

Memoria 2017 —



Alpha[□]
Inversiones

Nuestra naturaleza nos define, es el origen de lo que nos hace diferente, es lo que orienta nuestro esfuerzo para seguir liderando el mercado de valores.



Alpha[□]
Inversiones

Contenido

Presentación

Palabras del presidente 06

Alpha Inversiones

Perfil de la empresa 08

Valores 10

Propósito y pilares 12

Consejo de administración 14

Principales Ejecutivos 16

Corredores de Valores 17

Informe de Gestión

En Alpha evolucionamos 19

Hitos 2017 22

Responsabilidad Social 24

Estructura de Gobierno 30

Comités de apoyo, composición y funciones.

Trayectoria y base de confianza

Comité de auditoría – comité de cumplimiento – comité de riesgos

Gobierno corporativo 33

Estructura administrativa

Organigrama

Reglamentos y normativas internas

de gobierno corporativo 36

Indicadores de desempeño 38

Estados Financieros 42

Carta del Comisario de Cuentas

Informe de los Auditores Independientes

Balance General Resumido – Base Regulada

Estado de Resultado Resumido – Base Regulada

Presentación

Patrimonio

DOP 1,986,041,564

Total de activos

DOP 9,247,536,907



Alpha⁺
Inversiones





Palabras del presidente

Durante el año 2017, el mercado interno se encontró con una coyuntura económica cambiante que exigió gran dinamismo y dotes de adaptación por parte de los participantes. Un primer semestre de desaceleración económica exigió medidas agresivas de expansión monetaria por parte del Banco Central y de gasto por parte del gobierno dominicano. El resultado fue un repunte en la actividad económica en el tercer y cuarto trimestre del año y un descenso importante en las tasas de interés. El tipo de cambio permaneció dentro de las previsiones de devaluación de los últimos años.

En este entorno tan variable, los excelentes resultados cosechados por Alpha Inversiones ponen de manifiesto la solidez del modelo de gestión de Alpha y la vigencia de nuestros valores. Alpha Inversiones finalizó el 2017 con los mejores resultados de su historia.

Nuestros esfuerzos apuntan a seguir operando de forma eficiente y flexible en el mercado, atentos a cada aspecto que pueda cambiar la coyuntura económica y la rentabilidad de los portafolios, para de esa manera poder ofrecer el mejor asesoramiento a nuestros clientes, estableciendo relaciones de largo plazo. En 2017, la confianza depositada por nuestros clientes en activos financieros custodiados en CEVALDOM creció un 29% hasta los DOP 21,558MM. El volumen de operaciones creció un 55% y el índice de satisfacción de clientes se mantiene por encima del 90%.

Desde el punto de vista regulatorio, en 2017 se aprobaron dos importantes textos legislativos que implican nuevos retos en nuestra actividad principal: la ley 155/17 y la ley 249/17. La implementación de la primera sin mayores sobresaltos y con gran respuesta por parte de nuestros clientes confirman el buen hacer de los departamentos de venta, servicio al cliente y cumplimiento.

A portrait of Juan Manuel Barranco, a middle-aged man with thinning brown hair, smiling slightly. He is wearing a dark blue suit jacket over a white collared shirt. The background is a blurred office environment with bright lights. On the far left, there is a vertical decorative element with a dark blue, starry pattern.

Juan Manuel Barranco

Presidente del consejo
de administración

La promulgación de la nueva Ley de Valores en diciembre abre nuevos retos en el mercado de valores local para los que Alpha parte en una situación de claro liderazgo.

El mercado evolucionó y con él nosotros también evolucionamos. Desarrollamos una nueva imagen de marca de donde pasamos de una imagen rígida a una imagen más flexible, de ser Alpha Sociedad de Valores a Alpha Inversiones. Todo esto fue el resultado de la evolución interna de la compañía, ahora más enfocados en nuestros clientes, asesorándoles en sus decisiones y desarrollando relaciones a largo plazo.

Los buenos resultados de este año, en un contexto dinámico, son el producto del trabajo serio y dedicado de quienes trabajan en nuestra compañía en todos sus niveles. Durante 2017 incorporamos 7 nuevos miembros a nuestra familia. Gracias a todos, colaboradores y directores, por su trabajo responsable y felicidades por los éxitos alcanzados este año.

El trabajo continúa y requiere el mismo compromiso y esfuerzo de superación, manteniendo los valores que nos han dado el liderazgo del mercado. Una empresa centrado en nuestros clientes, humilde, dinámica, innovadora y preocupada del entorno donde operamos. Una empresa de la que nos sentimos orgullosos de pertenecer. Una empresa que genera confianza colocando a nuestros clientes en el centro de nuestra gestión, invirtiendo hoy en la construcción de un mejor futuro.

Agradecemos a nuestros clientes y relacionados la confianza que depositan en nosotros.

Alpha Inversiones

¿Qué hacemos en Alpha?

Nos dedicamos a actividades de intermediación de valores, donde nuestro objetivo principal es el asesoramiento a inversionistas en la gestión de sus activos. Nuestra promesa es ofrecerte el mejor camino para canalizar tus ahorros y tu patrimonio, ayudándote a construir un mejor futuro.

Esta es la razón por la cual miles de personas, instituciones y empresas nos han convertido en el Puesto de Bolsa de referencia de República Dominicana.

Alpha es una empresa de servicios de intermediación financiera, posicionada como un referente destacado en el Mercado de Valores de la República Dominicana.

Actualmente es el Puesto de Bolsa de mayor impulso en el país cerrando el 2017 con el mayor patrimonio, entre los tres primeros en activos y resultado neto. Calificada por Feller Rate como grado de inversión BBB+ con perspectivas positivas que reflejan los avances en la estrategia y el buen desempeño financiero.

Alpha continúa consolidando su compromiso con la construcción de confianza y solidez de su operación. Registrados en la Superintendencia de Valores de la República Dominicana bajo el No. SIVPB-018 desde el año 2009 y miembros de la Bolsa de Valores de la República Dominicana, inscrito bajo el No. PB-1019.

¿Qué ofrecemos?

Buscamos siempre brindarte un trato personalizado, ofreciéndote los productos y servicios que más se ajustan a tus metas.

La fortaleza y solidez de nuestro grupo de accionistas respalda nuestro día a día y nuestra trayectoria. La experiencia de nuestros colaboradores en instituciones financieras de alto nivel, tanto nacionales como internacionales, sumados a procesos eficientes, nos permite sustentar una experiencia positiva en nuestros clientes.

Como asesores nos esforzamos en construir un vínculo sólido de confianza, buscando siempre la mejor relación riesgo - rentabilidad. Identificando las mejores oportunidades del mercado para brindarte propuestas oportunas, rentables e innovadoras.



Valores

Pasión y Orgullo

Nos sentimos orgullosos del motor que nos mueve, la confianza, esa energía que hace que los desafíos más grandes sean posibles.

Meritocracia

Somos reconocidos por nuestro talento y nos comprometemos con resultados sobresalientes.

Profesionalismo

Desarrollamos relaciones de largo plazo, transitando siempre el camino de la excelencia.

Trabajo en Equipo

Los grandes objetivos necesitan de grandes equipos. Creemos en el trabajo en equipo de alto desempeño, tanto como en nosotros mismos.



Propósito y Pilares

Lideramos de forma eficiente la evolución del mercado de valores colaborando con la construcción de una sociedad más sustentable.

Liderazgo

Guiar el desarrollo del mercado de valores.

Eficiencia

Ser rentables y comprometidos con la mejora continua de nuestros procesos.



Evolución

Impulsar el desarrollo del mercado de valores de República Dominicana a través de la promoción de las mejores prácticas de nivel internacional.

Sustentabilidad

Impactar el desarrollo social, económico y medioambiental a través de nuestro proceso operativo y nuestro sistema de valores.

Consejo de administración

Apoyando la visión estratégica y metas a largo plazo del grupo, se realizó una reestructuración del Consejo de Administración. Como resultado nuestro Consejo de Administración está compuesto de la siguiente forma:

Juan Manuel Barranco Simó
Presidente

Rosa M. Cortorreal Disla
Vicepresidente

Santiago Camarena Torres
Secretario

Giselle M. Infante Martínez
Miembro

Alberto A. Álvarez Whipple
Miembro Independiente



Directores



Juan Manuel Barranco

Licenciado en Derecho de Empresa de la Universidad de Valencia, España y MBA por ESADE, Barcelona, España. Se especializó en Mercado de Capitales en Penn State University, Estados Unidos. Cuenta con más de veinte años de experiencia en las áreas de dirección estratégica, mercados financieros y banca de inversión en San Francisco, Nueva York y Londres.



Santiago Camarena

Licenciatura en Administración de Empresas y postgrado en Finanzas Corporativas de la Pontificia Universidad Católica Madre y Maestra, Máster en Comercio Exterior y Finanzas Internacionales en la Universidad de Barcelona, España. Se desempeñó como Gerente de Administración de Tesorería en el Complejo Metalúrgico Dominicano (METALDOM).

Principales Ejecutivos

Santiago Adolfo Camarena Torres
Vicepresidente Ejecutivo

Claudia Marcela Pinto Rodríguez
Gerente General de Operaciones

Benton Hamlet Peña Pimentel
Gerente de Tecnología

Frandia Berenice Marte Abreu
Gerente de Tesorería

Esther Marie Toral García
Suplente de Oficial de Cumplimiento

Carolyn Pichardo Molina
Gerente de Operaciones

Laura Cristina Herrera Gómez
Gerente de Reclutamiento,
Selección y Servicios al Personal

Juan Manuel Barranco Simó
Vicepresidente de Finanzas

Elizabeth Severino Hernández
Gerente de Contabilidad

Michelle Marie García Movellán
Gerente de Negocios

Luis Rafael García Albizu
Oficial de Cumplimiento

Laura Patricia del Villar Senior
Auditora Interna

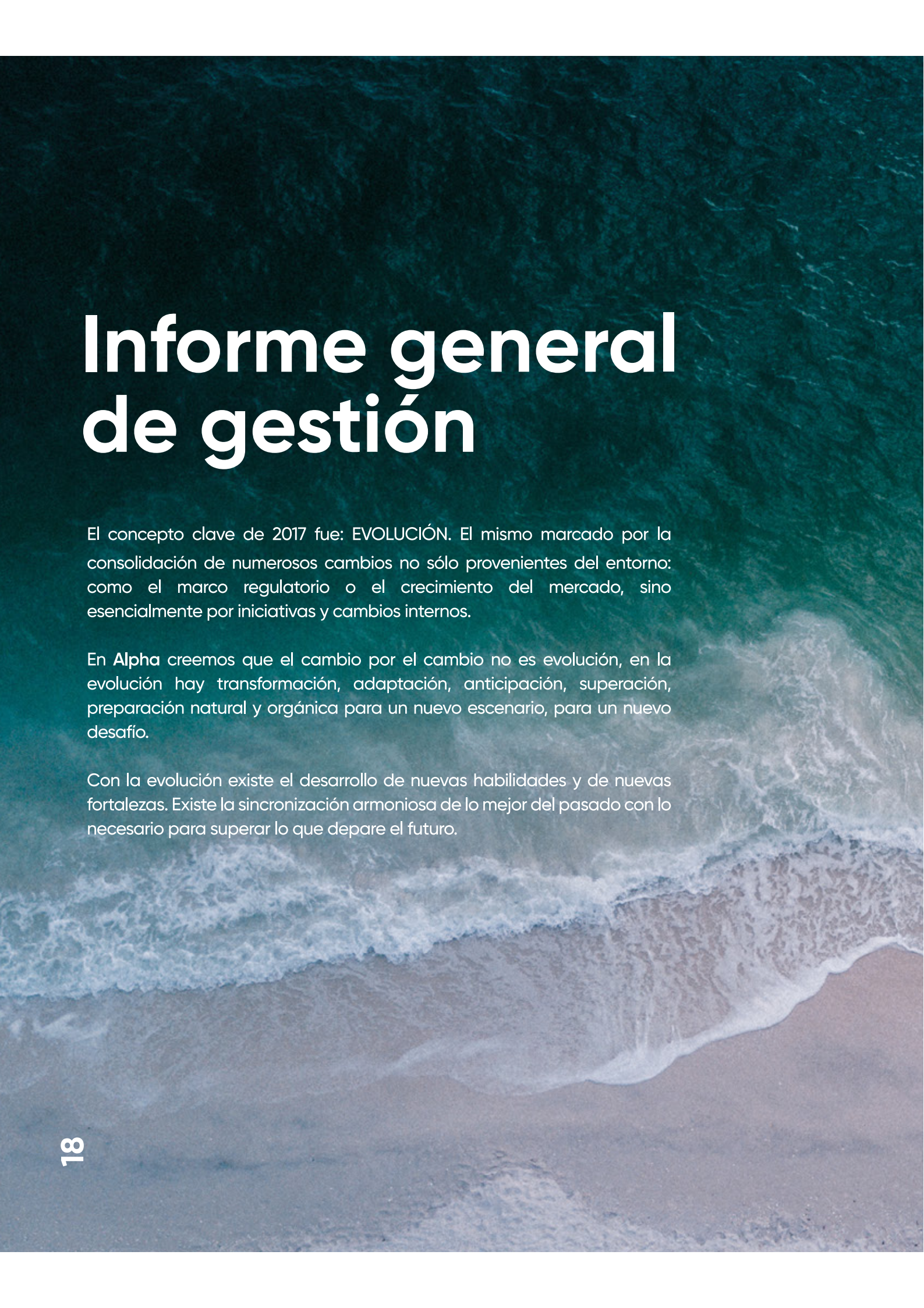
Sarah Carolina Mencía Mieses
Gerente de Riesgos

Nelly Sahily Ramírez de los Santos
Gerente de Recursos Humanos
Gestión de Talento.



Corredores de Valores

Laura Núñez
Massiel Taveras
Michelle García
Ruth Méndez
Fernando León
Gian Paulino
Laura González

The background of the page is an aerial photograph of a beach. The top half shows the dark, textured surface of the ocean with small waves. The bottom half shows the white foam of a wave washing onto a sandy beach. The transition between the water and the sand is a wavy, irregular line.

Informe general de gestión

El concepto clave de 2017 fue: EVOLUCIÓN. El mismo marcado por la consolidación de numerosos cambios no sólo provenientes del entorno: como el marco regulatorio o el crecimiento del mercado, sino esencialmente por iniciativas y cambios internos.

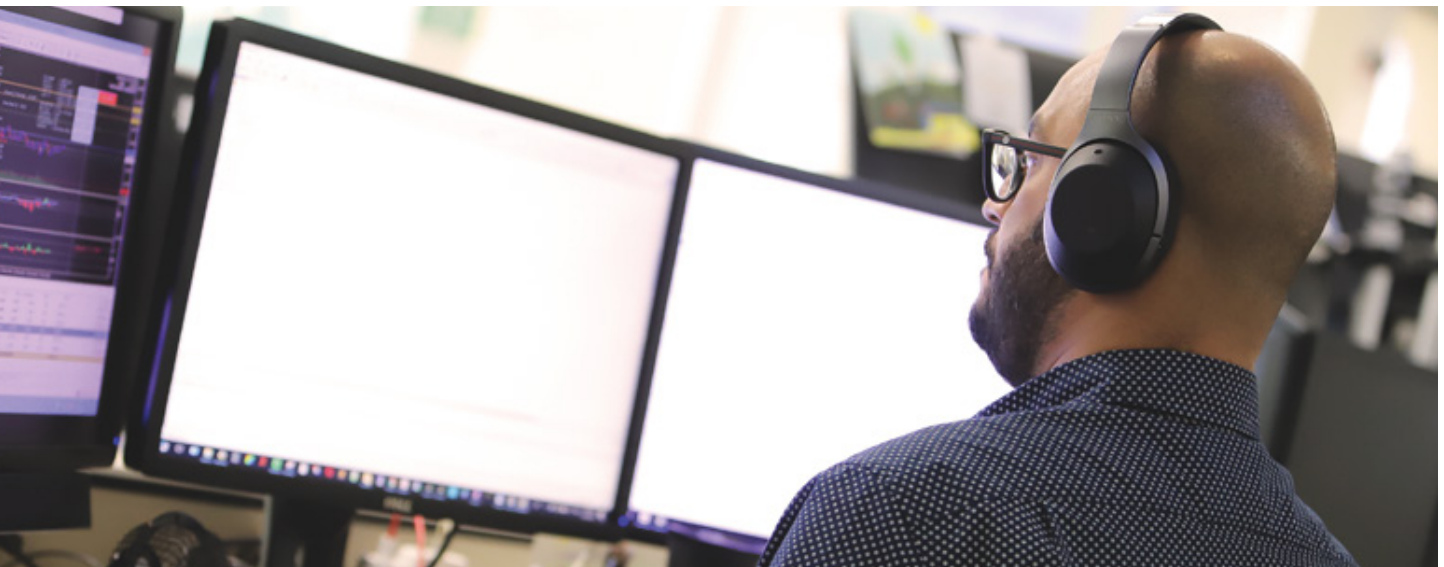
En Alpha creemos que el cambio por el cambio no es evolución, en la evolución hay transformación, adaptación, anticipación, superación, preparación natural y orgánica para un nuevo escenario, para un nuevo desafío.

Con la evolución existe el desarrollo de nuevas habilidades y de nuevas fortalezas. Existe la sincronización armoniosa de lo mejor del pasado con lo necesario para superar lo que depara el futuro.

