089.66	40,766.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	21-Nov-18	20-May-19	600,000.00	572,100.00	612,379.88	40,279.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Nov-18	10-May-19	300,000.00	266,169.69	306,366.87	40,197.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Oct-18	24-Apr-19	500,000.00	470,733.15	510,918.50	40,185.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Oct-18	3-Jan-19	700,000.00	678,454.87	718,333.70	39,878.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	27-Dec-18	28-Mar-19	500,000.00	472,372.26	511,504.04	39,131.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	17-Sep-18	14-Mar-19	200,000.00	165,738.23	204,746.64	39,008.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Dec-18	25-Jan-19	500,000.00	474,135.27	512,346.52	38,211.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Dec-18	29-Jan-19	500,000.00	474,146.23	512,226.59	38,080.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	16-Nov-18	15-Jan-19	300,000.00	270,051.33	307,587.74	37,536.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	475,032.19	512,556.34	37,524.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	19-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	475,260.28	512,556.34	37,296.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	2-Nov-18	31-Jan-19	600,000.00	577,022.56	614,290.85	37,268.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	475,662.00	512,646.24	36,984.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Sep-18	13-Sep-19	700,000.00	665,402.74	702,222.47	36,819.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	14-Mar-19	800,000.00	779,580.25	816,395.35	36,815.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	1-Oct-18	3-Jan-19	700,000.00	682,739.64	718,333.70	35,594.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	1-Nov-18	31-Jan-19	500,000.00	476,879.64	512,358.63	35,478.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Nov-18	14-Feb-19	300,000.00	272,048.88	307,195.94	35,147.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	12-Jun-19	800,000.00	781,220.56	815,770.67	34,550.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Feb-19	500,000.00	477,366.43	511,723.37	34,356.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	18-Jan-19	800,000.00	785,849.85	819,830.25	33,980.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Feb-19	500,000.00	477,800.67	511,683.10	33,882.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	478,280.82	512,036.70	33,755.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	478,280.82	512,036.70	33,755.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Nov-18	6-May-19	200,000.00	170,505.49	204,238.42	33,732.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	600,000.00	581,347.28	615,013.05	33,665.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Aug-18	19-Feb-19	500,000.00	478,250.62	511,906.50	33,655.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Aug-18	18-Feb-19	500,000.00	478,383.74	511,930.31	33,546.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	9-Nov-18	7-Feb-19	500,000.00	479,493.15	512,137.67	32,644.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Nov-18	25-Jan-19	600,000.00	582,387.76	614,566.52	32,178.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	12-Feb-19	900,000.00	888,483.69	920,553.58	32,069.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	600,000.00	581,751.59	613,821.40	32,069.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	5-Dec-18	4-Jan-19	400,000.00	378,722.67	410,401.02	31,678.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0729	30-Nov-18	3-Jan-19	400,000.00	378,161.16	409,608.40	31,447.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	7-Mar-19	500,000.00	480,838.51	511,937.06	31,098.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	11-Jul-18	7-Jan-19	500,000.00	482,356.45	512,930.58	30,574.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Aug-18	30-Jan-19	500,000.00	481,739.57	512,239.48	30,499.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
MH0332	2-Nov-18	1-Mar-19	400,000.00	387,417.19	417,350.61	29,933.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Oct-18	15-Apr-19	400,000.00	380,094.91	408,811.67	28,716.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Nov-18	8-Jan-19	500,000.00	484,488.50	512,907.02	28,418.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	22-Jan-19	500,000.00	484,120.54	512,436.45	28,315.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Sep-18	13-Mar-19	400,000.00	381,201.36	409,506.77	28,305.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Dec-18	27-Mar-19	500,000.00	483,771.86	511,584.76	27,812.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	26-Nov-18	28-Jun-19	500,000.00	482,039.64	509,801.56	27,761.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Aug-18	22-Aug-19	600,000.00	576,078.08	603,096.19	27,018.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Sep-18	12-Sep-19	500,000.00	477,502.92	504,364.68	26,861.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	22-Jan-19	800,000.00	793,232.10	819,580.69	26,348.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Dec-18	10-Jun-19	900,000.00	891,792.90	918,027.91	26,235.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	6-Jul-18	4-Jan-19	500,000.00	486,970.68	513,007.26	26,036.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	28-Feb-19	500,000.00	485,690.09	511,649.74	25,959.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Nov-18	5-Feb-19	400,000.00	383,832.87	409,750.52	25,917.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	16-Nov-18	15-May-19	300,000.00	280,868.02	306,368.68	25,500.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Dec-18	7-Jan-19	500,000.00	487,484.40	512,930.58	25,446.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	18-Jan-19	400,000.00	385,309.58	410,045.07	24,735.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	600,000.00	591,034.04	614,993.61	23,959.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	31-Oct-18	29-Apr-19	500,000.00	488,217.10	510,735.64	22,518.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	30-Jan-19	200,000.00	182,381.69	204,878.64	22,496.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	8-Jan-19	300,000.00	286,259.61	307,747.81	21,488.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	492,482.30	512,066.81	19,584.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	492,507.77	511,765.32	19,257.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Nov-18	4-Jan-19	700,000.00	698,925.16	718,148.53	19,223.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	493,036.25	512,096.92	19,060.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	31-Oct-18	30-Jan-19	300,000.00	288,293.83	307,317.96	19,024.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	492,967.88	511,650.95	18,683.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	186,441.79	205,022.54	18,580.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Nov-18	8-Jan-19	300,000.00	289,271.99	307,744.21	18,472.