En Alpha, evolucionamos

Nacimos y nos desarrollamos en un entorno que ha experimentado cambios fundamentales, un mundo de unos pocos, de preparados, de expertos, a uno muy diferente.

Con nuestras capacidades para destacarnos siendo:
innovadores, vanguardistas, dinámicos, e inconformistas con el status quo.





Como un organismo vivo, fuimos mutando,
mejorando, nos conectamos cada vez más
con el resto del ecosistema, nos fortalecimos
y evolucionamos:

De 3,000 a 26,012 operaciones en 2017.

De 5 a más de 50 colaboradores en 2017.

De un par de cientos a 2,448 clientes al cierre 2017.

De 700 a más de 29,434,000,000 de pesos
operados mensualmente en 2017.

De 100 a 1,986 millones de pesos
en patrimonio a finales 2017.

De 3,000 millones a 9,247,536,907 de pesos
en activos. al cierre 2017.

Del nosotros, al ellos.

Del usted, a ti.

De indicar, al guiar, educar, acompañar.

De la responsabilidad del negocio, al negocio responsable.

De las finanzas, al valor de la confianza.

De participante, a líder del mercado.



El entorno ha cambiado
con nosotros:

De unos pocos a más de 76,000
cuentas en 2017

De 8 a 20 puestos de bolsas

De la renta fija a los fideicomisos de
oferta pública y fondos de inversión

De sólo para expertos, a soluciones
para diferentes segmentos.

y seguirá cambiando,
el futuro que vendrá:

Fintech

Más acceso

Mejor información

Nuevos productos

Desarrollo de renta variable

Nuevos jugadores, privados a
públicos

y más.

En Alpha evolucionamos y seguimos
preparándonos para continuar
liderando el futuro que se avecina:
ahora somos

Alpha[□]
Inversiones

Quisiéramos compartir los hitos más importantes de nuestro 2017:

- En los reportes trimestrales de 2017, la calificador Feller Rate ratificó la calificación BBB+, consolidando el nivel grado de inversión del Puesto de Bolsa, fundamentado en el buen posicionamiento de mercado alcanzado, beneficiada por el respaldo de sus accionistas y prestigio del grupo, así como en márgenes y retornos por sobre el promedio de la industria.
- El 27 de abril de 2017 se colocó la quinta emisión correspondiente al Programa de Emisiones SIVEM-098 de Bonos Corporativos Alpha por un monto total de RD\$200,000,000.00.
- Por segundo año consecutivo y comprometidos con nuestros valores y nuestro interés por desarrollar nuestro máximo potencial, transitamos por el proceso de certificación de GREAT PLACE TO WORK, logrando calificar entre las 11 mejores empresas para trabajar del Caribe y entre las 10 mejores de República Dominicana, siendo además reconocidos como una de las mejores empresas para trabajar en la República Dominicana por el ranking de Revista Mercado.
- **Alpha** sostuvo su liderazgo en el valor de los activos bajo gestión (valor de los activos totales) al 31 de diciembre de 2017, alcanzando RD\$9,247,536,907, representando un crecimiento del 42,5% respecto del año anterior y el 15% del total de activos del sector. Esta posición de referencia en el sector se complementa con el puesto número 1 en patrimonio, con un total de RD\$1,986,041,564 lo que representó un incremento del 20% respecto del año anterior y el 16% sobre el patrimonio total del sector.





- En este mismo sentido, **ALPHA** al cierre del 2017 obtuvo un resultado neto ascendente a RD\$580,949,151, lo cual reflejó un incremento 116% con respecto al año anterior.
- La cartera de cuentas de la empresa aumentó un 22% respecto al año anterior, continuando una historia de crecimiento sostenido, llegando a diciembre 2017 a 2,448 cuentas de corretaje comparado con 2,006 al cierre del 2016.
- El Puesto de Bolsa demostró una mejora sustancial en su capacidad operativa y transaccional, completando 26,012 operaciones en 2017 vs 16,827 operaciones en el 2016, lo cual representa un aumento del 55% respecto al año anterior.
- La participación de mercado del Puesto de Bolsa, medida en base al volumen de compra y venta respecto al volumen total del mercado (tanto bursátil como extrabursátil), alcanzó un promedio mensual durante el 2017 de 15.7%, lo que refleja un favorable desempeño.



Responsabilidad Social

Tal como lo establece nuestro propósito, para **Alpha** es esencial desempeñarse como líder empresarial dentro de un accionar responsable y que impulse la sostenibilidad. Es nuestro interés promover el desarrollo de una sociedad sustentable dejando huella positiva en lo social, económico y medioambiental de la realidad dominicana.

La estrategia de responsabilidad social empresarial se centra en 3 pilares:

Social

Promovemos y participamos activamente en el desarrollo de actividades orientadas a la erradicación y lucha contra la pobreza y el fomento de la educación como herramienta de cambio social.

Económico

Contribuimos al desarrollo de proyectos innovadores que promuevan el espíritu emprendedor como motor de un cambio concreto en la sociedad actual.

Medioambiental

Trabajamos con objetivos de reducción y mejor aprovechamiento de los recursos, tanto dentro del espacio de trabajo como fuera, apoyando iniciativas de reciclaje, limpieza de costas y reforestación.

Durante el 2017, contando con el apoyo de nuestro Comité de Responsabilidad Social, continuamos impulsando iniciativas en las que se involucraron nuestros colaboradores como voluntarios, realizando actividades alineadas a nuestros pilares. Participamos en varias actividades comunitarias de **TECHO** y realizamos actividades conjunto al **CEDAF** como fueron: limpieza de costas, jornada de reforestación y la hora del planeta.

Nuestro programa Vecino Verde, creado en el 2014, es una iniciativa conjunta con **Sostenibilidad 3RS** y el **CEDAF**, la cual busca disminuir el impacto ambiental generado por los residuos sólidos, promoviendo el reciclaje en condominios, hogares e instituciones en sectores del Polígono Central.

La realidad actual de nuestro país es que solo se reusa y recicla un porcentaje muy bajo, ocasionando un deterioro ambiental cada vez mayor. Con este programa queremos sensibilizar y contribuir a crear conciencia sobre la problemática cada vez más crítica de los desechos sólidos.

Para el cierre del 2017 se recolectaron más de
88,726 kg de papel y cartón, 7,392 Kg de plástico
lo que se traduce en un impacto ambiental de:

1,057

árboles salvados

1,995,840

litros de agua

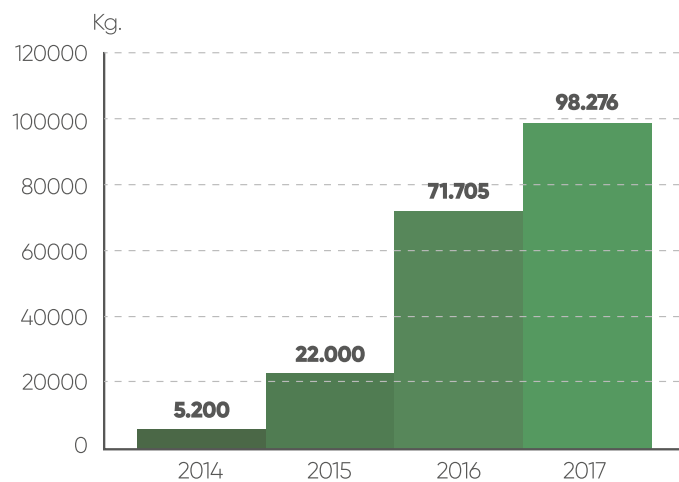
287,700

KW/hr de energía



Cabe destacar que Vecino Verde alcanzó un incremento de **26,571 kilogramos** de residuos gestionados respecto al 2016.

En la gráfica que mostramos debajo podemos observar la evolución mantenida desde el año 2014 a la fecha.



Volumen reciclado en kilogramo.







Concurso de artículos reciclados por nuestros colaboradores



Estructura de gobierno

Trayectoria y base de confianza

A través de la experiencia de nuestros directores en diferentes ámbitos del mercado local, hemos cosechado logros y reconocimientos durante más de una década. Esto nos permite avanzar dentro de una trayectoria de liderazgo empresarial, que es impulsada por nuestra pasión por ofrecer a nuestros clientes propuestas pertinentes, rentables e innovadoras

Comités de apoyo, composición y funciones

Como soporte a la gestión desarrollada por el Consejo de Administración del Puesto de Bolsa, se han creado y organizado diferentes comités que tienen como objetivo principal evaluar las políticas, mecanismos y procedimientos de riesgos implementados por el Puesto de Bolsa, así como recomendar las medidas o ajustes a que haya lugar, aprobar y señalar las directrices en cuanto a la administración y control de riesgos, previa aprobación de la Junta Directiva.

Se han establecido los siguientes Comités que se detallan a continuación:

Alpha cuenta con los Comités de Auditoría, Riesgos y Cumplimiento que se reportan directamente al Consejo de Administración. A continuación sus objetivos y funciones.



Comité de Auditoría

El Comité de Auditoría realiza los trabajos de supervisión y medición de los aspectos financieros, de control y procedimientos implementados por la gerencia para proteger los intereses de los accionistas y otras partes interesadas, basados en asegurar la integridad y transparencia de la información de **Alpha**. La actividad de auditoría interna ayuda a una organización a cumplir sus objetivos aportando un enfoque sistemático y disciplinado para evaluar y mejorar la eficacia de los procesos de gestión de riesgos, control y gobierno.

Comité de Cumplimiento

El Comité de Cumplimiento realiza los trabajos asignados y adopta las medidas necesarias para el buen cumplimiento de la Norma de Prevención de Lavado de Activos, financiamiento del terrorismo y proliferación de armas de destrucción masiva, mediante procedimientos y políticas internas de Alpha.

Comité de Riesgos

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 **Alpha**, considerando tanto los riesgos contemplados a nivel regulatorio, como los identificados por el Área de Análisis y Control de Riesgos. De igual manera, deberá asegurar la existencia de los recursos necesarios para la correcta implementación de los mismos, vigilando a la vez, que la realización de las operaciones se ajuste a los límites, políticas y procedimientos aprobados por el Consejo de Administración.



Gobierno Corporativo

En **Alpha Sociedad de Valores, S.A.**, Puesto de Bolsa, siempre hemos mantenido el compromiso de implementar y ejecutar de manera constante los principios y las sanas prácticas de un buen Gobierno Corporativo, de acuerdo a los mejores estándares establecidos, entendiendo que es un elemento fundamental para el crecimiento y sostenibilidad del Puesto de Bolsa.

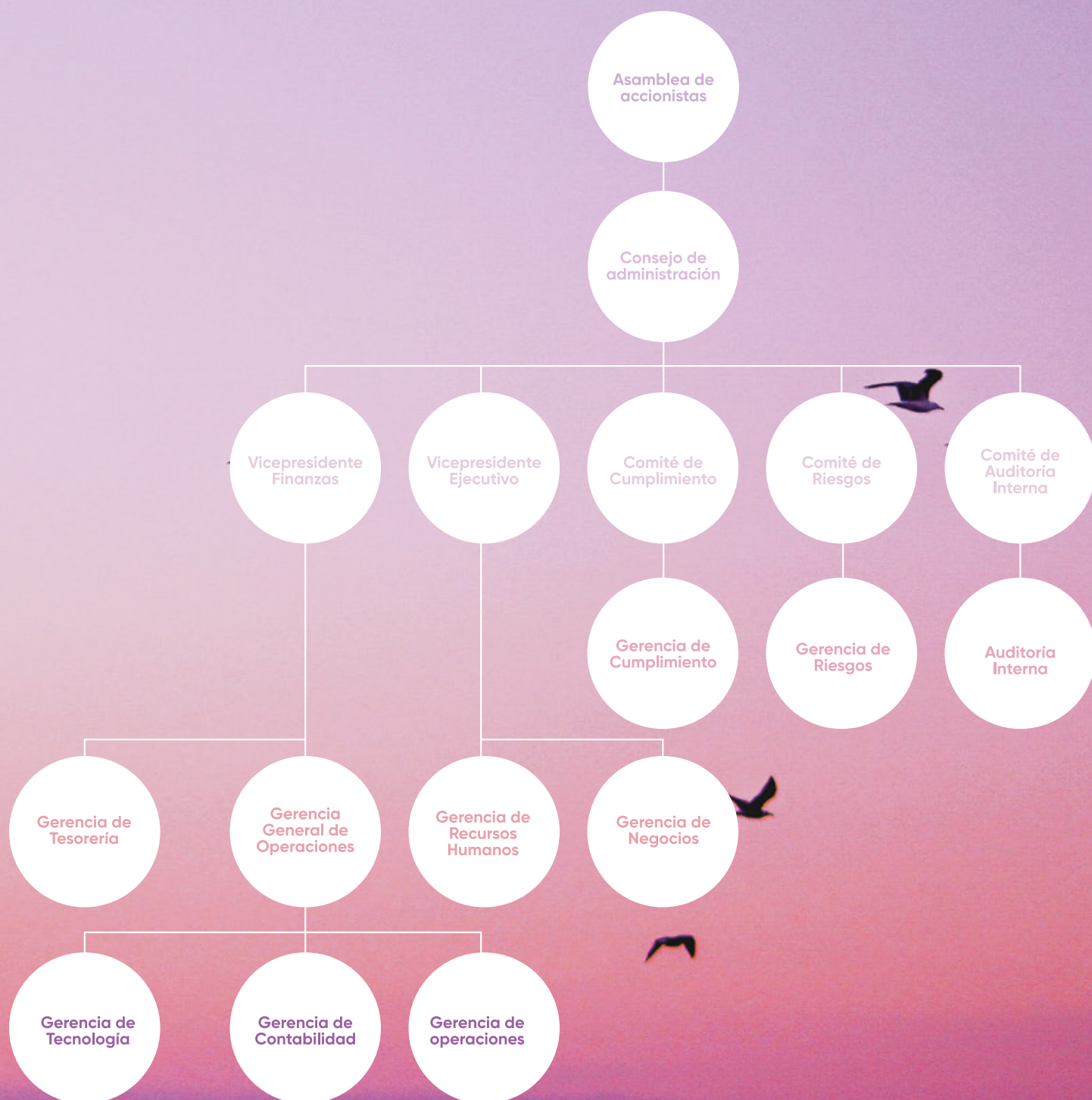
Estructura administrativa

La dirección y administración de **Alpha** está presidida por los siguientes órganos:

- a. La Asamblea General de Accionistas.
- b. El Consejo de Administración.
- c. Los Comités de Auditoría, Cumplimiento y Riesgos.
- d. Vicepresidente Ejecutivo.
- e. Vicepresidente de Finanzas.
- f. Los demás funcionarios del Puesto de Bolsa nombrados y designados por la Asamblea General o el Consejo de Administración.

A background image of a sunset sky with a gradient from purple at the top to orange at the bottom. Several birds are silhouetted against the sky, flying in various directions. The title 'Organigrama corporativo' is overlaid in white text.

Organigrama corporativo



Reglamentos y normativas internas de gobierno corporativo

Durante el 2017, con el fin de mantener las buenas prácticas de Gobierno Corporativo, **Alpha** elaboró, revisó, actualizó e implementó los manuales de procedimientos y normativas debidamente aprobados por la Superintendencia del Mercado de Valores de la República Dominicana:

Manual para la Prevención y Control del Lavado de Activos y Financiamiento al Terrorismo; el cual tiene por objetivo describir las políticas, procedimientos internos y señales de alerta establecidos por **Alpha** para prevenir el lavado de activos y el financiamiento del terrorismo.

Manual Administrativo y adecuación de la nueva Estructura Organizacional; el cual tiene como objetivo presentar de manera catalogada la estructura orgánica del Puesto de Bolsa, precisando las funciones de los distintos departamentos internos, de forma tal que se ofrezca una visión general de las atribuciones y responsabilidades de cada uno. Además, el mismo explica la jerarquía, los niveles de autoridad y las actividades de las unidades orgánicas de la empresa, además de delimitar claramente los niveles de dependencia e interrelación existente entre las áreas de la empresa.

Manual de Políticas y Procedimientos; el cual tiene como objetivo fundamental integrar en forma ordenada las normas y actividades que se deben realizar para que se opere de acuerdo a las necesidades de la empresa, además de proporcionar elementos de apoyo en la toma de decisiones y servir de guía en la inducción de nuevos empleados.

• Políticas de transparencia de información

Atendiendo las disposiciones legales pertinentes en materia de información sujeta a reserva, **Alpha** divulga a los grupos de interés y al público en general toda la información necesaria para la toma de decisiones informadas, particularmente respecto de la administración del Puesto de Bolsa, el nombre y perfil de sus administradores, las políticas, productos y servicios prestados. A continuación las políticas de transparencia de información de **Alpha**:

• Información Financiera

La información financiera que divulgará **Alpha**, al mercado, a los accionistas y a los clientes, será precisa, completa, amplia y comparable. Para cumplir con este objetivo, los estados financieros serán preparados de acuerdo con normas reconocidas.

Alpha, de manera voluntaria, proporcionará a los inversionistas estados financieros preparados de acuerdo con los Estándares Internacionales.

• Información a la superintendencia de valores

Alpha, en su condición de entidad regulada por la Superintendencia del Mercado de Valores de la República Dominicana y dando cumplimiento a las obligaciones de remisión de información establecidas en la normativa vigente, deberá remitir a dicho ente de supervisión toda la información periódica y eventual que requiera. Así mismo, **Alpha**, tendrá a disposición de la Superintendencia de Valores, toda la información necesaria para facilitar el ejercicio de su labor de supervisión.