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Dec-18	18-Feb-19	500,000.00	493,686.21	511,859.94	18,173.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Dec-18	8-Feb-19	700,000.00	698,113.80	716,282.81	18,169.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	4-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	288,639.04	306,763.98	18,124.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	700,000.00	699,933.17	717,515.23	17,582.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	8-Jan-19	800,000.00	803,565.59	820,529.52	16,963.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	22-Jan-19	500,000.00	495,495.15	512,436.45	16,941.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	17-Dec-18	16-Jan-19	400,000.00	393,988.71	410,779.76	16,791.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	6-Dec-18	7-Jan-19	700,000.00	702,397.96	718,016.97	15,619.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	20-Aug-18	14-Feb-19	600,000.00	598,407.95	613,608.71	15,200.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	200,000.00	189,987.95	204,974.58	14,986.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Oct-18	26-Apr-19	700,000.00	700,143.78	715,113.63	14,969.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	200,000.00	190,256.16	205,046.51	14,790.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	5-Dec-18	5-Mar-19	200,000.00	190,371.24	204,770.44	14,399.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Nov-18	24-Jan-19	400,000.00	395,547.87	409,914.90	14,367.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Dec-18	8-Jan-19	200,000.00	190,912.05	205,162.81	14,250.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	10-May-19	200,000.00	190,121.10	204,244.58	14,123.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	16-Oct-18	15-Apr-19	300,000.00	293,809.15	306,608.75	12,799.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	20-Jul-18	16-Jan-19	300,000.00	294,840.42	307,569.76	12,729.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Aug-18	25-Feb-19	900,000.00	906,931.72	919,640.07	12,708.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	22-Oct-18	18-Apr-19	400,000.00	396,565.72	408,763.88	12,198.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	1-Oct-18	3-Jan-19	500,000.00	501,243.27	513,095.50	11,852.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Oct-18	22-Jan-19	500,000.00	500,790.35	512,452.14	11,661.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	13-Dec-18	11-Jan-19	700,000.00	707,365.46	717,824.40	10,458.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	7-Dec-18	7-Mar-19	900,000.00	908,677.09	919,022.53	10,345.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	23-Jul-18	18-Jan-19	200,000.00	196,398.61	205,022.54	8,623.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	8-Aug-18	4-Feb-19	300,000.00	298,885.27	307,343.06	8,457.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	8-Nov-18	1-Nov-19	500,000.00	493,990.27	502,206.67	8,216.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	9-Oct-18	10-Jan-19	200,000.00	197,138.67	205,143.95	8,005.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	19-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	197,857.65	205,027.67	7,170.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Feb-19	300,000.00	300,006.81	307,058.19	7,051.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	19-Oct-18	17-Apr-19	500,000.00	504,159.05	511,130.68	6,971.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	9-Nov-18	8-Jan-19	400,000.00	403,556.97	410,330.41	6,773.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	8-Oct-18	3-Oct-19	400,000.00	399,538.39	402,914.33	3,375.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	20-Nov-18	18-Jan-19	200,000.00	201,699.58	205,022.54	3,322.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	23-Oct-18	20-Feb-19	700,000.00	712,903.95	715,548.92	2,644.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	30-Nov-18	29-Jan-19	200,000.00	205,950.19	204,898.92	(1,051.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	205,904.10	204,826.72	(1,077.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	28-Sep-18	27-Mar-19	700,000.00	715,412.73	713,808.59	(1,604.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	12-Dec-18	11-Jan-19	3,200,000.00	3,283,929.85	3,281,482.97	(2,446.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10-Dec-18	9-Jan-19	400,000.00	413,105.50	410,630.43	(2,475.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0921	20-Dec-18	15-Jan-19	80,000.00	81,442.64	78,943.29	(2,499.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20-Dec-18	18-Feb-19	520,000.00	533,242.74	530,481.70	(2,761.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
CE1019	14-Dec-18	12-Feb-19	480,000.00	493,792.22	490,713.76	(3,078.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
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
BO0126	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
BO0126	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
BO0729	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	20-Dec-18	16-Apr-19	300,000.00	310,770.95	306,643.13	(4,127.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Nov-18	22-Jan-19	700,000.00	721,312.91	717,177.03	(4,135.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Oct-18	30-Jan-19	300,000.00	311,479.08	307,317.96	(4,161.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	518,208.99	512,667.60	(5,541.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
CE1019	13-Dec-18	11-Jan-19	470,000.00	488,354.19	482,369.04	(5,985.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	700,000.00	722,211.90	716,124.96	(6,086.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
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
BO0126	14-Dec-18	14-Mar-19	900,000.00	924,802.72	918,539.45	(6,263.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	4-Dec-18	4-Mar-19	900,000.00	925,600.45	919,147.98	(6,452.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	15-Nov-18	13-Feb-19	200,000.00	211,669.05	204,794.48	(6,874.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0729	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	4-Dec-18	31-May-19	200,000.00	212,693.49	204,038.69	(8,654.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Aug-18	18-Feb-19	300,000.00	315,823.90	307,115.97	(8,707.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	15-Oct-18	11-Jan-19	300,000.00	317,140.73	307,706.73	(9,434.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	15-Nov-18	13-Feb-19	800,000.00	827,831.42	818,207.40	(9,624.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Oct-18	5-Apr-19	400,000.00	419,247.70	408,970.90	(10,276.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Dec-18	21-Mar-19	200,000.00	215,173.46	204,653.04	(10,520.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
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
BO0729	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
BO0126	10-Jul-18	5-Jul-19	200,000.00	214,423.32	203,113.88	(11,309.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0621	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	13-Dec-18	13-Dec-19	900,000.00	908,083.52	896,354.27	(11,729.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	10-Jul-18	8-Jan-19	200,000.00	217,325.15	205,165.20	(12,159.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Nov-18	8-Jan-19	200,000.00	217,355.14	205,162.81	(12,192.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Dec-18	3-Jun-19	700,000.00	726,541.45	714,051.43	(12,490.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	2-Oct-18	2-Apr-19	500,000.00	524,110.98	511,273.30	(12,837.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Sep-18	20-Mar-19	1,400,000.00	1,445,906.97	1,432,124.20	(13,124.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	500,000.00	526,488.38	512,639.07	(13,849.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Aug-18	31-Jan-19	300,000.00	321,301.11	307,415.18	(13,885.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	219,131.44	205,202.90	(13,928.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	1-Oct-18	29-Mar-19	500,000.00	525,689.05	511,485.67	(14,203.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Nov-18	18-Jan-19	700,000.00	732,162.26	717,351.47	(14,810.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Dec-18	18-Mar-19	500,000.00	528,802.59	511,799.08	(17,003.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	1,126,175.34	1,144,175.34	1,126,923.45	(17,251.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12-Dec-18	11-Jan-19	100,000.00	120,449.66	102,567.26	(17,882.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	20-Dec-18	18-Jan-19	9,300,000.00	9,548,593.15	9,530,526.71	(18,066.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20-Jul-18	16-Jan-19	800,000.00	838,152.04	819,955.02	(18,197.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	18-Oct-18	16-Jan-19	500,000.00	531,089.86	512,616.27	(18,473.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	600,000.00	632,322.52	613,821.40	(18,501.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Dec-18	3-Jan-19	400,000.00	429,064.96	410,476.40	(18,588.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	6-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	530,743.18	511,972.26	(18,770.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Sep-18	6-Mar-19	500,000.00	532,109.48	511,954.66	(20,154.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	3-Jan-19	500,000.00	533,352.22	513,095.50	(20,256.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Dec-18	4-Jan-19	100,000.00	122,893.75	102,603.25	(20,290.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	23-Oct-18	23-Jan-19	300,000.00	328,394.95	307,453.73	(20,941.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	21-Dec-18	19-Jun-19	400,000.00	429,008.23	407,773.21	(21,235.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	23-Jul-18	18-Jan-19	700,000.00	739,004.05	717,387.38	(21,616.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	16-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	329,738.68	307,701.78	(22,036.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Nov-18	4-Feb-19	600,000.00	636,212.62	614,107.04	(22,105.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Sep-18	9-Sep-19	100,000.00	123,046.68	100,821.86	(22,224.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Jul-18	23-Jan-19	500,000.00	535,056.66	512,439.30	(22,617.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Oct-18	8-Jan-19	500,000.00	535,650.68	512,907.02	(22,743.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Jul-18	11-Jan-19	900,000.00	947,279.30	922,917.09	(24,362.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	16-Nov-18	15-Jan-19	700,000.00	743,473.74	717,545.13	(25,928.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0120	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	13-May-19	900,000.00	946,076.57	919,172.47	(26,904.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	3-Jan-19	700,000.00	745,294.05	718,333.70	(26,960.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	12-Oct-18	10-Apr-19	400,000.00	436,795.88	408,949.49	(27,846.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	30-Nov-18	29-May-19	800,000.00	844,886.09	816,218.75	(28,667.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	18-Sep-18	18-Mar-19	400,000.00	438,608.86	409,439.26	(29,169.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Oct-18	29-Jan-19	200,000.00	234,118.04	204,890.64	(29,227.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Oct-18	21-Oct-19	400,000.00	431,317.81	402,081.54	(29,236.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Nov-18	24-May-19	200,000.00	234,288.36	204,094.66	(30,193.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	23-Aug-18	16-Jan-19	400,000.00	441,782.87	410,093.02	(31,689.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	339,654.07	307,711.68	(31,942.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24-Jul-18	22-Jan-19	400,000.00	441,979.97	409,949.16	(32,030.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	9-Jul-18	7-Jan-19	200,000.00	238,016.44	205,172.23	(32,844.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	28-Dec-18	29-Jan-19	900,000.00	954,616.09	921,536.85	(33,079.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Nov-18	21-May-19	200,000.00	237,249.14	204,118.63	(33,130.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Jul-18	9-Jan-19	200,000.00	238,410.94	205,153.38	(33,257.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	955,747.94	922,028.28	(33,719.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Dec-18	18-Jan-19	900,000.00	956,039.72	922,309.04	(33,730.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	25-Oct-18	16-Apr-19	500,000.00	544,998.73	510,994.68	(34,004.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	956,405.48	922,028.28	(34,377.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	900,000.00	956,405.48	922,028.28	(34,377.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
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
BO0126	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