• Información respecto de la administración

Alpha adoptará como buena práctica de Gobierno Corporativo, la publicación a través de su página web, de forma continua y constante las siguientes informaciones:

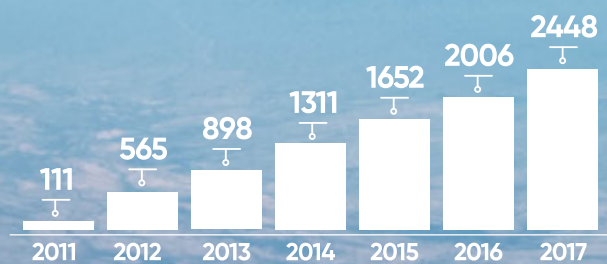
- Objetivos y Valores.
- Estados Financieros Auditados.
- Memorias Anuales.
- Productos y Servicios.
- Preguntas Frecuentes sobre el Mercado de Valores.
- Boletín Semanal.
- Responsabilidad Social frente a la sociedad.
- Disponibilidad de Inversiones.
- Hechos y noticias relevantes relacionadas con el Mercado.
- Formas de contacto.

• Información a los clientes

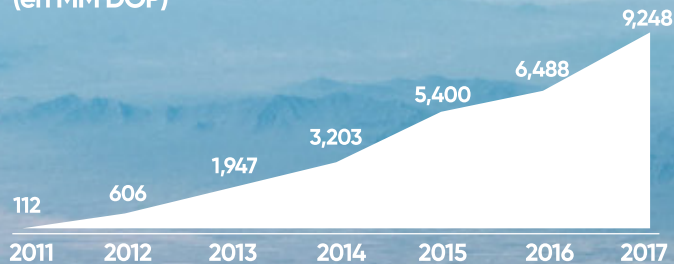
Alpha mantendrá a disposición de sus clientes e inversionistas toda la información que éstos requieran.

Indicadores de desempeño

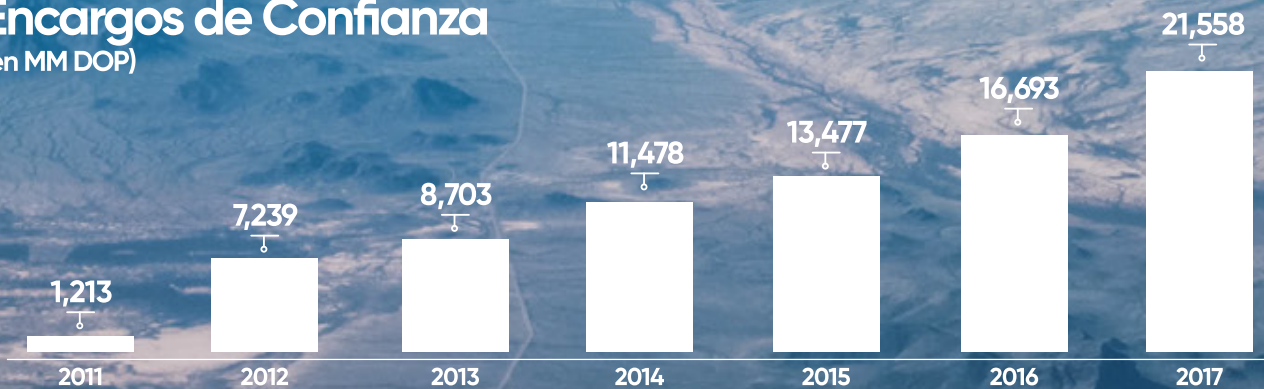
Total de clientes



Total de activos
(en MM DOP)

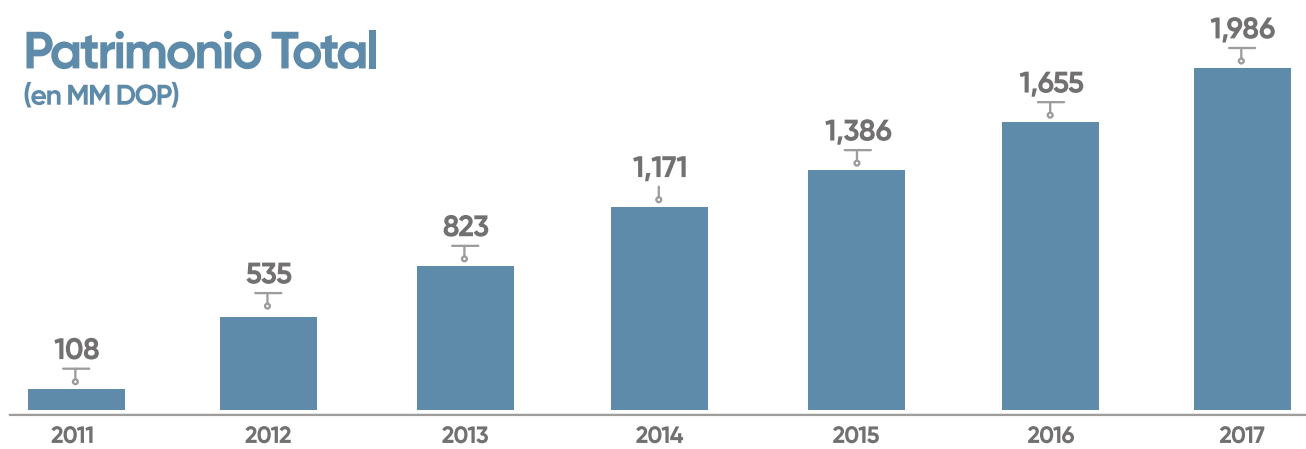


Encargos de Confianza
(en MM DOP)



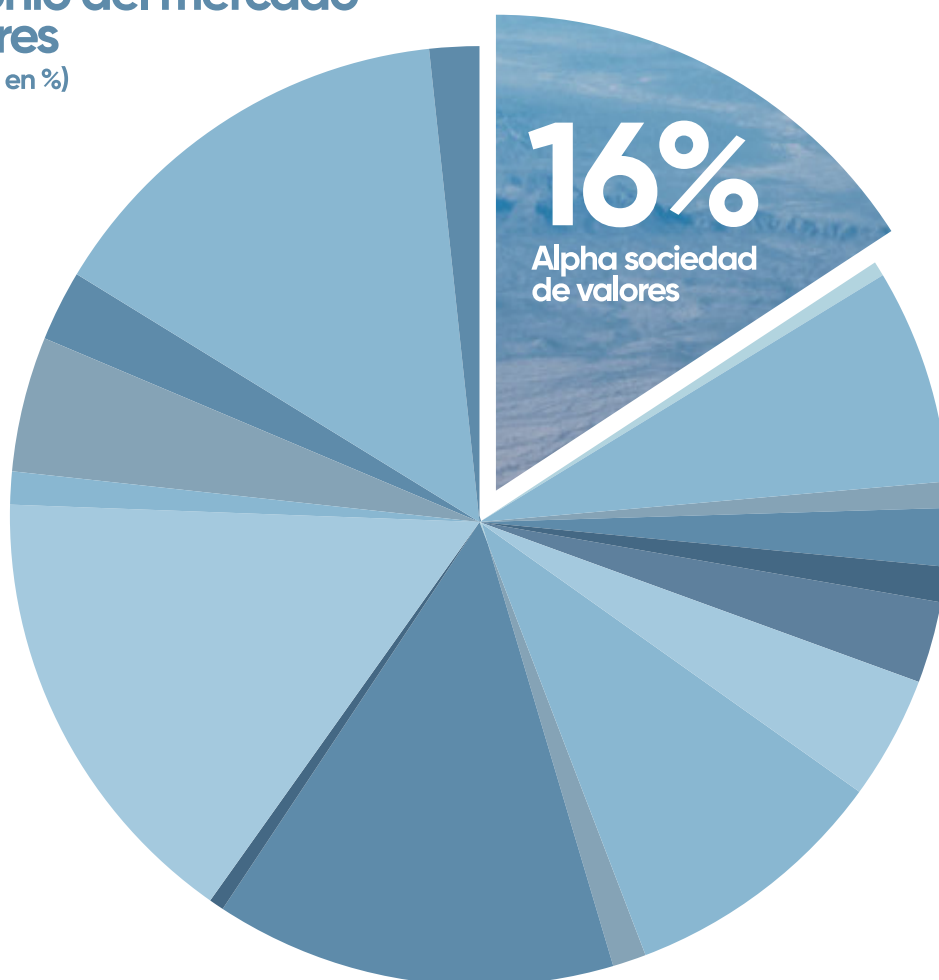
Patrimonio Total

(en MM DOP)



Patrimonio del mercado de valores

(participación en %)

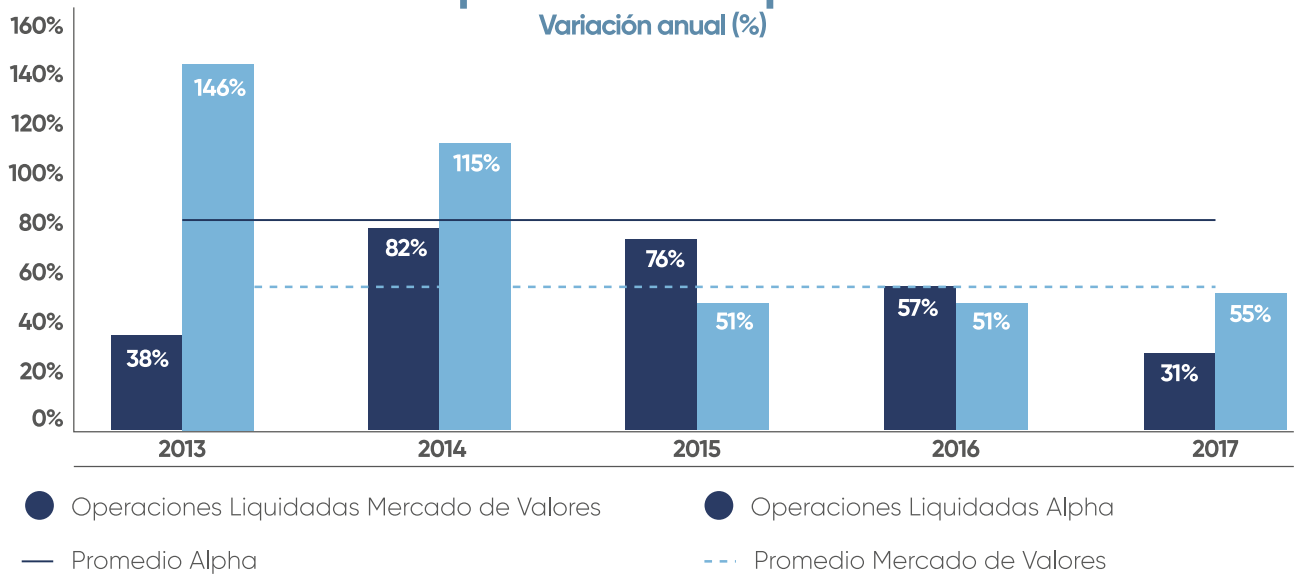


Total de operaciones



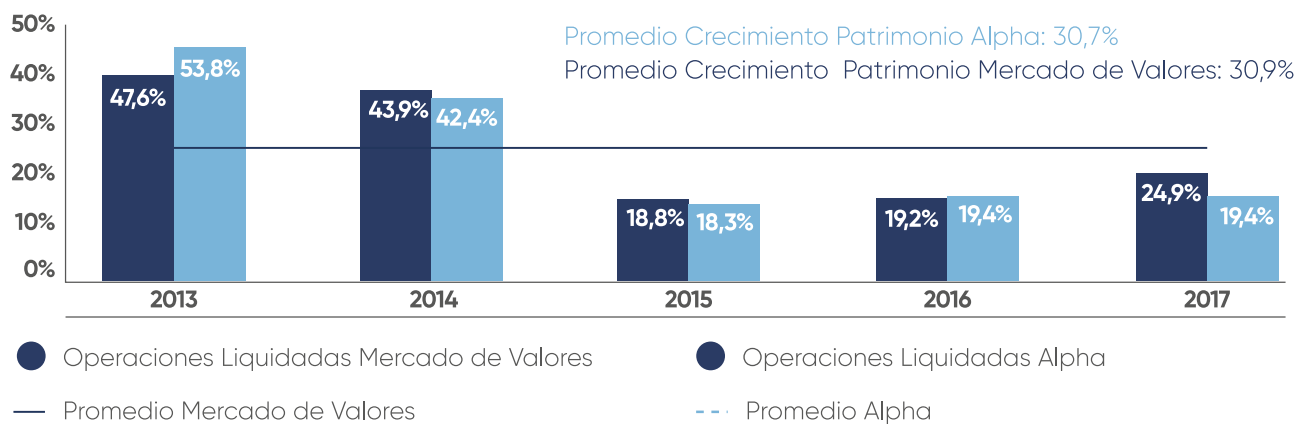
Crecimiento en Cantidad de Operaciones Liquidadas

Variación anual (%)



Evolución de Patrimonio

Variación anual (%)





Estados Financieros



Estados Financieros

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

31 de diciembre de 2017
(Conjuntamente con el Informe de los Auditores Independientes)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

CONTENIDO

	Página (s)
Informe de los Auditores Independientes.....	1-4
Estados de Situación Financiera.....	5
Estados de Resultados Integrales.....	6
Estados de Cambios en el Patrimonio.....	7
Estados de Flujos de Efectivo.....	8-9
Notas a los Estados Financieros.....	10-68
Información Suplementaria:	
Anexo I - Estado de Cartera de Inversión.....	69-189
Anexo II - Estado de Custodia.....	190-191
Anexo III - Estado de Otros Resultados Integrales.....	192
Anexo IV - Estado de Flujos de Efectivo.....	193
Anexo V - Tabla de Riesgo de Liquidez.....	194-196
Anexo VI - Otras Notas Informativas.....	197-198



Ernst & Young, S.R.L.
RNC No. 1-31-20492-9
Torre Empresarial Reyna II,
Suite 900, Piso 9,
Pedro Henríquez Ureña No.138,
Santo Domingo, República Dominicana.

Tel: (809) 472-3973
Fax: (809) 381-4047
ey.com

Informe de los Auditores Independientes

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

Opinión

Hemos auditado los estados financieros adjuntos de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. (en lo adelante “la Compañía”), los cuales comprenden el estado de situación financiera al 31 de diciembre de 2017, y los estados de resultados integrales, de cambios en el patrimonio y de flujos de efectivo por el año terminado en esa fecha, así como las notas a los estados financieros, incluyendo un resumen de las principales políticas contables.

En nuestra opinión, los estados financieros adjuntos presentan razonablemente, en todos sus aspectos significativos, la situación financiera de ALPHA Sociedad de Valores, S. A. al 31 de diciembre de 2017, su desempeño financiero y sus flujos de efectivo por el año terminado en esa fecha, de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera (“NIIFs”).

Base para la opinión

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

Asunto clave de auditoría

El asunto clave de auditoría es aquel que, basado en nuestro juicio profesional, ha sido de la mayor significatividad en nuestra auditoría de los estados financieros del año terminado el 31 de diciembre de 2017. Este asunto fue considerado en el contexto de nuestra auditoría de los estados financieros en su conjunto y en la formación de nuestra opinión de auditoría sobre este, y no expresamos una opinión separada sobre ese asunto. Hemos determinado que el asunto que se describe a continuación es el asunto clave de la auditoría que se debe comunicar en nuestro informe.

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

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

La Compañía mantiene inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados, las cuales se valúan por los precios cotizados en el mercado de valores y para aquellos instrumentos financieros que no existe un mercado de valores activo, se determinan utilizando técnicas de valoración observables y no observables en el mercado aprobadas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana y de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera. El importe en libros de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados al 31 de diciembre de 2017, se incluye en la nota 10 de los estados financieros adjuntos. Hemos enfocado nuestra atención en la valoración de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados en los que se utilizan técnicas de valoración con datos observables en el mercado clasificados como nivel 2, con la finalidad de identificar si existen hechos o circunstancias que indiquen que los precios y técnicas de valoración utilizadas son razonables al 31 de diciembre de 2017, de conformidad con las Normas Internacionales de Información Financiera.

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

- Evaluamos y probamos los controles internos de los procesos de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados de la Compañía, al 31 de diciembre de 2017.
- Realizamos la conciliación de los auxiliares de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados con el saldo según auxiliar de las mismas al 31 de diciembre de 2017.
- Enviamos a confirmar cada una de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados existentes según auxiliar de los mismos al 31 de diciembre de 2017.
- Revisamos las políticas y técnicas de valuación para las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados según la jerarquía del valor razonable que se indica en las Normas Internacionales de Información Financiera.
- Realizamos el recálculo de valuación de las inversiones en instrumentos financieros - a valor razonable con cambios en resultados al 31 de diciembre de 2017, considerando los precios transados en el mercado de estos instrumentos financieros al 31 de diciembre de 2017.

Otro asunto

Nuestra auditoría se efectuó con el propósito de formarnos una opinión de los estados financieros adjuntos tomados en su conjunto. La otra información adicional incluida como información complementaria, se presenta con el propósito de efectuar ciertos análisis adicionales de los estados financieros. Dicha información adicional sobre la composición de los estados de cartera, de custodia y de otros resultados integrales, los cuales han estado sujetos a los procedimientos que se aplican en la auditoría de los estados financieros y, en nuestra opinión, está presentada razonablemente en todos sus aspectos importantes en relación con los estados financieros tomados en su conjunto.