BO0126	13-Dec-18	11-Jan-19	900,000.00	957,820.89	922,917.09	(34,903.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	25-Jan-19	900,000.00	957,010.28	921,881.90	(35,128.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	900,000.00	957,668.83	922,519.58	(35,149.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	3-Oct-18	1-Apr-19	300,000.00	342,001.67	306,775.91	(35,225.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	957,385.41	921,881.90	(35,503.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-May-18	11-Jan-19	100,000.00	138,193.89	102,568.91	(35,624.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0122	26-Dec-18	24-Jun-19	550,000.00	599,345.72	563,687.50	(35,658.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Jan-19	200,000.00	240,878.71	204,952.88	(35,925.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	11-Jan-19	400,000.00	446,439.81	410,269.05	(36,170.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Dec-18	4-Jan-19	300,000.00	344,158.47	307,809.75	(36,348.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	958,258.51	921,881.90	(36,376.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-Nov-18	30-Jan-19	300,000.00	343,940.07	307,317.96	(36,622.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	242,298.65	204,814.68	(37,483.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	200,000.00	242,298.65	204,814.68	(37,483.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	11-Jun-19	900,000.00	955,373.45	917,778.03	(37,595.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Dec-18	11-Jun-19	900,000.00	955,373.45	917,778.03	(37,595.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	19-Nov-18	17-May-19	200,000.00	242,433.91	204,150.59	(38,283.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	12-Mar-19	500,000.00	550,185.22	511,797.75	(38,387.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Nov-18	6-May-19	200,000.00	243,026.03	204,238.42	(38,787.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	6-Dec-18	6-Mar-19	900,000.00	958,436.65	919,007.36	(39,429.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	3-Oct-18	1-Apr-19	200,000.00	244,186.99	204,517.27	(39,669.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	14-Nov-18	13-May-19	900,000.00	958,942.12	918,821.42	(40,120.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Sep-18	9-Jan-19	200,000.00	245,830.83	205,153.38	(40,677.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Nov-18	15-Nov-19	400,000.00	442,441.37	401,546.73	(40,894.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Nov-18	18-Jan-19	900,000.00	963,724.66	922,332.12	(41,392.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21-Dec-18	22-Jan-19	800,000.00	861,021.39	819,580.69	(41,440.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	8-Nov-18	7-May-19	900,000.00	960,797.59	919,036.96	(41,760.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	9-Oct-18	9-Jan-19	200,000.00	247,334.31	205,158.77	(42,175.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	900,000.00	962,878.08	920,623.83	(42,254.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	900,000.00	963,001.37	920,677.96	(42,323.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	8-Nov-18	6-Feb-19	900,000.00	963,355.81	920,975.05	(42,380.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Aug-18	26-Feb-19	900,000.00	962,197.94	919,717.16	(42,480.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	200,000.00	247,557.85	204,838.77	(42,719.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	14-May-19	900,000.00	961,613.69	918,785.49	(42,828.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22-Nov-18	20-Feb-19	900,000.00	962,930.47	919,991.47	(42,939.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	11-Dec-18	10-Jan-19	400,000.00	453,789.76	410,287.90	(43,501.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Nov-18	14-May-19	600,000.00	656,535.09	612,759.51	(43,775.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	19-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	249,072.01	205,067.04	(44,004.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Oct-18	16-Jan-19	600,000.00	659,090.65	614,979.94	(44,110.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	8-Oct-18	8-Jan-19	500,000.00	558,010.69	512,907.02	(45,103.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	17-Oct-18	16-Jan-19	100,000.00	147,693.09	102,525.53	(45,167.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11-Oct-18	10-Jan-19	100,000.00	147,815.76	102,571.98	(45,243.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Sep-18	5-Mar-19	200,000.00	250,403.39	204,807.37	(45,596.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	13-Jul-18	9-Jan-19	600,000.00	661,534.24	615,357.45	(46,176.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Oct-18	30-Jan-19	800,000.00	865,310.65	819,081.45	(46,229.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Sep-18	18-Mar-19	100,000.00	148,669.52	102,337.53	(46,331.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Nov-18	25-Jan-19	100,000.00	149,210.07	102,472.87	(46,737.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	8-Oct-18	8-Jan-19	200,000.00	252,486.79	205,167.60	(47,319.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	8-Nov-18	7-May-19	100,000.00	149,935.02	102,115.22	(47,819.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	1-Aug-18	29-Jan-19	200,000.00	252,969.64	204,898.92	(48,070.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jul-18	15-Jan-19	400,000.00	458,349.34	410,134.08	(48,215.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	8-Aug-18	1-Aug-19	100,000.00	149,696.52	101,131.34	(48,565.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Nov-18	5-Feb-19	100,000.00	152,808.66	102,437.63	(50,371.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	2-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	256,449.95	205,201.71	(51,248.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Nov-18	26-Feb-19	800,000.00	868,762.29	817,460.86	(51,301.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Jul-18	22-Jan-19	900,000.00	973,621.16	922,084.75	(51,536.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	19-Dec-18	18-Jan-19	500,000.00	565,678.63	512,556.34	(53,122.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	2-Jul-18	2-Jul-19	500,000.00	563,098.39	508,006.11	(55,092.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Jun-18	26-Jun-19	500,000.00	565,442.47	509,576.27	(55,866.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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	14-Dec-18	12-Jun-19	980,000.00	1,009,369.42	952,186.58	(57,182.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	23-Oct-18	18-Oct-19	200,000.00	261,299.75	201,501.79	(59,797.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	5-Jan-18	4-Jan-19	400,000.00	470,730.77	410,405.81	(60,324.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Nov-18	21-Nov-19	900,000.00	958,991.46	897,245.18	(61,746.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	12-Feb-19	900,000.00	865,026.76	865,026.76	55,526.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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	3,200,000.00	3,296,231.66	3,272,864.93	(23,366.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Sep-18	13-Mar-19	800,000.00	853,675.42	816,457.87	(37,217.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	5-Feb-19	100,000.00	152,067.70	102,442.78	(49,624.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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
BO0621	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0621	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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
BO0126	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
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	(45,127,441.38)		