Otra Información Incluida en la memoria anual de la Compañía

La otra información consiste en información incluida en la memoria anual de la Administración distinta a los estados financieros y de nuestro informe de auditoría sobre ellos. La Administración es responsable por la otra información.

Se espera que la memoria anual de la Compañía esté disponible para nosotros después de la fecha de este informe de auditoría. Nuestra opinión sobre los estados financieros no cubre la otra información y no expresaremos una opinión o ninguna otra forma de conclusión de aseguramiento al respecto.

En relación con nuestra auditoría de los estados financieros, nuestra responsabilidad es leer ésta otra información en cuanto esté disponible, y al hacerlo, considerar si hay una desviación material entre esa otra información y los estados financieros, o con nuestro conocimiento obtenido durante el curso de la auditoría. Si determinamos que la otra información contiene desviaciones materiales, se nos requiere informar ese hecho.

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

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

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

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

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

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

No obstante, hechos o condiciones futuros pueden causar que la Compañía no continúe como una empresa en marcha.

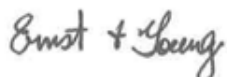
- Evaluamos la presentación global, estructura y contenido de los estados financieros, incluyendo las revelaciones, y si dichos estados financieros representan las transacciones subyacentes y eventos de manera que logren la presentación razonable.
- Obtenemos evidencia suficiente y adecuada con relación a la información financiera de las entidades o actividades de negocios dentro de la Compañía para expresar una opinión sobre los estados financieros. Somos responsables de la dirección, supervisión y ejecución de la auditoría del Grupo. Somos los únicos responsables de nuestra opinión de auditoría.

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

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

Entre los asuntos comunicados a los encargados de la Administración de la Compañía, determinamos los que han sido de la mayor significatividad en la auditoría de los estados financieros al 31 de diciembre de 2017 y que por lo tanto son el asunto clave de auditoría. Hemos descrito dicho asunto clave de auditoría en nuestro informe de auditoría, a menos que una ley o regulación no permita la revelación pública del asunto o, en circunstancias extremadamente raras, determinemos que el asunto no debe ser comunicado en nuestro informe debido a que sería razonable esperar que las consecuencias adversas de hacerlo superarían los beneficios de interés público de su comunicación.

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



16 de mayo de 2018
Torre Empresarial Reyna II,
Suite 900, Piso 9,
Pedro Henríquez Ureña No. 138.
Santo Domingo, República Dominicana

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADOS DE SITUACIÓN FINANCIERA

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

		2017	2016	1ro. de enero de 2016
	Notas			
Activos				
Efectivo y equivalentes de efectivo	7 y 8	2,050,852,717	1,281,365,491	630,864,483
Certificado financiero	9	1,090,678,043	-	-
Inversiones en instrumentos financieros:				
A valor razonable con cambios en resultados	7 y 10	5,366,584,733	3,542,674,106	4,517,731,315
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	7 y 11	60,106,379	51,471,630	78,145,022
A costo amortizado corto plazo	7 y 12	401,066,667	558,935,229	119,253
Otras cuentas por cobrar	7 y 13	144,577,112	65,129,430	25,803,120
Anticipos de impuesto sobre la renta	22	63,921,030	93,919,813	64,777,666
Impuesto sobre la renta diferido	22	25,608,873	12,568,769	29,310,891
Activo diferido corto plazo	7 y 12	-	9,231,346	-
Total activos corrientes		9,203,395,554	5,615,295,814	5,346,751,750
Inversiones en instrumentos financieros:				
A costo amortizado largo plazo	7 y 12	-	799,593,017	-
Inversiones en acciones	14	28,385,553	28,385,553	28,385,553
Mobiliario y equipos	15	6,613,855	6,725,199	9,507,118
Cargos diferidos	16	7,878,342	11,307,239	13,892,255
Otros activos		1,263,603	2,602,643	1,374,187
Activo diferido largo plazo	7 y 12	-	23,847,645	-
Total de activos		9,247,536,907	6,487,757,110	5,399,910,863
Pasivos y Patrimonio				
Pasivos financieros:				
A valor razonable	7 y 17	3,624,844,611	2,131,416,110	1,029,871,056
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados	7 y 11	823,544,771	228,831,903	123,660,044
A costo amortizado:				
Obligaciones con bancos	7 y 18	1,865,120,141	1,735,221,575	1,807,355,979
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos corto plazo	19	12,782,740	9,496,356	1,011,303,402
Otras cuentas por pagar		7,366,036	5,378,068	13,432,269
Cuentas por pagar a relacionadas	20	2,224,156	-	37,108
Acumulaciones y otras obligaciones por pagar	21	50,612,888	47,320,686	28,534,873
Total pasivos corrientes		6,386,495,343	4,157,664,698	4,014,194,731
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo	19	875,000,000	675,000,000	-
Total Pasivos		7,261,495,343	4,832,664,698	4,014,194,731
Compromisos y contingencias	26			
Patrimonio				
Capital	23	900,000,000	650,000,000	439,282,600
Aportes para futura capitalización		138	138	138
Reserva de capital		180,000,000	130,000,000	87,856,520
Resultados acumulados		906,041,426	875,092,274	858,576,874
Total de patrimonio		1,986,041,564	1,655,092,412	1,385,716,132
TOTAL DE PASIVOS Y PATRIMONIO		9,247,536,907	6,487,757,110	5,399,910,863

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manual Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.*Estados Financieros***ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRALES****Por los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016***(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

		2017	2016
	Notas		
Resultado por instrumentos financieros			
A valor razonable	10 y 17	2,196,249,262	1,298,322,568
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	11	(1,428,745,242)	(800,472,123)
A costo amortizado	12	137,973,388	134,295,617
Total resultados por instrumentos financieros		<u>905,477,408</u>	<u>632,146,062</u>
Resultado por intermediación			
Comisiones por operaciones bursátiles y extrabursátiles		2,445,188	702,941
Gastos por comisiones y servicios		<u>(19,729,334)</u>	<u>(20,225,157)</u>
Total Resultados por intermediación		<u>(17,284,146)</u>	<u>(19,522,216)</u>
Gastos por financiamiento	18 y 19	(134,696,258)	(156,622,869)
Gastos de administración y comercialización	25	(239,557,703)	(214,663,266)
Otros resultados			
Ganancia en cambio de moneda extranjera, neta	7	55,472,787	16,295,561
Resultado de inversiones en sociedades	14	561	489
Ingresos financieros	8 y 9	39,002,922	27,420,641
Otros ingresos		<u>2,778,637</u>	<u>1,131,253</u>
Total otros resultados		<u>97,254,907</u>	<u>44,847,944</u>
Resultado antes del impuesto sobre la renta		611,194,208	286,185,655
Impuesto sobre la renta	22	<u>(30,245,057)</u>	<u>(16,809,374)</u>
Utilidad neta		<u>580,949,151</u>	<u>269,376,281</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manual Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

ESTADO DE CAMBIOS EN EL PATRIMONIO

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

	Notas	Capital	Aportes No Capitalizados	Reserva Legal	Resultados Acumulados	Total de Patrimonio
Saldos iniciales al 1ro. de enero de 2016		439,282,600	138	87,856,520	858,576,874	1,385,716,132
Transferencia y aumento de capital	23	210,717,400	-	42,143,480	(252,860,880)	-
Resultado del ejercicio		-	-	-	269,376,281	269,376,281
Saldos al 31 de diciembre de 2016		650,000,000	138	130,000,000	875,092,275	1,655,092,413
Transferencia y aumento de capital	23	250,000,000	-	50,000,000	(300,000,000)	-
Resultado del ejercicio		-	-	-	580,949,151	580,949,151
Dividendos declarados		-	-	-	(250,000,000)	(250,000,000)
Saldos al 31 de diciembre de 2017		900,000,000	138	180,000,000	906,041,426	1,986,041,564

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

Por los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

		2017	2016
	Notas		
Flujos de efectivo de actividades de operación:			
Utilidad antes de impuesto sobre la renta		611,194,208	286,185,655
Ajustes para conciliar la utilidad antes de impuesto sobre la renta con el efectivo neto provisto por las actividades de operación:			
Gasto de depreciación y amortización	15 y 16	7,299,065	7,186,983
Pérdida neta en disposición de mobiliario y equipos		1,603,976	-
Efecto de la fluctuación cambiaria de las obligaciones con bancos		8,881,220	25,447,470
Ingresos por dividendos en efectivo		(561)	(489)
Intereses ganados		(39,002,922)	(27,420,641)
Gastos por intereses		134,696,258	156,622,869
Disminución (aumento) en activos:			
Certificado financiero		(1,090,678,043)	-
A valor razonable con cambios en resultados		(1,823,910,627)	975,057,209
A valor razonable instrumentos financieros derivados		(8,634,749)	26,673,392
Otras cuentas por cobrar		(79,447,682)	(39,326,310)
Otros activos		1,339,040	(1,228,458)
Aumento (disminución) en pasivos			
Pasivos financieros a su valor razonable		1,493,428,501	1,101,545,054
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados		594,712,868	105,171,859
Otras cuentas por pagar		1,987,968	(8,054,201)
Cuentas por pagar a relacionadas		2,224,156	(37,108)
Acumulaciones y otras obligaciones		3,294,205	18,718,562
Impuesto sobre la renta pagado	22	(13,286,378)	(29,142,147)
Flujos de efectivo neto provisto (usado en) por las actividades de operación		<u>(194,299,497)</u>	<u>2,597,399,699</u>
Flujos de efectivo de actividades de inversión:			
Adquisición de mobiliario y equipo	15	(3,878,072)	(578,454)
Adquisición de cargos diferidos	16	(1,486,731)	(1,241,594)
Cobros de instrumentos financieros a su costo amortizado		519,803,484	200,000,000
Producto de la venta de instrumentos financieros a su costo amortizado		470,737,086	(1,591,487,984)
Dividendos recibidos en efectivo	14	561	489
Intereses cobrados		39,002,922	27,420,641
Flujos de efectivo neto provisto por (usado en) actividades de inversión		<u>1,024,179,250</u>	<u>(1,365,886,902)</u>

(Continúa)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.*Estados Financieros***ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (CONTINUACIÓN)****Por los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016***(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)*

	<u>2017</u>	<u>2016</u>
Flujos de efectivo de actividades de financiamiento:		
Producto de nuevas obligaciones con bancos	4,933,277,593	15,744,688,848
Producto de nuevas obligaciones por instrumentos financieros emitidos	200,000,000	675,000,000
Pago de obligaciones con bancos	(4,815,120,762)	(15,841,852,126)
Pago de obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	(1,000,000,000)
Dividendos pagados	(250,000,000)	-
Intereses pagados	(128,549,359)	(158,848,511)
Flujos de efectivo neto usado en actividades de financiamiento	<u>(60,392,528)</u>	<u>(581,011,789)</u>
 Aumento neto en el efectivo	769,487,226	650,501,008
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	1,281,365,491	630,864,483
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	<u>2,050,852,717</u>	<u>1,281,365,491</u>
 Transacciones no monetarias:		
Capital	250,000,000	210,717,400
Reserva legal	50,000,000	42,143,480
Resultados acumulados	<u>(300,000,000)</u>	<u>(252,860,880)</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manual Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(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 55 empleados al 31 de diciembre de 2017 (2016: 48 empleados).

Sus principales funcionarios son:

Nombre	Posición
Santiago Camarena	Vicepresidente Ejecutivo
Juan Manuel Barranco	Vicepresidente de Finanzas

Los estados financieros de la Compañía por el año terminado el 31 de diciembre de 2017, fueron autorizados para su emisión por la Administración en fecha 15 de mayo de 2018.

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 31 de diciembre de 2017, 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).

Para todos los años anteriores y hasta el año terminado el 31 de diciembre de 2016, inclusive, la Compañía preparó sus estados financieros de conformidad con las prácticas de contabilidad establecidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana. Estos estados financieros por el año terminado el 31 de diciembre de 2017, son los primeros estados financieros que la Compañía ha preparado de acuerdo con las NIIF. La nota 6 incluye la información sobre cómo la Compañía adoptó las NIIF por primera vez.

2.2 Base de valuación y moneda de presentación

Los estados financieros de ALPHA Sociedad de Valores, S. A., al 31 de diciembre de 2017, 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

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables

3.1 Saldos y transacciones en moneda extranjera

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

Las tasas de cambio utilizadas por la Compañía al 31 de diciembre de 2017, para convertir los saldos en dólares estadounidenses (USD), Euros (EUR), dólares canadienses (CAD) y guaraníes paraguayos (PYG) a pesos dominicanos fueron las siguientes:

Moneda:	31 de diciembre de 2017	2016	1ro. de enero de 2016
USD	48.2926	46.7111	45.5544
EUR	59.1464	48.7235	49.5022
CAD	-	34.7889	-
PYG	0.008620	0.008100	0.007848

3.2 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:

- Se espera realizarlo, venderlo o consumirlo en el ciclo normal de operación
- Se mantiene principalmente con fines de negociación
- Se espera realizar el activo dentro de los doce meses siguientes a la fecha del ejercicio sobre el que se informa, o
- Es efectivo o equivalentes de efectivo, a menos que tenga restricciones, para ser intercambiado o usado para cancelar un pasivo al menos durante doce meses a partir de la fecha del período sobre el que se informa

El resto de los activos se clasifican como no corrientes.

Un pasivo se clasifica como corriente cuando:

- Se espera sea cancelado en el ciclo normal de operación
- Se mantiene principalmente con fines de negociación
- Deba liquidarse durante los doce meses siguientes a la fecha del período sobre el que se informa, o
- No tenga un derecho incondicional para aplazar su cancelación, al menos, durante los doce meses siguientes a la fecha del período sobre el que se informa.

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

Los activos y pasivos por impuestos diferidos se clasifican como activos y pasivos no corrientes.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.3 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.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.3 Cálculo del valor razonable (continuación)

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.

3.4 Reconocimiento de ingresos

Los ingresos se reconocen en la medida en que sea probable que la Compañía reciba los beneficios económicos correspondientes a la transacción y éstos puedan ser cuantificados con fiabilidad, independientemente de cuándo se reciba el cobro. Los ingresos se valoran al valor razonable de las contraprestaciones recibidas o por recibir, teniendo en cuenta las condiciones definidas en el contrato y excluyendo los impuestos.

La Compañía ha concluido que está actuando como principal en todos los contratos, dado que es el principal obligado en todos los acuerdos, puede fijar los precios libremente y está expuesto a los riesgos de crédito. Además, deben cumplirse los siguientes requisitos para que se reconozcan los ingresos.

Ingresos por intereses

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

Ingresos por comisión

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

Dividendos

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.5 Impuestos

Impuesto sobre la renta corriente

El impuesto sobre la renta corriente es determinado tomando como base lo establecido en la Ley 11-92, Código Tributario, sus reglamentos y sus modificaciones. El impuesto corriente correspondiente al presente período y a los anteriores, es reconocido por la Compañía como un pasivo en la medida en que no haya sido liquidado o no haya podido ser compensado con los anticipos. Si la cantidad ya pagada, que corresponda al período anterior, excede el importe a pagar por esos períodos, el exceso es reconocido como un activo. La tasa de impuesto utilizada para determinar el impuesto sobre la renta al 31 de diciembre de 2017 y 2016 es de 27% de la renta neta imponible a esa fecha.

Impuesto sobre los activos

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

Impuesto sobre la renta diferido

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

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

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

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 31 de diciembre de 2017 y 2016 es de 18%.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.6 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.

3.7 Mobiliario y equipos

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

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

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

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

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

3.8 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.9 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.

3.10 Activos financieros

Reconocimiento inicial y valoración

Los activos financieros se clasifican a la fecha de su reconocimiento inicial, según correspondan, como certificados financieros, activos financieros a valor razonable con cambios en resultados, cuentas por cobrar, inversiones en instrumentos financieros, instrumentos derivados y otras inversiones en instrumentos patrimoniales. Todos los activos financieros se reconocen inicialmente a su valor razonable y, para todos aquellos activos financieros no registrados al valor razonable con cambios en resultados, los costos de la transacción que son reconocidos como costos de adquisición del activo financiero.

Las compras o ventas de activos financieros son reconocidas por la Compañía en las fechas en que se realiza la transacción, siendo la fecha de contratación, la fecha en la que la Compañía se compromete a comprar o vender un activo financiero.

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:

Certificados financieros / Inversiones mantenidas hasta el vencimiento

Los activos financieros no derivados con amortizaciones fijas o determinables y vencimiento definido, son clasificados como inversiones mantenidas hasta el vencimiento cuando la Compañía tiene la positiva intención y habilidad para mantenerlas hasta la fecha de vencimiento. Después de su reconocimiento inicial, los instrumentos financieros mantenidos hasta el vencimiento son medidos al costo amortizado utilizando el método de la tasa de interés efectiva. Las ganancias o pérdidas se reconocen en los resultados cuando el instrumento financiero es desapropiado o se haya deteriorado, así como a través del proceso de amortización.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.10 Activos financieros (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.

Al 31 de diciembre de 2017 y 2016, la Compañía mantiene derechos y obligaciones reconocidos en cuentas de contingencia, por concepto de contratos de compraventa spot y forward de títulos valores de deuda, sobre los cuales la Compañía no posee el control de los mismos, como consecuencia de las características particulares de los acuerdos pactados con los clientes (nota 26).