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de Mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociacion
BO0521	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	(811,345.00)		

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			-	-	-	-		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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	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)		

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
BO0327	31-Aug-18	25-Jan-19	9,000.00	9,948.41	9,628.09	(320)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0125	24-Aug-18	16-Jan-19	12,000.00	10,942.42	11,916.75	974	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0327	4-Sep-18	20-Feb-19	871,000.00	996,164.56	930,660.30	(65,504)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0521	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
BO0126	5-Jan-18	4-Jan-19	400,000.00	491,467.76	498,749.41	7,281.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	2-Jul-18	2-Jul-19	500,000.00	588,274.76	600,127.08	11,852.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Jul-18	28-Jun-19	200,000.00	242,629.93	247,793.69	5,163.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Jul-18	4-Jan-19	400,000.00	489,559.16	491,066.75	1,507.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Jul-18	4-Jan-19	500,000.00	512,891.91	514,471.35	1,579.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	10-Jul-18	8-Jan-19	500,000.00	491,987.30	492,013.20	25.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10-Jul-18	8-Jan-19	400,000.00	517,925.82	517,953.09	27.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Jul-18	11-Jan-19	300,000.00	355,832.49	351,117.32	4,715.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	18-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	258,910.38	255,522.34	3,388.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jul-18	15-Jan-19	400,000.00	458,468.52	453,624.28	4,844.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Jul-18	15-Jan-19	200,000.00	249,131.60	246,499.24	2,632.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	23-Jul-18	18-Jan-19	700,000.00	739,838.30	731,466.00	8,372.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	26-Jul-18	22-Jan-19	900,000.00	975,766.37	978,312.07	2,545.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Jul-18	23-Jan-19	500,000.00	536,397.41	537,871.81	1,474.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	3-Aug-18	30-Jan-19	500,000.00	484,123.13	486,895.18	- 2,772.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Aug-18	31-Jan-19	300,000.00	322,820.63	323,735.33	- 914.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	9-Aug-18	5-Feb-19	400,000.00	358,675.05	361,818.60	- 3,143.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	200,000.00	249,226.34	250,976.46	- 1,750.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	700,000.00	728,051.63	733,018.23	- 4,966.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Aug-18	11-Feb-19	600,000.00	637,328.00	641,292.77	- 3,964.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	20-Aug-18	15-Feb-19	600,000.00	573,997.52	577,900.12	- 3,902.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	22-Aug-18	18-Feb-19	500,000.00	483,597.78	487,095.27	- 3,497.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	23-Aug-18	19-Feb-19	500,000.00	483,613.63	488,346.79	- 4,733.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	29-Aug-18	25-Feb-19	800,000.00	830,572.57	836,586.17	- 6,013.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30-Aug-18	26-Feb-19	900,000.00	973,728.42	983,263.56	- 9,535.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	4-Sep-18	8-Jan-19	800,000.00	862,631.47	866,291.46	- 3,659.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	5-Sep-18	5-Mar-19	200,000.00	253,382.84	255,691.00	- 2,308.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	6-Sep-18	5-Mar-19	500,000.00	538,197.59	542,992.32	- 4,794.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	7-Sep-18	6-Mar-19	500,000.00	539,707.08	544,598.85	- 4,891.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	10-Sep-18	8-Mar-19	900,000.00	931,018.80	938,812.96	- 7,794.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	14-Sep-18	13-Mar-19	400,000.00	388,113.69	392,285.71	- 4,172.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	17-Sep-18	14-Mar-19	200,000.00	169,253.98	171,133.58	- 1,879.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17-Sep-18	12-Sep-19	500,000.00	486,441.28	485,314.72	1,126.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18-Sep-18	18-Mar-19	400,000.00	446,117.08	444,802.19	1,314.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	28-Sep-18	27-Mar-19	700,000.00	730,429.17	739,419.94	- 8,990.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	3-Oct-18	2-Apr-19	300,000.00	270,612.86	274,193.74	-3,580.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	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
BO0126	5-Oct-18	4-Jan-19	500,000.00	539,516.32	540,854.21	-1,337.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	8-Oct-18	8-Jan-19	200,000.00	263,093.64	263,841.40	- 747.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	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
BO0126	8-Oct-18	3-Oct-19	400,000.00	409,191.81	420,784.21	-11,592.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	9-Oct-18	9-Jan-19	200,000.00	258,000.75	258,770.28	- 769.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	12-Oct-18	11-Oct-19	500,000.00	522,741.98	537,979.62	-15,237.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Oct-18	15-Apr-19	700,000.00	679,883.14	687,857.16	- 7,974.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	19-Oct-18	17-Apr-19	500,000.00	518,013.50	524,240.92	-6,227.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Oct-18	24-Apr-19	300,000.00	265,726.39	269,193.33	- 3,466.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26-Oct-18	24-Apr-19	500,000.00	485,630.41	493,041.04	- 7,410.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	1-Nov-18	31-Jan-19	500,000.00	479,412.17	481,823.00	- 2,410.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	6-Nov-18	4-Feb-19	600,000.00	639,966.73	643,299.81	-3,333.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	6-Nov-18	3-May-19	500,000.00	498,034.49	504,687.82	-6,653.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	12-Nov-18	12-Feb-19	400,000.00	369,461.98	372,183.97	-2,721.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	521,329.85	524,468.67	-3,138.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	500,000.00	497,207.48	500,400.11	-3,192.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	11-Feb-19	600,000.00	586,757.07	590,524.71	-3,767.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13-Nov-18	13-May-19	900,000.00	977,986.50	993,067.13	-15,080.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15-Nov-18	14-May-19	600,000.00	677,987.14	689,770.09	-11,782.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Nov-18	15-Jan-19	700,000.00	743,682.30	746,080.87	-2,398.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	16-Nov-18	15-May-19	300,000.00	291,683.43	296,090.28	-4,406.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19-Nov-18	16-May-19	1,900,000.00	2,054,634.65	2,055,518.20	-30,883.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	20-Nov-18	18-Jan-19	1,000,000.00	968,079.45	971,802.35	-3,722.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	23-Nov-18	4-Jan-19	200,000.00	229,499.93	230,023.20	-523.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	961,208.17	964,502.40	-3,294.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23-Nov-18	22-Mar-19	6,000,000.00	6,214,940.78	6,214,937.97	-72,097.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	26-Nov-18	28-Jun-19	500,000.00	506,620.12	512,332.65	-5,712.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27-Nov-18	22-Jan-19	700,000.00	722,981.40	726,166.91	-3,185.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Jan-19	200,000.00	241,534.19	242,458.41	-924.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	27-Nov-18	25-Feb-19	300,000.00	303,760.92	305,899.45	-2,138.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28-Nov-18	26-Feb-19	600,000.00	570,677.16	574,777.00	-4,099.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	25-Jan-19	900,000.00	960,335.07	964,009.77	-3,674.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29-Nov-18	28-Feb-19	500,000.00	492,393.86	496,171.63	-3,777.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	30-Nov-18	29-May-19	300,000.00	262,776.52	267,017.16	-4,240.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	- 4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	- 4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	7-Dec-18	5-Feb-19	1,000,000.00	979,333.99	983,989.11	- 4,655.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	11-Dec-18	8-Feb-19	700,000.00	703,327.84	706,133.84	- 2,806.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	11-Dec-18	11-Mar-19	500,000.00	475,898.47	480,103.24	-4,204.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	15-Jan-19	500,000.00	518,357.96	519,512.56	-1,154.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	25-Jan-19	900,000.00	959,959.94	962,866.89	- 2,906.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	14-Dec-18	14-Mar-19	600,000.00	626,273.97	631,596.19	-5,322.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	600,000.00	593,391.57	593,145.65	-1,754.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 negociacion
BO0126	17-Dec-18	16-Jan-19	500,000.00	526,786.33	528,033.49	-1,247.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	17-Dec-18	18-Mar-19	500,000.00	538,187.86	543,093.61	-4,905.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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	106,651.51	106,685.43	-2,033.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	20-Dec-18	20-Mar-19	500,000.00	502,190.99	507,426.66	-5,235.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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
BO0126	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