Partidas a cobrar

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

Inversiones en instrumentos patrimoniales

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.10 Activos financieros (continuación)

Deterioro de activos financieros

La Compañía evalúa a la fecha del estado de situación financiera si existe evidencia objetiva de que un activo financiero o un grupo de ellos pudieran estar deteriorados. Un activo financiero o un grupo de activos financieros es considerado deteriorado si, y solo si, existe evidencia objetiva de deterioro como resultado de uno o más eventos que han ocurrido después del reconocimiento inicial del activo financiero y que el evento de pérdida detectado tiene un impacto en los flujos de efectivo futuros estimados para el activo financiero o del grupo de activos financieros que pueda ser confiablemente estimado. La evidencia del deterioro puede incluir indicadores de que los deudores están experimentando significativas dificultades financieras, retrasos en el pago de intereses o pagos del principal, la probabilidad de que tales deudores se encuentren en un proceso de quiebra u otro tipo de reorganización financiera y cuando la información indique que hay una disminución estimable en los flujos de efectivo de la Compañía provenientes de incumplimientos contractuales.

Activos financieros valorados al costo amortizado

Para los activos financieros valorados al costo amortizado, la Compañía evalúa si individualmente existe deterioro de los activos financieros que son significativos individualmente, o colectivamente para los activos financieros que no son significativos individualmente. Si la Compañía determina que no hay evidencias objetivas de deterioro para los activos financieros evaluados individualmente, sean significativos o no, incluye dichos activos en un grupo de activos financieros con características de riesgo de crédito similares y evalúa su deterioro colectivamente. Los activos cuyo deterioro se evalúa individualmente y para los que se reconoce o se continúa reconociendo una pérdida por deterioro, no se incluyen en las evaluaciones colectivas de deterioro.

El importe de cualquier pérdida por deterioro identificada se evalúa como la diferencia entre el valor en libros del activo y el valor actual de los flujos de efectivo estimados futuros (excluyendo las pérdidas esperadas futuras en las que todavía no se ha incurrido). El valor actual de los flujos de efectivo estimados futuros se descuenta al tipo de interés efectivo original del activo financiero.

El valor en libros de los activos se reduce mediante el deterioro y la pérdida se reconoce en el estado de resultados integrales. Los ingresos por intereses se continúan devengando, utilizando el mismo tipo de interés que se utiliza para descontar los flujos de efectivo futuros en el cálculo del deterioro. Las partidas a cobrar, junto con su corrección, se dan de baja cuando no hay perspectivas realistas de futuros reembolsos y todas las garantías han sido ejecutadas o transferidas a la Compañía. Si en los años posteriores el importe de las pérdidas por deterioro estimadas se incrementa o reduce debido a un suceso ocurrido después de que se reconozca el deterioro, la pérdida por deterioro previamente reconocida se incrementa o reduce ajustando por deterioro. Cualquier importe que se hubiera dado de baja y sea posteriormente recuperado se registra como menos gasto en el estado de resultados integrales.

3.11 Pasivos financieros

Reconocimiento inicial y valoración

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 plazo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.11 Pasivos financieros (continuación)

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

Instrumentos financieros a valor razonable e instrumentos derivados

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

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.

3.12 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 objetivo 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 a su importe recuperable, definido este como la cifra mayor entre su valor razonable menos los costos de venta y su valor en uso. Los ajustes que se generen por este concepto se registran en los resultados del año en que se determinan.

3.13 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

3. Resumen de las principales políticas contables (continuación)

3.14 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.

3.15 Beneficios al personal

Prestaciones laborales

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

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

Beneficios post-empleo

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

Bonificación

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

Otros beneficios laborales

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

4. Juicios, estimaciones e hipótesis contables significativas

La preparación de los estados financieros de la Compañía requiere que la Administración realice juicios, 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

4. Juicios, estimaciones e hipótesis contables significativas (continuación)

Juicios

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

Clasificación de arrendamientos de inmueble - la Compañía como arrendador

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

Estimaciones e hipótesis

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

Valor razonable de los instrumentos financieros

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

Deterioro de valor de activos no financieros

La Compañía evalúa, a la fecha de cada estado financiero, si hay alguna indicación de que un activo no financiero pueda estar deteriorado. Los activos no financieros son evaluados por deterioro cuando existen indicaciones de que el valor en libros puede ser no recuperable. Cuando se realiza el cálculo de estos valores, la Administración debe estimar los flujos futuros de efectivo esperados para los activos relacionados y debe usar una tasa de descuento para calcular el valor presente de estos flujos de efectivo.

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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables

Las Normas Internacionales de Información Financiera o sus interpretaciones emitidas, pero que no han entrado en vigencia al 31 de diciembre de 2017, 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, se espera que las nuevas normas o enmiendas no tengan efecto material sobre la posición financiera de la Compañía, su desempeño y/o divulgaciones.

NIIF 9 Instrumentos Financieros

En julio de 2014, el IASB publicó la versión final de NIIF 9 Instrumentos Financieros, la cual refleja todas las fases del proyecto de instrumentos financieros y reemplaza a la NIC 39 Instrumentos Financieros: Reconocimiento y Medición y todas las versiones anteriores de la NIIF 9. La norma introduce nuevos requisitos para la clasificación y medición de instrumentos financieros, el deterioro de éstos, y la contabilidad de coberturas. La NIIF 9 entra en vigencia para períodos anuales que comienzan en o después del 1ro. de enero de 2018, y se permite la aplicación anticipada. A excepción de la contabilidad de coberturas, se requiere la aplicación retrospectiva, pero la información comparativa no es obligatoria. Para la contabilidad de coberturas, los requerimientos generalmente se aplican prospectivamente, con ciertas excepciones limitadas.

La Compañía tiene previsto adoptar la nueva norma en la fecha de aplicación requerida y no reexpresará la información comparativa. Durante el año 2017, la Compañía ha realizado una evaluación detallada de los impactos de los tres (3) aspectos de la NIIF 9. Esta evaluación se basa en la información actualmente disponible y puede estar sujeta a variaciones por información adicional que esté disponible en el año 2018 cuando la Compañía adopte la NIIF 9. En general, la Compañía no espera grandes cambios en su estado de situación financiera y en el estado de patrimonio de la Compañía.

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

(a) Clasificación y valoración

La Compañía no espera grandes cambios en su estado de situación financiera y en el estado de resultados integrales por la aplicación de los requerimientos de clasificación y valoración de la NIIF 9. La Compañía espera continuar valorando a valor razonable todos los activos financieros que actualmente se registran a valor razonable. Los instrumentos de deuda se espera que se valoren a valor razonable reflejando las variaciones en el estado de resultados integrales de acuerdo con la NIIF 9, ya que la Compañía espera no solo mantener los activos para cobrar los flujos de efectivo contractuales, sino que también venderá los mismos según las condiciones y necesidades de la Compañía.

La Compañía 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

NIIF 9 Instrumentos Financieros (continuación)

(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 ha determinado 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 se espera un impacto como resultado de la aplicación de esta norma.

NIIF 15 Ingresos Procedentes de Contratos con Clientes

La NIIF 15 se emitió en mayo de 2014 y establece un modelo de cinco pasos que aplicará a los ingresos procedentes de contratos con clientes. Bajo la NIIF 15 los ingresos se reconocen por un importe que refleja la contraprestación a la que una entidad espera tener derecho a cambio de transferir bienes o servicios a un cliente. La nueva norma sobre ingresos suplantará todos los requerimientos actuales sobre reconocimiento de ingresos bajo las NIIF. Se requiere la aplicación retrospectiva completa o modificada para los períodos anuales que empiezan el 1ro. de enero de 2018 o posteriormente.

La Compañía tiene previsto adoptar la norma en la fecha de aplicación requerida y no espera que la misma tenga impacto en el resultado de la Compañía.

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. 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

NIIF 16 Arrendamientos (continuación)

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. Se permite la aplicación anticipada, pero no antes de que una entidad aplique la NIIF 15. Un arrendatario podrá aplicar la norma utilizando ya sea un enfoque retrospectivo completo o modificado. Las provisiones de transición de la norma permiten ciertas facilidades.

Interpretación IFRIC 22 Transacciones en Moneda Extranjera y Contraprestaciones Anticipadas

La Interpretación aclara que al determinar el tipo de cambio spot a utilizar en el reconocimiento inicial del activo, o de la pérdida o ganancia (o parte de ésta) resultante de dar de baja un activo o pasivo no monetario relacionado con la contraprestación anticipada, la fecha de la transacción es la fecha en que una entidad reconoce inicialmente el activo o el pasivo no monetario que surge de la contraprestación anticipada. Si hay múltiples pagos o recibos por adelantado, la entidad debe determinar la fecha de la transacción para cada pago o recibo de la contraprestación anticipada. Las entidades pueden aplicar las modificaciones de forma completamente retrospectiva.

Alternativamente, una entidad puede aplicar la interpretación prospectivamente a todos los activos, pérdidas o ganancias dentro de su alcance que inicialmente se reconocen en o después de:

- El comienzo del período de reporte en el que la entidad aplica por primera vez la interpretación, o
- El comienzo de un período de reporte anterior en que se presentó como información comparativa en los estados financieros del período sobre el que se informa que la entidad aplica por primera vez la interpretación.

La interpretación es efectiva para períodos anuales que comienzan en o después del 1ro. de enero de 2018. Se permite su aplicación anticipada y debe divulgarse.

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

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

La interpretación aborda específicamente lo siguiente:

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

5. Futuros cambios en normas contables (continuación)

Interpretación IFRIC 23 La Incertidumbre Frente a los Tratamientos del Impuesto a las Ganancias (continuación)

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

Enmiendas a la IFRS 10 y NIC 28: Ventas o Contribuciones de Activos entre un Inversionista y su Negocio Conjunto o Asociada

Las enmiendas abordan el conflicto entre la IFRS 10 y la NIC 28 al administrar la pérdida de control de una subsidiaria que se vende o se contribuye a una asociada o negocio conjunto. Las enmiendas aclaran que la ganancia o pérdida que resulte de la venta o contribución de activos que constituyen un negocio, tal y como se define en la IFRS 3, entre un inversionista y su asociada o negocio conjunto, se reconoce por completo. Sin embargo, cualquier ganancia o pérdida proveniente de la venta o contribución de activos que no constituyen un negocio, se reconoce únicamente en proporción a la participación no relacionada que posee el inversionista en la asociada o negocio conjunto. El IASB ha diferido la entrada en vigencia de estas enmiendas de forma indefinida, sin embargo una entidad que las adopte anticipadamente debe aplicarlas prospectivamente.

Mejoras anuales Ciclo 2014-2016 (emitidas en diciembre de 2016)

Estas mejoras incluyen la siguiente:

NIC 28 Inversiones en Asociadas y Empresas Conjuntas - Aclaración de que la medición de las participadas al valor razonable con cambios en resultados es una opción a nivel de cada inversión.

Las enmiendas aclaran que:

- Una entidad que es una organización de capital de riesgo, u otra entidad que califique, puede elegir al momento de reconocimiento inicial y con base en cada inversión, el medir sus inversiones en asociadas y negocios conjuntos al valor razonable con cambios en resultados.
- Si una entidad (que no sea una entidad de inversión) tiene una participación en una asociada o negocio conjunto que sea una entidad de inversión, la entidad puede elegir mantener la medición del valor razonable aplicada por esa entidad de inversión asociada o empresa conjunta sobre las participaciones de la entidad de inversión o empresa conjunta en subsidiarias al aplicar el método de participación patrimonial. Esta elección se realiza por separado para cada entidad asociada o empresa conjunta de inversión, al final de la fecha en que: (a) la entidad asociada o la empresa conjunta de inversión se reconoce inicialmente; (b) la asociada o empresa conjunta se convierte en una entidad de inversión; y (c) la asociada de la entidad de inversión o empresa conjunta primero se convierte en una controladora.

La anterior enmienda debe aplicarse de forma retrospectiva y es efectiva a partir del 1ro. de enero de 2018, permitiéndose la aplicación anticipada. Si una entidad aplica esas modificaciones para un período anterior, debe divulgarlo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Adopción por primera vez

Estos estados financieros correspondientes al año terminado el 31 de diciembre de 2017, son los primeros estados financieros que la Compañía ha preparado de acuerdo con las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF), para los años anteriores y hasta el año terminado el 31 de diciembre de 2016, la Compañía preparó sus estados financieros de acuerdo con las prácticas de contabilidad establecidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana.

Por lo tanto, la Compañía ha preparado estados financieros que cumplen con las NIIF vigentes para el año terminado el 31 de diciembre de 2017, junto con la información comparativa correspondiente al 31 de diciembre de 2016 y por el año terminado en esa fecha.

Como parte de la preparación de estos estados financieros, el estado de situación financiera de apertura fue preparado al 1ro. de enero de 2016. Esta nota explica las principales reclasificaciones realizadas por la Compañía para re-expresar el estado de situación financiera al 1ro. de enero de 2016 y los estados financieros anteriormente emitidos al 31 de diciembre de 2016, y por el año terminado en esa fecha, todos ellos preparados anteriormente de acuerdo con las prácticas de contabilidad establecidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana (Prácticas de contabilidad SIV).

6.1 Estimaciones

Las estimaciones realizadas al 1ro. de enero de 2016 y al 31 de diciembre de 2016 son coherentes con las estimaciones realizadas para las mismas fechas según las prácticas de contabilidad establecidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana. Las estimaciones realizadas por la Compañía para determinar estos importes según las NIIF reflejan las condiciones existentes al 1ro. de enero de 2016, la fecha de transición a las NIIF, y al 31 de diciembre de 2016.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Adopción por primera vez (continuación)

6.2 Conciliación del patrimonio al 1ro. de enero de 2016

		Prácticas de contabilidad SIV	Reclasificaciones	Balance NIIF
ACTIVOS	Notas			
Efectivo y equivalente de efectivo		630,864,483	-	630,864,483
Inversiones en instrumentos financieros:				
A valor razonable con cambios en resultados	A	4,378,415,768	139,315,547	4,517,731,315
A valor razonable instrumentos financieros derivados	A	-	78,145,022	78,145,022
A costo amortizado	A	118,760	493	119,253
Otras cuentas por cobrar	A	139,305,665	(113,502,545)	25,803,120
Anticipos de impuesto sobre la renta	A	-	64,777,666	64,777,666
Impuestos diferidos	A	-	29,310,891	29,310,891
Activos corrientes		<u>5,148,704,676</u>	<u>198,047,074</u>	<u>5,346,751,750</u>
Inversiones en acciones		28,385,553	-	28,385,553
Mobiliario y equipos		9,507,118	-	9,507,118
Activos intangibles	A	-	13,892,255	13,892,255
Otros activos	A	<u>213,313,516</u>	<u>(211,939,329)</u>	<u>1,374,187</u>
Total activos		<u>5,399,910,863</u>	<u>-</u>	<u>5,399,910,863</u>
PASIVOS Y PATRIMONIO				
Pasivos financieros:				
A valor razonable	A	1,029,862,457	8,599	1,029,871,056
A valor razonable -Instrumentos financieros derivados	A	-	123,660,044	123,660,044
A costo amortizado:	A			-
Obligaciones con bancos	A	1,804,919,010	2,436,969	1,807,355,979
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos				
a corto plazo	A	1,000,000,000	11,303,402	1,011,303,402
Otras cuentas por pagar	A	13,740,371	(308,102)	13,432,269
Cuentas por pagar a relacionadas	A	-	37,108	37,108
Acumulaciones y otras obligaciones	A	<u>165,672,893</u>	<u>(137,138,020)</u>	<u>28,534,873</u>
Total pasivos		<u>4,014,194,731</u>	<u>-</u>	<u>4,014,194,731</u>
Patrimonio				
Capital		439,282,600	-	439,282,600
Aportes para futura capitalización		138	-	138
Reserva Legal		87,856,520	-	87,856,520
Resultados acumulados		<u>858,576,874</u>	<u>-</u>	<u>858,576,874</u>
Total de patrimonio		<u>1,385,716,132</u>	<u>-</u>	<u>1,385,716,132</u>
Total pasivos y patrimonio		<u>5,399,910,863</u>	<u>-</u>	<u>5,399,910,863</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Adopción por primera vez (continuación)