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

8. Contratos de compra de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

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

b) Acciones Cuenta 6.1.5

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

c) Divisas Cuenta 6.1.3

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

e) Oro Cuenta 6.1.4

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

9. Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

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

b) Acciones Cuenta 6.1.5

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADOS DE CARTERA DE INVERSIÓN

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

c) Divisas Cuenta 6.1.3

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

e) Oro Cuenta 6.1.4

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

10. Inversiones en otras obligaciones DOP

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

11. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda DOP

Codigo ISIN	Títulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
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				

a) Títulos Valores de Deuda USD

Nota: Tasa al cierre de mes

50.2762

Codigo ISIN	Títulos valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
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

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

b) Acciones

Codigo ISIN	Acciones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participacion
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) Inversiones en otras obligaciones

Codigo ISIN	Otras Inversiones	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo Centralizado de Negociacion	Porcentaje de participacion
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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO II - ESTADOS DE CARTERA EN CUSTODIA

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADO DE CARTERA EN CUSTODIA

A continuación presentamos los estados de cartera en custodia de la Compañía al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018.

30 de junio de 2019						
Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado	Moneda de Denominación
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	761	774	1909	4,897,864,405	185,821,560	DOP
Personas Jurídicas DOP	31	77	177	1,767,550,944	54,644,272	DOP
Clientes Profesionales DOP	34	52	103	10,640,239,755	351,343,449	DOP
Personas Físicas USD	144	-	-	10,408,630	149,046	USD
Personas Jurídicas USD	9	-	-	2,027,286	31,547	USD
Clientes Profesionales USD	12	-	-	6,418,091	79,276	USD
Total Clientes	826	903	2,189	17,305,655,104	591,809,280	DOP
Total USD	162	-	-	18,854,007	259,870	USD

31 de diciembre de 2018						
Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado	Moneda de Denominación
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	2,511	1,199	1,312	4,676,019,792	194,433,945	DOP
Personas Físicas USD	231	103	128	1,152,625,240	29,338,201	DOP
Personas Jurídicas DOP	127	74	53	8,711,062,328	302,220,718	DOP
Personas Jurídicas USD	155	-	-	19,662,785	199,252	USD
Clientes Profesionales DOP	14	-	-	12,961,484	159,340	USD
Clientes Profesionales USD	13	-	-	25,523,261	277,730	USD
Total Clientes	2,869	1,376	1,493	14,539,707,360	525,992,864	DOP
Total USD	182	-	-	58,147,530	636,322	USD

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO III - ESTADOS DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

30 de junio de 2019 y 30 de junio de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADOS DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

A continuación presentamos los estados de otros resultados integrales, comprendidos durante los periodos terminados al 30 de junio de 2019 y 30 de junio de 2018.

	<u>Notas</u>	<u>Junio 2019</u>	<u>Junio 2018</u>
Utilidad neta		337,313,312	500,007,215
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		337,313,312	500,007,215

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO IV - TABLAS DE RIESGO DE LIQUIDEZ

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018.

Al 30 de junio de 2019

	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	121,946,349.73	-	-	-	-	-	-	-	121,946,349.73	121,946,350
Instrumento Financiero de Cartera Propia Disponible	2,567,186,698.00	-	-	-	-	-	330,833,264.83	3,180,497,969.70	6,078,517,932.53	2,567,186,698
Inversiones a Costo Amortizado	-	-	-	-	-	-	-	914,392,212.99	914,392,212.99	0
Instrumento Financiero de Cartera Propia Comprometida	-	-	-	-	-	-	-	3,362,102,510.96	3,362,102,510.96	0
Contratos Derivados	3,416,886.00	20,059,716.23	13,407,796.10	5,230,861.28	23,034,566.38	185,206.70	112,700.83	-	65,447,733.52	36,884,398
Impuestos por Cobrar	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0
Impuestos Diferidos	-	-	-	-	-	-	35,988,543.39	-	35,988,543.39	0
Activos Intangibles	-	-	-	-	-	-	-	1,696,775.98	1,696,775.98	0
Otras Cuentas por Cobrar	-	-	65,405,950.74	-	-	-	216,759,122.87	1,000,000.00	283,165,073.61	65,405,951
Inversiones en Sociedades	-	-	-	-	-	-	-	118,279,510.49	118,279,510.49	0
Propiedades de Planta y Equipo	-	-	-	-	-	-	-	5,721,235.79	5,721,235.79	0
Otros Activos			1,879,174.00				488,988.00	67,399,076.00	69,767,238.00	1,879,174
Total de Activos	2,692,549,933.73	20,059,716.23	80,692,920.84	5,230,861.28	23,034,566.38	185,206.70	584,182,619.93	7,651,089,291.91	11,057,025,118.91	2,793,302,571
Pasivos Financieros a Valor Razonable	350,091,957.41	712,317,553.67	1,270,140,984.62	647,425,592.81	367,047,604.45	517,099,053.00	503,673,094.02	-	4,367,795,839.98	2,332,550,496
Instrumentos Financieros Derivados	33,001,186.72	62,944,207.13	106,444,472.94	48,252,277.40	79,322,455.90	2,035,309.63	9,149,960.91	-	341,149,870.61	202,389,867
Operaciones de Financiamientos	-	-	-	-	-	14,549,041.10	200,000,000.00	1,000,000,000.00	1,214,549,041.10	0
Obligaciones con Instituciones de Intermediación Financiera			5,736,394.43		-			2,804,063,850.00	2,809,800,244.43	5,736,394
Cuentas por Pagar Relacionadas	-	-	1,259,410.00	-	-	-	-	-	1,259,410.00	1,259,410
Otras Cuentas por Pagar	6,004,492.00	-	10,107,193.00						16,111,685.00	16,111,685
Otros Pasivos	400,000.00		329,740.00			2,885,644.02		61,195,863.78	64,811,247.80	729,740
Impuestos por Pagar			2,218,287.17				-		2,218,287.17	2,218,287
Total Pasivos	389,497,636.12	775,261,760.80	1,396,236,482.15	695,677,870.21	446,370,060.35	536,569,047.74	712,823,054.93	3,865,259,713.78	8,817,695,626.29	2,560,995,879
Flujo de caja estático	2,303,052,297.61	(755,202,044.57)	(1,315,543,561.32)	(690,447,008.94)	(423,335,493.97)	(536,383,841.04)	(128,640,435.00)	3,785,829,578.13	2,239,329,492.62	232,306,692
Flujo de caja acumulado	2,303,052,297.61	1,547,850,253.04	232,306,691.73	(458,140,317.21)	(881,475,811.18)	(1,417,859,652.22)	(1,546,500,087.22)	2,239,329,490.91		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO IV - TABLAS DE RIESGO DE LIQUIDEZ

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V – OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Otras Notas Informativas

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

Deudores por intermediación

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la Compañía no mantenía saldos en las cuentas de deudores por intermediación.

Cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la compañía no mantenía cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia.

Propiedad de Inversión

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la Compañía no mantenía cuenta por pagar a acreedores por intermediación.

Cuentas por pagar por operaciones de cartera propia

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 2018, la Compañía no mantenía saldo en la cuenta por pagar por operaciones de cartera propia.

Otras revelaciones importantes

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

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

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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 la Superintendencia de Valores de la República Dominicana.

Estados financieros ajustados por inflación

Al 30 de junio de 2019 y 31 de diciembre de 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.