6.3 Conciliación del patrimonio al 31 de diciembre de 2016

	Notas	Prácticas de contabilidad SIV	Reclasificaciones	Balance NIIF
ACTIVOS				
Efectivo y equivalente de efectivo	A	1,139,020,577	142,344,914	1,281,365,491
Inversiones en instrumentos financieros:				
A valor razonable con cambios en resultados	A	4,376,793,314	(834,119,208)	3,542,674,106
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	A	-	51,471,630	51,471,630
A costo amortizado corto plazo	A	587,431,134	(28,495,905)	558,935,229
Otras cuentas por cobrar	A	111,165,420	(46,035,990)	65,129,430
Anticipos de impuesto sobre la renta	A	-	93,919,813	93,919,813
Impuestos diferidos	A	-	12,568,769	12,568,769
Activo diferido corto plazo	A	-	9,231,346	9,231,346
Activos corrientes		6,214,410,445	(599,114,631)	5,615,295,814
Inversiones en instrumentos financieros:				
A costo amortizado largo plazo	A	-	799,593,017	799,593,017
Inversiones en acciones		28,385,553	-	28,385,553
Mobiliario y equipos		6,725,199	-	6,725,199
Activos intangibles	A	-	11,307,239	11,307,239
Otros activos	A	238,235,913	(235,633,270)	2,602,643
Activo diferido largo plazo		-	-	23,847,645
Total activos		6,487,757,110	-	6,487,757,110
PASIVOS Y PATRIMONIO				
Pasivos financieros:				
A valor razonable	A	2,126,512,451	4,903,659	2,131,416,110
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	A	-	228,831,903	228,831,903
A costo amortizado:	A			
Obligaciones con bancos	A	1,733,203,202	2,018,373	1,735,221,575
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a corto plazo	A	675,000,000	(665,503,644)	9,496,356
Otras cuentas por pagar	A	11,514,729	(6,136,661)	5,378,068
Acumulaciones y otras obligaciones	A	286,434,316	(239,113,630)	47,320,686
Total Pasivos corrientes		4,832,664,698	(675,000,000)	4,157,664,698
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos a largo plazo	A	-	675,000,000	675,000,000
Total pasivos		4,832,664,698	-	4,832,664,698
Capital		650,000,000	-	650,000,000
Aportes para futura capitalización		138	-	138
Reserva Legal		130,000,000	-	130,000,000
Resultados acumulados		875,092,274	-	875,092,274
Total de patrimonio		1,655,092,412	-	1,655,092,412
Total pasivos y patrimonio		6,487,757,110	-	6,487,757,110

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

6. Adopción por primera vez (continuación)

6.4 Conciliación del resultado correspondiente al período terminado el 31 de diciembre de 2016

		Prácticas de contabilidad SIV	Reclasificaciones	Balance NIIF
	Nota			
Resultado por instrumentos financieros				
Ingresos financieros y operativos	A	553,508,322	(553,508,322)	-
Gastos financieros y operativos	A	(314,074,036)	314,074,036	-
Otros gastos operativos	A	(2,715,983,481)	2,715,983,481	-
Otros ingresos operativos	A	2,977,398,116	(2,977,398,116)	-
A valor razonable.	A	-	1,298,322,568	1,298,322,568
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados.	A	-	(800,472,123)	(800,472,123)
A costo amortizado.	A	-	134,295,617	134,295,617
Total resultados por instrumentos financieros		500,848,921	131,297,141	632,146,062
Resultado por intermediación				
Comisiones por operaciones bursátiles y extrabursátiles	A	(6,209,320)	6,912,261	702,941
Gastos por comisiones y servicios	A	-	(20,225,157)	(20,225,157)
Total Resultados por intermediación		(6,209,320)	(13,312,896)	(19,522,216)
Gastos por financiamiento	A	-	(156,622,869)	(156,622,869)
Gastos de administración y comercialización	A	(208,453,946)	(6,209,320)	(214,663,266)
Otros resultados				
Ganancia en cambio de moneda extranjera, neta	A	-	16,295,561	16,295,561
Resultado de inversiones en sociedades	A	-	489	489
Ingresos financieros	A	-	27,420,641	27,420,641
Otros ingresos	A	-	1,131,253	1,131,253
Total otros resultados		-	44,847,944	44,847,944
Resultado antes del impuesto sobre la renta		286,185,655	-	286,185,655
Impuesto sobre la renta		(16,809,374)	-	(16,809,374)
Utilidad neta		269,376,281	-	269,376,281

6.5 Notas a las conciliaciones del patrimonio al 1ro. de enero del 2016 y el 31 de diciembre del 2016 y del resultado al 31 de diciembre del 2016

- A. Los principales efectos durante el proceso de adopción corresponden que las cifras de activos y pasivos del estado de situación financiera al 1ro. de enero de 2016 y al 31 de diciembre de 2016 y del estado de resultados por el año terminado el 31 de diciembre de 2016, fueron reclasificadas para estar de acuerdo con la presentación del año terminado el 31 de diciembre de 2017. Estas reclasificaciones fueron realizadas con la finalidad de cumplir con requerimientos de revelación y presentación establecidos por las Normas Internacionales de Información Financiera ("NIIF"), el detalle de estas reclasificaciones se incluyen en la sección 6.2, 6.3 y 6.4.

Durante el proceso de adopción a NIIF la Compañía no identificó ningún cambio significativo que produjera una disminución y/o deterioro en sus activos financieros y no financieros que deba reconocerse al 1ro. de enero de 2016 y 31 de diciembre de 2016.

La transición de prácticas de contabilidad establecidas por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana a NIIF, no tuvo impacto significativo en los estados de flujos de efectivo.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

7. 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), dólares canadienses (CAD) y guaraníes (PYG) incluidos a su equivalente en pesos dominicanos en los distintos rubros de los estados de situación financiera que se acompañan.

	<u>31 de diciembre de</u>		<u>1ro. de enero</u>
	<u>2017</u>	<u>2016</u>	<u>de 2016</u>
	<u>USD</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>
Activos:			
Efectivo y equivalente de efectivo	36,735,702	15,716,002	8,995,219
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	27,783,291	26,603,483	12,346,832
A valor razonable instrumentos financieros derivados	107,225	238,904	688,918
A costo amortizado	-	11,908,868	-
Otras cuentas por cobrar	96,961	32,841	-
Otros activos	20,165	-	326,101
Activo diferido	-	708,161	-
	<u>64,743,344</u>	<u>55,208,259</u>	<u>22,357,070</u>
Pasivos:			
Pasivos financieros a su valor razonable	(32,440)	(3,336,015)	(711,422)
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(509,375)	(412,354)	(129,368)
Obligaciones con bancos	-	(32,800,000)	(35,200,000)
Otras cuentas por pagar	(78,887)	-	(51,949)
Acumulaciones y otras obligaciones	-	(29,667)	(237,032)
	<u>(620,702)</u>	<u>(36,578,036)</u>	<u>(36,329,771)</u>
Posición monetaria neta activa (pasiva)	<u>64,122,642</u>	<u>18,630,223</u>	<u>(13,972,701)</u>

	<u>31 de diciembre de</u>		<u>1ro. de enero</u>
	<u>2017</u>	<u>2016</u>	<u>de 2016</u>
	<u>EUR</u>	<u>EUR</u>	<u>EUR</u>
Activos:			
Efectivo y equivalente de efectivo	1,198	23,453	1,583
Otros activos	-	-	15,645
	<u>1,198</u>	<u>23,453</u>	<u>17,228</u>
Posición monetaria neta activa	<u>1,198</u>	<u>23,453</u>	<u>17,228</u>

	<u>31 de diciembre de</u>		<u>1ro. de enero</u>
	<u>2017</u>	<u>2016</u>	<u>de 2016</u>
	<u>PYG</u>	<u>PYG</u>	<u>PYG</u>
Activos:			
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	25,032,900,000	23,250,000,000	23,201,735,000
Posición monetaria neta activa	<u>25,032,900,000</u>	<u>23,250,000,000</u>	<u>23,201,735,000</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

7. Saldos en moneda extranjera (continuación)

	<u>31 de diciembre de</u>		<u>1ro. de enero</u>
	<u>2017</u>	<u>2016</u>	<u>de 2016</u>
	<u>CAD</u>	<u>CAD</u>	<u>CAD</u>
Activos:			
Inversiones en instrumentos financieros:			
A valor razonable con cambios en resultados	-	2,727,186	-
Posición monetaria neta activa	-	2,727,186	-

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

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2017</u> <u>PYG</u>	<u>CAD</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	7,578,653	1,672,153	-	-	9,250,806
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	21,671,258	-	12,479,244	1,264,826	35,415,328
A valor razonable instrumentos financieros derivados	(15,747,636)	-	-	-	(15,747,636)
A costo amortizado	15,651,307	-	-	-	15,651,307
Otras cuentas por cobrar	16,872,487	-	-	-	16,872,487
Otros activos	21,122	-	-	-	21,122
Pasivos financieros:					
A valor razonable	(5,990,627)	-	-	-	(5,990,627)
	40,056,564	1,672,153	12,479,244	1,264,826	55,472,787

	<u>USD</u>	<u>EUR</u>	<u>2016</u> <u>PYG</u>	<u>CAD</u>	<u>Total</u>
Efectivo y equivalentes de efectivo	(16,943,092)	(28,757)	-	-	(16,971,849)
Inversiones en instrumentos financieros:					
A valor razonable con cambios en resultados	26,648,804	-	4,678,430	(52,618)	31,274,616
A valor razonable instrumentos financieros derivados	3,618,664	-	-	-	3,618,664
A costo amortizado	(358,713)	-	-	-	(358,713)
Otras cuentas por cobrar	(94,240)	-	-	-	(94,240)
Pasivos financieros:					
A valor razonable	(1,172,917)	-	-	-	(1,172,917)
	11,698,506	(28,757)	4,678,430	(52,618)	16,295,561

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

8. Efectivo y equivalentes de efectivo

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

	2017	2016	1ro. enero de 2016
Efectivo en caja	20,000	20,000	20,000
Efectivo en bancos (a)			
Cuentas de ahorros:			
Denominadas en monedas extranjeras	562,119,370	638,399,747	406,096,591
Cuentas corrientes:			
Denominadas en pesos dominicanos	276,689,382	497,189,079	221,072,671
Denominadas en monedas extranjeras	2,651,164	3,411,751	3,675,221
Equivalentes de efectivo: (b)			
Denominadas en pesos dominicanos	-	48,781,200	-
Denominadas en monedas extranjeras	1,209,372,801	93,563,714	-
	2,050,852,717	1,281,365,491	630,864,483

(a) Al 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016, el efectivo depositado en cuentas de ahorros y corrientes devenga un interés basado en las tasas diarias determinadas por los bancos correspondientes. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP25,523,277 (2016: DOP24,114,158), los cuales se incluyen dentro de los ingresos financieros en los estados de resultados integrales que se acompañan.

(b) Al 31 de diciembre de 2017, corresponden a certificados de depósitos en dólares estadounidenses los cuales devengan tasas de interés anual que oscilan entre 1.3% y 3.2% (2016: 4%).

Al 31 de diciembre de 2016, corresponden a certificados de depósitos en pesos dominicanos los cuales devengaban tasas de interés anual que oscilan entre 4% y 7.5%.

El vencimiento de estos certificados en dólares estadounidenses y pesos dominicanos son iguales o inferiores a tres meses a la fecha de adquisición. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendentes a DOP8,450,573 (2016: DOP3,306,483), los cuales se incluyen dentro de los ingresos financieros en los estados de resultados integrales que se acompañan.

Al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, no existen diferencias entre el valor registrado y el valor razonable de estos activos financieros.

Al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, no existían restricciones de uso sobre los saldos de efectivo y equivalentes de efectivo.

9. Certificado financiero

Al 31 de diciembre de 2017, corresponde a certificado de depósito mantenido con una institución financiera local, cuyo vencimiento es mayor a tres meses a la fecha de adquisición, el cual devenga interés a una tasa anual de 3%. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció ingresos por intereses por este concepto ascendente a DOP5,029,072, los cuales se incluyen dentro de los ingresos financieros en el estado de resultados integrales que se acompaña.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

10. 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:

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
Titulos / valores de deuda (a):			
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	3,275,003,871	286,077,365	3,249,927,575
Banco Central de República Dominicana	410,917,292	2,133,515,709	518,311,645
Banco Multiple Caribe Internacional, S. A.	-	33,111,689	36,142,488
Asociación La Nacional de Ahorros y Préstamos	52,662,400	-	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	32,795,761	75,524,355	150,679,994
Consortio Energético Punta Cana Macao, S. A.	53,938,812	-	-
Consortio Remix, S. A.	30,712,922	-	-
Dominican Power Partners	479,754,581	-	-
EDENORTE Dominicana S. A.	187,318,127	-	-
EDESUR Dominicana, S. A.	151,769,078	-	-
United Capital Puesto de Bolsa S. A.	-	14,008,642	14,008,145
Empresa Generadora de Electricidad Haina S. A.	76,457,617	2,939,083	487,683
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	1,002,977	4,833,222	31,566,058
Bonos Pacific Rubiales	-	-	99,345,412
ODEBRECHT	-	-	58,758,318
	<u>4,752,333,438</u>	<u>2,550,010,065</u>	<u>4,159,227,318</u>
Aportes en fondos de inversión (b):			
Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 Días	1,487,256	-	-
Fondo De Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	2,527,630	-	-
AFI Universal - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	15,872,453	5,145,319	-
BHD Liquidez - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	122,498,717	50,613,427	-
Fondo Mutuo Renta Fija Bhd Plazo 30 Días	422,460	-	-
Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	18,013	-	-
Fideicomiso de Valores Inmobiliarios Fiduciaria Popular	5,827,257	-	-
JMMB Fondo de Inversión Cerrado	7,617,240	-	-
PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	17,876,810	17,062,012	-
PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	1,157,821	1,107,503	19,248,349
GAM - Fondo Cerrado GAM Energia	-	498,517,675	157,174,200
GAM - Fondo de Inversión Cerrado de Renta Fija	190,712,654	135,195,432	-
	<u>366,018,311</u>	<u>707,641,368</u>	<u>176,422,549</u>
Inversiones en acciones(c):			
Banco Continental	215,795,207	188,320,836	182,081,448
ProShares SQQQ	25,709,652	1,825,937	-
Globant	6,728,125	-	-
Pacific Exploration & Proud Equity	-	94,875,900	-
	<u>248,232,984</u>	<u>285,022,673</u>	<u>182,081,448</u>
	<u>5,366,584,733</u>	<u>3,542,674,106</u>	<u>4,517,731,315</u>

- (a) Corresponden a inversiones de títulos / valores de renta fija emitidos por entidades estatales y privadas, que generan intereses a tasas anuales que oscilan entre 9.45% y 18.5% en pesos dominicanos y para dólares estadounidenses oscilan entre 5.5% y 10% anual, el rango de vencimiento de estos títulos / valores oscila entre el año 2018 y 2032. Estas inversiones de títulos / valores se registran a su valor razonable mediante técnicas de valoración que incluyen datos observables del mercado.

Al 31 de diciembre de 2017, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP134,742,353 (2016: DOP108,834,051) (1ro. de enero de 2016: DOP139,305,665), 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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía posee inversiones de títulos / valores de renta fija por un importe de DOP1,714,138,717 (2016: DOP2,085,759,773) y al (1ro. de enero de 2016: DOP2,432,121,107) emitidas por el Ministerio de Hacienda de República Dominicana y el Banco Central de la República Dominicana, los cuales garantizan deudas a corto plazo de la Compañía con entidades financieras nacionales por un importe aproximado de DOP1,860,000,000 (2016: DOP1,735,000,000) (1ro. de enero de 2016: DOP1,807,000,000).

- (b) Corresponden a las inversiones realizadas por la Compañía mediante aportes en fondos de inversión en la República Dominicana que invierten su capital en búsqueda de rentabilidad, los recursos aportados a los fondos de inversión en la República 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 2017, publicados por la Superintendencia de Valores de la República Dominicana:

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
A- hasta A+	4,597,104,875	3,149,939,135	4,095,788,824
BBB- hasta BBB+	39,333,139	51,953,552	81,716,691
Calificaciones de riesgo no disponible a la fecha	730,146,719	340,781,419	340,225,800
	5,366,584,733	3,542,674,106	4,517,731,315

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:

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

10. 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:

2017				
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	4,752,333,438	-	4,752,333,438	-
Aportes en fondos de inversión	366,018,311	366,018,311	-	-
Inversiones en acciones	248,232,984	32,437,777	215,795,207	-
	<u>5,366,584,733</u>	<u>398,456,088</u>	<u>4,968,128,645</u>	<u>-</u>
2016				
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	2,550,010,065	-	2,550,010,065	-
Aportes en fondos de inversión	707,641,368	707,641,368	-	-
Inversiones en acciones	285,022,673	96,701,837	188,320,836	-
	<u>3,542,674,106</u>	<u>804,343,205</u>	<u>2,738,330,901</u>	<u>-</u>
1ro. de enero de 2016				
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Títulos / valores de deuda	4,159,227,318	-	4,159,227,318	-
Aportes en fondos de inversión	176,422,549	176,422,549	-	-
Inversiones en acciones	182,081,448	-	182,081,448	-
	<u>4,517,731,315</u>	<u>176,422,549</u>	<u>4,341,308,766</u>	<u>-</u>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, la Compañía producto de las ventas, rendimientos y valoraciones de las inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados, produjo ganancias netas por un importe ascendente a DOP2,236,825,109 (2016: DOP1,360,605,736), las cuales se incluyen dentro de los resultados por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados integrales que se acompañan.

11. Instrumentos financieros a su valor razonable derivados

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

	Al 31 de diciembre 2017	2016	1ro. de enero de 2016
Activo:			
A valor razonable - instrumentos financieros derivados (a)	<u>60,106,379</u>	<u>51,471,630</u>	<u>78,145,022</u>
Pasivo:			
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados (b)	<u>(823,544,771)</u>	<u>(228,831,903)</u>	<u>(123,660,044)</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

11. 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:

	Al 31 de diciembre 2017	2016	1ro. de enero de 2016
Personas físicas	16,713,148	5,657,169	24,848,789
Personas jurídicas	5,618,550	2,518,521	4,865,106
Intermediarios de valores	4,848,822	8,871,372	-
Inversionista institucional	6,590,567	569,480	-
Partes relacionadas	13,043,130	12,782,315	31,514,414
Instituciones financieras	13,292,162	21,072,773	16,916,713
	60,106,379	51,471,630	78,145,022

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 son presentadas a continuación:

	2017			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	44,016,609	-	44,016,609	-
Banco Central de República Dominicana	4,940,409	-	4,940,409	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	7,142,423	-	7,142,423	-
Dominican Power Partners	4,006,938	-	4,006,938	-
	60,106,379	-	60,106,379	-
	2016			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Inversiones en instrumentos financieros a valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	24,746,659	-	24,746,659	-
Banco Central de República Dominicana	12,805,795	-	12,805,795	-
Banco Múltiple Santa Cruz, S. A.	13,770,994	-	13,770,994	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	148,182	-	148,182	-
	51,471,630	-	51,471,630	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Instrumentos financieros derivados	1ro. de enero de 2016			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Inversiones en instrumentos financieros valor razonable - instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	42,604,840	-	42,604,840	-
Banco Central de República Dominicana	4,156,924	-	4,156,924	-
ODEBRECHT	6,574,796	6,574,796	-	-
Pacific Rubiales Energy Corp	24,722,272	24,722,272	-	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	86,190	-	86,190	-
	78,145,022	31,297,068	46,847,954	-

- (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:

	Al 31 de diciembre		1ro. de enero de 2016
	2017	2016	
Personas físicas	(151,184,434)	(42,808,680)	(67,261,650)
Personas jurídicas	(135,430,277)	(48,180,175)	(29,031,206)
Intermediarios de valores	(37,971,059)	(6,611,951)	-
Inversionista institucional	(242,378,557)	(83,231,808)	(3,147,323)
Partes relacionadas	(28,685,082)	(33,739,496)	(2,153,358)
Instituciones financieras	(227,895,362)	(14,259,793)	(22,066,507)
	(823,544,771)	(228,831,903)	(123,660,044)

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 son presentadas a continuación:

Instrumentos financieros derivados	2017			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(815,610,793)	-	(815,610,793)	-
Banco Central de República Dominicana	(2,935,380)	-	(2,935,380)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(2,431,577)	-	(2,431,577)	-
Dominican Power Partners	(2,567,021)	-	(2,567,021)	-
	(823,544,771)	-	(823,544,771)	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

	2016			
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(183,256,044)	-	(183,256,044)	-
Banco Central de República Dominicana	(45,501,471)	-	(45,501,471)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(14,791)	-	(14,791)	-
Empresa Generadora de Electricidad Haina	(59,597)	-	(59,597)	-
	<u>(228,831,903)</u>	<u>-</u>	<u>(228,831,903)</u>	<u>-</u>
1ro. de enero de 2016				
	Valor Razonable	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3
Instrumentos financieros derivados				
Pasivos financieros a su valor razonable				
Instrumentos financieros derivados:				
Ministerio de Hacienda de República Dominicana	(87,391,707)	-	(87,391,707)	-
Banco Central de República Dominicana	(34,487,796)	-	(34,487,796)	-
Banco de Reservas de la República Dominicana	(1,780,541)	-	(1,780,541)	-
	<u>(123,660,044)</u>	<u>-</u>	<u>(123,660,044)</u>	<u>-</u>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, la Compañía producto de las valoraciones de los instrumentos financieros a su valor razonable derivados, se produjo pérdidas netas por un importe ascendente a DOP1,428,745,242 (2016: DOP800,472,123), las cuales se presentan como resultados por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

11. Instrumentos financieros a su valor razonable (continuación)

Los contratos derivados financieros emitidos por la entidad, fueron:

	2017		2016	
	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP	Valor en Libros DOP	Valor Razonable DOP
Forward	(763,438,391)	(763,438,391)	(177,360,273)	(177,360,273)

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

	2017		2016	
	USD	DOP	USD	DOP
Forward	(3,676,709)	(759,761,682)	13,201,554	(190,561,827)

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

	2017			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	(214,603,199)	(51,514,385)	(236,207,491)	(261,113,317)

	2016			
	Bancos Comerciales	Corredores de Bolsa	Entidades Reguladas	Entidades No Reguladas
Forward	(32,991,956)	2,259,421	(63,843,751)	(82,783,986)

Las condiciones pactadas para estos contratos, son como sigue:

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

	2016				
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses	3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
Forward	(20,357,461)	(93,532,053)	(54,830,891)	(22,410,862)	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

11. Instrumentos financieros a su valor razonable (continuación)

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

			2017 3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses			
Forward	(356,003,802)	(252,127,095)	(155,307,494)	-	-
			2016 3 meses a 1 año	De 1-5 años	Más de 5 años
	Hasta 1 mes	De 1-3 meses			
Forward	(85,844,402)	(81,947,964)	(23,317,482)	(21,420)	-

12. Inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado

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

	Al 31 de diciembre 2017	2016	1ro. de enero de 2016
En fecha 16 de febrero de 2016, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual el Banco del Reservas de la Republica Dominicana le transfiere a la Compañía la deuda emitida por el Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, por un importe original de DOP200,000,000, este contrato devenga interés de 16% anual, con vencimiento en diciembre del año 2018, pagadero en 60 cuotas iguales y consecutivas de DOP33,333,333, más intereses y está garantizado por el Estado Dominicano.	401,066,667	802,134,513	-
En fecha 19 de diciembre de 2016, la Compañía firmó un contrato de cesión de crédito, en el cual una entidad relacionada le transfiere a la Compañía la deuda emitida por EDESUR Dominicana, S. A., por un importe original de USD15,117,449, equivalentes a DOP708,955,354, este contrato devenga interés de 16% anual, con vencimiento en julio del año 2020, pagadero en 41 cuotas iguales y consecutivas de USD275,953, equivalente a DOP12,890,097, más intereses y está garantizado por el Estado Dominicano. Este préstamo fue transferido a una relacionada en su totalidad durante el año 2017.	-	556,276,301	-
Corresponde a préstamo de margen otorgado para la compra de títulos valores, estableciendo como garantía el mismo título, devengaba interés de 14% anual. Este préstamo fue cobrado en su totalidad durante el año 2017.	-	117,432	119,253
	401,066,667	1,358,528,246	119,253
	(401,066,667)	(558,935,229)	(119,253)
Porción corriente	-	799,593,017	-

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

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

	31 de diciembre de		1ro. de
	2017	2016	enero de 2016
2016	-	-	119,253
2017	-	558,935,229	-
2018	401,066,667	554,681,168	-
2019	-	154,681,168	-
2020	-	90,230,681	-
	<u>401,066,667</u>	<u>1,358,528,246</u>	<u>119,253</u>

Al 31 de diciembre de 2016, la prima pagada por concepto de la transferencia realizada del préstamo a EDESUR Dominicana, S. A. ascendió a USD708,161, equivalentes a DOP33,078,991, cuya porción corriente asciende a DOP9,231,346 y la porción a largo plazo asciende a DOP23,847,645, la cual se presenta como activo diferido en el estado de situación financiera que se acompaña.

Al 31 de diciembre de 2017, el saldo pendiente de intereses por cobrar por este concepto asciende a DOP1,066,667 (2016: DOP4,136,629), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado en los estados de situación financiera que se acompañan.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció ingresos por intereses por concepto de las inversiones en instrumentos financieros a su costo amortizado por un importe aproximado de DOP138.0 millones (2016: DOP134.3 millones), los cuales se presentan como resultado por instrumentos financieros - a costo amortizado en los estados de resultados integrales que se acompañan.

13. Otras cuentas por cobrar

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

	Al 31 de diciembre		1ro. de enero
	2017	2016	de 2016
Interés por cobrar (a)	142,868,089	63,193,297	22,697,659
Cuentas por cobrar empleados	1,388,237	1,720,666	1,750,468
Anticipos a proveedores	115,687	28,000	1,274,029
Otras	205,099	187,467	80,964
	<u>144,577,112</u>	<u>65,129,430</u>	<u>25,803,120</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.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

13. Otras cuentas por cobrar (continuación)

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

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	
2017	142,868,089	364,638	370,463	973,922	144,577,112
2016	63,193,297	1,063,906	414,162	458,065	65,129,430
1ro. de enero de 2016	22,697,659	2,203,433	443,965	458,063	25,803,120

14. Inversiones en acciones

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

	Al 31 de diciembre		1ro. de enero de 2016	Porcentaje
	2017	2016		
Bolsa de Valores de la República Dominicana (a)	28,384,353	28,384,353	28,384,353	9.9999%
CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A. (b)	1,200	1,200	1,200	0.00003%
	<u>28,385,553</u>	<u>28,385,553</u>	<u>28,385,553</u>	

(a) Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. fue constituida el 15 de mayo de 2001, bajo la razón social Bolsa Nacional de Valores. Posteriormente, en fecha 8 de abril de 2002, cambió formalmente su nombre a Bolsa de Valores de la República Dominicana, S.A. Su objetivo principal es prestar todos los servicios necesarios para la efectiva realización de transacciones con valores, así como toda actividad que contribuya al desarrollo del mercado de valores. La Bolsa de Valores es a su vez propietaria del 33% de CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A.

(b) 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.

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, los ingresos generados por estas inversiones ascienden a DOP561 (2016: DOP489), los cuales se presentan en el renglón de resultado de inversiones en sociedades en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

15. Mobiliario y equipos

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

	Mobiliarios y Equipos	Equipos de Transporte	Total
Costo de adquisición:			
Al 1ro. de enero de 2016	11,584,459	2,235,012	13,819,471
Adiciones	484,054	94,400	578,454
Al 31 de diciembre de 2016	12,068,513	2,329,412	14,397,925
Adiciones	1,833,077	2,044,995	3,878,072
Retiros	(5,024,405)	(1,110,450)	(6,134,855)
Reclasificación (nota 16)	1,388,426	-	1,388,426
Al 31 de diciembre de 2017	10,265,611	3,263,957	13,529,568
Depreciación acumulada:			
Al 1ro. de enero de 2016	(3,616,048)	(696,305)	(4,312,353)
Gasto de depreciación	(2,912,146)	(448,227)	(3,360,373)
Al 31 de diciembre de 2016	(6,528,194)	(1,144,532)	(7,672,726)
Gasto de depreciación	(3,623,587)	(148,276)	(3,771,863)
Retiros	4,055,490	473,386	4,528,876
Al 31 de diciembre de 2017	(6,096,291)	(819,422)	(6,915,713)
Valor en libros:			
Al 31 de diciembre de 2017	4,169,320	2,444,535	6,613,855
Al 31 de diciembre de 2016	5,540,319	1,184,880	6,725,199
Al 1ro. de enero de 2016	7,968,411	1,538,707	9,507,118

Al 31 de diciembre 2017, la Compañía mantiene activos en uso totalmente depreciados con un costo de adquisición aproximado de DOP3,600,000 (2016: DOP1,500,000) (1ro. de enero de 2016: DOP1,200,000).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

16. Cargos diferidos

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

	Mejoras en Propiedades Arrendadas	Licencias	Total
Costo de adquisición:			
Al 1ro. de enero de 2016	12,079,636	6,778,067	18,857,703
Adiciones	45,068	1,196,526	1,241,594
Al 31 de diciembre de 2016	12,124,704	7,974,593	20,099,297
Adiciones	370,331	1,116,400	1,486,731
Reclasificación (nota 15)	(1,388,426)	-	(1,388,426)
Al 31 de diciembre de 2017	11,106,609	9,090,993	20,197,602
Amortización acumulada:			
Al 1ro. de enero de 2016	(2,295,691)	(2,669,757)	(4,965,448)
Gasto de amortización	(2,383,926)	(1,442,684)	(3,826,610)
Al 31 de diciembre de 2016	(4,679,617)	(4,112,441)	(8,792,058)
Gasto de amortización	(1,449,762)	(2,077,440)	(3,527,202)
Al 31 de diciembre de 2017	(6,129,379)	(6,189,881)	(12,319,260)
Valor en libros:			
Al 31 de diciembre de 2017	4,977,230	2,901,112	7,878,342
Al 31 de diciembre de 2016	7,445,087	3,862,152	11,307,239
Al 1ro. de enero de 2016	9,783,945	4,108,310	13,892,255

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía mantiene programas de cómputo en uso totalmente amortizados con un costo de adquisición de aproximadamente DOP570,000 (2016: DOP560,000) (1ro. de enero de 2016: DOP400,000).

17. 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:

	2017			Valor razonable
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	878,544,291	-	878,544,291
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	2,746,300,320	-	2,746,300,320
	-	3,624,844,611	-	3,624,844,611
	2016			Valor razonable
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	1,543,732,139	-	1,543,732,139
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	587,683,971	-	587,683,971
	-	2,131,416,110	-	2,131,416,110

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

17. Pasivos financieros a su valor razonable (continuación)

	1ro. de enero de 2016			Valor razonables
	Nivel 1	Nivel 2	Nivel 3	
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Banco Central de la República Dominicana	-	989,885,552	-	989,885,552
Ministerio de Hacienda de la República Dominicana	-	39,985,504	-	39,985,504
	-	<u>1,029,871,056</u>	-	<u>1,029,871,056</u>

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

	2017				Totales
	Hasta 1 mes	1 a 3 meses	3 meses a 1 año	1 a 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable:					
Indexados a Títulos					
Valores	2,017,587,380	1,083,058,484	524,198,747	-	3,624,844,611
	<u>2,017,587,380</u>	<u>1,083,058,484</u>	<u>524,198,747</u>	-	<u>3,624,844,611</u>
	2016				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	1,153,303,671	714,688,841	263,423,598	-	2,131,416,110
	<u>1,153,303,671</u>	<u>714,688,841</u>	<u>263,423,598</u>	-	<u>2,131,416,110</u>
	1ro. de enero de 2016				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	523,814,571	253,717,099	246,661,044	5,678,342	1,029,871,056
	<u>523,814,571</u>	<u>253,717,099</u>	<u>246,661,044</u>	<u>5,678,342</u>	<u>1,029,871,056</u>

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, 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 DOP40,575,846 (2016: DOP62,283,168), las cuales se incluyen dentro resultados integrales por instrumentos financieros a valor razonable en los estados de resultados que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Obligaciones con bancos

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

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
Banco Popular Dominicano, S. A.			
Préstamo adquirido en fecha 17 de septiembre de 2015, por un importe original de USD13,200,000, equivalentes a DOP616,586,652, el cual causaba una tasa de interés de 4.10% anual, con vencimiento en el mes de septiembre del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	-	603,755,050
Préstamo adquirido en fecha 11 de octubre de 2016, por un importe original de USD5,000,000, equivalentes a DOP233,555,500, el cual causa una tasa de interés de 4.45% anual, con vencimiento en el mes de octubre del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	234,132,901	-
Préstamo adquirido en fecha 31 de octubre de 2016, por un importe original de USD2,800,000, equivalentes a DOP130,791,108, el cual causa una tasa de interés de 4.45% anual, con vencimiento en el mes de octubre del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	130,791,080	-
Préstamo adquirido en fecha 28 de noviembre de 2016, por un importe original de USD5,000,000, equivalentes a DOP233,555,500, el cual causa una tasa de interés de 4.45% anual, con vencimiento en el mes de octubre del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	233,642,110	-
Préstamo adquirido en fecha 5 de febrero de 2014, por un importe original de DOP885,444, el cual causa una tasa de interés de 12.00% anual.	200,139	635,440	785,057
Préstamo adquirido en fecha 15 de abril de 2016, por un importe original de DOP903,120, el cual causa una tasa de interés de 12.50% anual.	239,446	443,681	619,072
Préstamo adquirido en fecha 17 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP900,000,000, el cual causa una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de octubre del año 2018. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10).	903,337,778	-	-
Van	903,777,363	599,645,212	605,159,179

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Obligaciones con bancos (continuación)

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
Vienen	903,777,363	599,645,212	605,159,179
<u>Banco Popular Dominicano, S. A. (continuación)</u>			
Préstamo adquirido en fecha 17 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP60,000,000, el cual causa una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de marzo del año 2018. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10).	60,078,889	-	-
<u>Préstamo con la Asociación Cibao de Ahorros y préstamos, S. A.</u>			
Préstamo adquirido en fecha 29 de diciembre de 2016, por un importe original de DOP200,000,000, el cual causa una tasa de interés de 10.5% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	200,116,667	-
Préstamo adquirido en fecha 30 de noviembre de 2017, por un importe original de DOP400,000,000, el cual causa una tasa de interés de 7.1% anual, con vencimiento en el mes de septiembre del año 2018. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10).	400,000,000	-	-
Préstamo adquirido en fecha 30 de julio de 2015, por un importe original de DOP150,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 9.75% anual, con vencimiento en el mes de julio del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	-	150,000,000
Préstamo adquirido en fecha 27 de noviembre de 2015, por un importe original de DOP50,000,000, el cual causaba una tasa de interés de 10.75% anual, con vencimiento en el mes de noviembre del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.	-	-	50,000,000
Van	1,363,856,252	799,761,879	805,159,179

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Obligaciones con bancos (continuación)

		2017	2016	1ro. de enero de 2016
	Vienen	1,363,856,252	799,761,879	805,159,179
Banco BANESCO				
Préstamo adquirido en fecha 26 de noviembre de 2015, por un importe original de USD2,000,000, equivalentes a DOP93,422,220, el cual causaba una tasa de interés de 5% anual, con vencimiento en el mes de noviembre del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	-	91,108,800
Citibank, S. A.				
Préstamo adquirido en fecha 16 de diciembre de 2015, por un importe original de USD13,000,000, equivalentes a DOP607,244,430, el cual causaba una tasa de interés de 4% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	-	592,207,200
Préstamo adquirido en fecha 16 de diciembre de 2015, por un importe original de USD7,000,000, equivalentes a DOP326,977,770, el cual causaba una tasa de interés de 4% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2016. Este préstamo estuvo garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2016, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	-	318,880,800
Préstamo adquirido en fecha 11 de octubre de 2016, por un importe original de USD10,000,000, equivalentes a DOP467,111,100, el cual causa una tasa de interés de 4.59% anual, con vencimiento en el mes de junio del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	326,977,700	-
Préstamo adquirido en fecha 31 de octubre de 2016, por un importe original de USD4,000,000, equivalentes a DOP186,844,440, el cual causa una tasa de interés de 4.59% anual, con vencimiento en el mes de junio del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	93,960,031	-
Préstamo adquirido en fecha 15 de diciembre de 2016, por un importe original de USD11,000,000, equivalentes a DOP513,822,210, el cual causa una tasa de interés de 4.59% anual, con vencimiento en el mes de junio del año 2017. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10). Durante el año 2017, este préstamo fue saldado en su totalidad.				
		-	514,521,965	-
	Vienen	1,363,856,252	1,735,221,575	1,807,355,979

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

18. Obligaciones con bancos (continuación)

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
Vienen	1,363,856,252	1,735,221,575	1,807,355,979
Banco BHD León, S. A.			
Préstamo adquirido en fecha 18 de diciembre de 2017, por un importe original de DOP500,000,000, el cual causa una tasa de interés de 7% anual, con vencimiento en el mes de diciembre del año 2018. Este préstamo está garantizado con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana (nota 10).	501,263,889	-	-
	1,865,120,141	1,735,221,575	1,807,355,979

Al 31 de diciembre de 2017, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP4,878,889 (2016: DOP1,018,186) (1ro. de enero de 2016: DOP2,436,969), los cuales se incluyen como parte de este rubro de las obligaciones con bancos en los estados de situación financiera que se acompañan.

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía posee obligaciones con bancos por un importe aproximado de DOP1,860,000,000 (2016: DOP1,735,000,000) (1ro. de enero de 2016: DOP1,807,000,000), 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).

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció gastos de intereses por este concepto de obligaciones con bancos DOP56,838,290 (2016: DOP78,460,904), los cuales se incluyen dentro de los gastos de financiamiento en los estados de resultados integrales que se acompañan.

19. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos

El Consejo Nacional de Valores aprobó mediante la Tercera Resolución de fecha 25 de abril de 2016, el Programa de Emisiones de Bonos Corporativos por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-098 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1604-BC062. Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía mantiene colocado un importe de DOP875,000,000 (2016: DOP675,000,000). Los títulos devengan una tasa de interés 9.5% hasta 9.6% anual, pagaderos de manera trimestral y semestral y con vencimiento en mayo de 2019 y abril de 2020.

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

Tramos	Monto	Tasa Anual	2017		Calendario de Repago
			Fecha de Emisión	Vencimiento	
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
	875,000,000				

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

19. Obligaciones por instrumentos financieros emitidos (continuación)

2016					
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
	<u>675,000,000</u>				

El Consejo Nacional de Valores aprobó en fecha 8 de agosto de 2014 el Programa de Emisiones de Papeles Comerciales por un monto de DOP1,000,000,000, inscrita en el Registro del Mercado de Valores y Productos bajo el registro SIVEM-081 y en la Bolsa de Valores de la República Dominicana con el No. BV1410-PC0024. Al 31 de diciembre de 2015, el total de esta emisión estaba colocado. Los títulos devengaban una tasa de interés 9.0% hasta 9.1% anual, pagaderos mensualmente y con vencimiento en mayo y agosto del año 2016. Durante el año 2016, estos papeles comerciales fueron pagados en su totalidad.

1ro. de enero de 2016					
Tramos	Monto	Tasa Anual	Fecha de Emisión	Vencimiento	Calendario de Repago
1	200,000,000	9.00%	07/05/2015	07/05/2016	Pago al vencimiento
2 al 4	600,000,000	9.10%	07/05/2015	07/05/2016	Pago al vencimiento
5	200,000,000	9.10%	26/08/2015	26/08/2016	Pago al vencimiento
	<u>1,000,000,000</u>				

Al 31 de diciembre de 2017, el saldo pendiente de intereses por pagar por este concepto asciende a DOP12,782,740 (2016: DOP9,496,356) (1ro. de enero de 2016 DOP11,303,402), 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.

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, la Compañía reconoció gastos de intereses por obligaciones por instrumentos financieros emitidos DOP77,857,968 (2016: DOP78,161,965), 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

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Saldos y transacciones con partes relacionadas

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

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

		Al 31 de diciembre 2017	2016	1ro. de enero de 2016
Saldos:	Vínculo			
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable con cambios en resultados				
Parallax Valores Puesto de Bolsa S. A.	Relacionada	1,002,977	4,833,222	31,566,058
GAM - Fondo Cerrado GAM Energía	Relacionada	-	498,517,675	157,174,200
GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	Relacionada	190,712,654	135,195,432	-
		<u>191,715,631</u>	<u>638,546,329</u>	<u>188,740,258</u>
Pasivos financieros a su valor razonable:				
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>(112,374,795)</u>	<u>(33,929,945)</u>	<u>(20,718,936)</u>
Inversiones en instrumentos financieros a su valor razonable - instrumentos financieros derivados				
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>13,043,130</u>	<u>12,782,315</u>	<u>31,514,414</u>
Pasivos a su valor razonable instrumentos financieros derivados:				
Alpha Securities, Inc.	Relacionada	<u>(28,685,082)</u>	<u>(33,739,496)</u>	<u>(2,153,363)</u>
Cuentas por pagar a relacionadas:				
Mercado Electrónico Dominicano, S. A	Relacionada	<u>(2,224,156)</u>	-	<u>(37,108)</u>
			Al 31 de diciembre	2016
Transacciones:				
Resultado por instrumentos financieros				
A valor razonable	Relacionada		189,776,235	131,829,042
A costo amortizado	Relacionada		(120,210)	-
			<u>189,656,025</u>	<u>131,829,042</u>
Gastos de administración y comercialización:				
Arrendamientos (nota 26)	Relacionada		(4,463,015)	(3,645,677)
Servicios generales, planeamiento, estrategia y soporte de tecnología (nota 26)	Relacionada		(25,402,647)	(24,868,275)
			<u>(29,865,662)</u>	<u>(28,513,952)</u>
Dividendos (nota 23):	Accionistas			
Dividendos pagados			225,000,000	-
Retenciones			25,000,000	-
Total			<u>250,000,000</u>	<u>-</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

20. Saldos y transacciones con partes relacionadas (continuación)

Términos y condiciones

Las cuentas por pagar a partes relacionadas, no tienen garantías y no causan intereses. Estos saldos son pagaderos en efectivo y en la moneda funcional de la Compañía. Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017 y 2016, no se ha reconocido ningún deterioro relacionado con estos saldos.

Compensaciones al personal clave

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, las compensaciones al personal clave ascienden a aproximadamente DOP54 millones (2016: DOP51 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.

21. Acumulaciones y otras obligaciones por pagar

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

	Al 31 de diciembre 2017	2016	1ro. de enero de 2016
Retenciones por pagar	3,356,958	2,450,140	2,225,719
Bonificación por pagar	9,907,048	7,455,105	6,036,311
Impuesto sobre la renta por pagar		67,252	95,071
Incentivo al personal por pagar	37,348,882	37,348,189	20,177,772
	<u>50,612,888</u>	<u>47,320,686</u>	<u>28,534,873</u>

22. 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 2017 y 2016 es de 27%. Existen diferencias entre el resultado antes de impuesto sobre la renta, según muestra el estado de resultados integrales y la renta neta imponible determinada de conformidad con el Código Tributario de la República Dominicana. Estas diferencias son reconocidas como diferencias permanentes o temporales según sea el caso.

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

22. Impuesto sobre la renta (continuación)

Gasto de impuesto sobre la renta:

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

	31 de diciembre	
	2017	2016
Impuesto sobre la renta:		
Corriente	43,285,161	-
Activo	-	67,252
Diferido	(13,040,104)	16,742,122
	<u>30,245,057</u>	<u>16,809,374</u>

El impuesto sobre la renta del año terminado el 31 de diciembre de 2017 se determinó sobre la base de la renta neta imponible como resultado que dicho importe fue mayor al determinado sobre la base del 1% de los activos gravables (2016: se determinó sobre la base del 1% de los activos gravables como resultado de que dicho importe fue mayor al determinado sobre la base de la renta neta imponible). A continuación, se presenta una conciliación de la utilidad antes de impuesto:

	2017	2016
Utilidad antes de impuesto sobre la renta	<u>611,194,208</u>	<u>286,185,655</u>
Diferencias permanentes (a)	(465,437,145)	(312,951,136)
Diferencias temporales (b)	<u>14,558,349</u>	<u>(9,441,854)</u>
Utilidad (pérdida) fiscal	<u>160,315,412</u>	<u>(36,207,335)</u>
	27%	27%
Impuesto sobre la renta corriente	<u>43,285,161</u>	<u>-</u>

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

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

Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016, la determinación del impuesto sobre el 1% de los activos se detalla a continuación:

	Al 31 de diciembre de	
	2017	2016
Total activos	9,247,536,907	6,487,757,110
Activos no gravables	<u>(9,240,923,053)</u>	<u>(6,481,031,911)</u>
Total activos gravables	6,613,854	6,725,199
Tasa de impuesto sobre los activos	1%	1%
Impuesto sobre los activos	<u>66,139</u>	<u>67,252</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

22. Impuesto sobre la renta (continuación)

La composición del activo por impuesto sobre la renta diferido al 31 de diciembre 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016, así como el movimiento del mismo durante los años terminados el 31 de diciembre, es como sigue:

	Estado de Situación Financiera			Estado de Resultados	
	31 de diciembre de 2017	2016	1ro. de enero de 2016	2017	2016
Impuesto sobre la renta diferido:					
Diferencia cambiaria	(1,844,996)	(303,189)	-	(1,541,807)	(303,189)
Otras provisiones	5,952,995	146,963	2,700,000	5,806,032	(2,553,038)
Pérdidas trasladables	15,121,835	19,510,715	12,341,912	(4,388,880)	7,168,803
Pérdida no realizada	6,379,039	(6,785,720)	14,268,979	13,164,759	(21,054,698)
Total	25,608,873	12,568,769	29,310,891	13,040,104	(16,742,122)

A continuación presentamos la conciliación entre la tasa de impuesto efectiva y la tasa de impuesto oficial al 31 de diciembre de 2017 y 2016:

	2017	2016
Tasa oficial	27.00%	27.00%
Ingresos exentos Ministerio de Hacienda	(21.08)%	(19.10)%
Ganancia/pérdida no realizada	1.11%	(11.54)%
Otras partidas	(2.08)%	9.51%
Tasa impuesto efectiva	4.95%	5.87%

El movimiento de los anticipos de impuesto sobre la renta para el año terminado al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, es como sigue:

	2017	2016	1ro de enero de 2016
Saldo a favor:			
Anticipos de impuesto sobre la renta al inicio del período	93,919,813	64,777,666	16,730,365
Anticipos de impuesto sobre la renta pagados durante el período	13,286,378	29,142,147	48,047,301
Gasto de impuesto sobre la renta corriente compensado del período	(43,285,161)	-	-
Anticipos de impuesto sobre la renta al final de período	63,921,030	93,919,813	64,777,666

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía dispone de pérdidas trasladables las cuales pueden ser compensadas como sigue:

Años a Compensar	Importe
2018	16,937,824
2019	16,937,824
2020	16,937,824
2021	7,545,609
	58,359,081

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Patrimonio

Capital social suscrito y pagado

Al 31 de diciembre de 2017, el capital social suscrito se encuentra conformado por 9,000,000 (2016: 6,500,000) (1ro. enero de 2016: DOP4,500,000) acciones comunes con valor nominal de DOP100 cada una, emitidas y en circulación. El capital social suscrito y pagado asciende a DOP900,000,000 (2016: DOP650,000,000) (1ro. de enero de 2016: DOP439,282,600, constituido por 9,000,000 (2016: 6,500,000) (1ro. enero de 2016: 4,392,826 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.

En fecha 1ro. de agosto de 2016, mediante acta de la Asamblea General Extraordinaria aprobó el aumento del capital autorizado de la Compañía de DOP500,000,000 a DOP650,000,000. Adicionalmente, se incrementó el capital suscrito y pagado a DOP650,000,000, mediante la capitalización de los resultados acumulados - distribuibles por un importe de DOP210,717,400, equivalentes a 2,107,174 acciones.

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

	2017	2016	1ro. de enero de 2016
Cantidad de acciones:			
<i>Capital social suscrito:</i>			
Número de acciones al inicio	6,500,000	5,000,000	5,000,000
Acciones emitidas durante el año	2,500,000	1,500,000	-
Número de acciones al final	9,000,000	6,500,000	5,000,000
	2017	2016	1ro. de enero de 2016
<i>Capital social suscrito y pagado:</i>			
Número de acciones al inicio	6,500,000	4,392,826	4,392,826
Acciones emitidas durante el año	2,500,000	2,107,174	-
Número de acciones al final	9,000,000	6,500,000	4,392,826

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Patrimonio (continuación)

Capital social suscrito y pagado (continuación)

Valores:	2017	2016	1ro. de enero de 2016
<i>Capital social suscrito:</i>			
Saldo inicial	650,000,000	500,000,000	500,000,000
Acciones emitidas durante el año	250,000,000	150,000,000	-
Saldo final	900,000,000	650,000,000	500,000,000
<i>Capital social suscrito y pagado:</i>			
Saldo inicial	650,000,000	439,282,600	439,282,600
Acciones emitidas durante el año	250,000,000	210,717,400	-
Saldo final	900,000,000	650,000,000	439,282,600

El capital social suscrito y pagado esta poseído de la siguiente manera:

	Acciones Emitidas	Valor Nominal En DOP	Participación
		2017	
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%
		2016	
Milenio Acquisition Inc.	2	200	0.00003%
Servicios Corporativos, Dominicanos, S. A.	6,499,998	649,999,800	99.99997%
Total	6,500,000	650,000,000	100%
		1ro. de enero de 2016	
Milenio Acquisition Inc.	2	200	0.00003%
Servicios Corporativos, Dominicanos, S. A.	4,392,824	439,282,400	99.99997%
Total	4,392,826	439,282,600	100.00%

Reserva de capital

El Artículo 46 de la Ley de Mercado de Valores 19-00, establece que las sociedades que realizan transacciones bursátiles deberán efectuar una reserva que corresponde al 20% del total capital pagado de la Compañía. Esta reserva no está disponible para ser distribuida como dividendos, excepto en el caso de disolución de la Compañía. Al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la reserva de capital es equivalente a dicho porcentaje.

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

En fecha 1ro. de agosto de 2016, mediante acta de la Asamblea General Extraordinaria la Compañía aprobó el aumento de la reserva de capital, mediante la transferencia de los resultados acumulados - distribuíbles por un importe de DOP42,143,480.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

23. Patrimonio (continuación)

Dividendos pagados

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

Índices de riesgo de capital

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

Al 31 de diciembre de 2017, la utilidad por acción de la Compañía asciende a DOP101 (2016: DOP135) (1ro. enero de 2016: DOP195) por cada acción.

Al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la Compañía calificaba dentro de la tipología de Actividades Universales de Intermediación, Corretaje y por Cuenta Propia, de acuerdo a las características de su capital social suscrito y pagado, de su patrimonio líquido y de su patrimonio y garantías de riesgo primario (Nivel 1).

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

	31 de diciembre de			
	2017		2016	
	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>	<u>Índice Mantenido</u>	<u>Índice Requerido</u>
Índice de patrimonio y garantías de riesgo	0.8180	0.103	0.84	0.155
Índice de patrimonio y garantías de riesgo (Nivel 1)	0.8180	0.103	0.84	0.103

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

24. Información por segmento / resultados por líneas de negocios

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

Tipo de Contrato	Comisiones		Al 31 de diciembre de 2017								Total
			Valor Razorable				Otros		A Costo Amortizado		
	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Ajuste a Valor Razorable Utilidad DOP	Pérdida DOP	Ventas de Cartera Propia Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razorable	-	-	1,172,912,427	(3,213,543,864)	4,337,615,143	(136,709,466)	339,561,720	(303,586,697)	-	-	2,196,249,263
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	1,366,288,889	(2,795,034,131)	-	-	-	-	-	-	(1,428,745,242)
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	137,973,388	-	137,973,388
Gastos por Custodia de Valores	-	(10,407,851)	-	-	-	-	-	-	-	-	(10,407,851)
Ingresos (gastos) por Servicios	2,445,188	(3,389,923)	-	-	-	-	-	-	-	-	(944,735)
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(5,931,560)	-	-	-	-	-	-	-	-	(5,931,560)
Total	2,445,188	(19,729,334)	2,539,201,316	(6,008,577,993)	4,337,615,143	(136,709,466)	339,561,720	(303,586,697)	137,973,388	-	888,193,263

Tipo de Contrato	Comisiones		Al 31 de diciembre de 2016								Total
			Valor Razorable				Otros		A Costo Amortizado		
	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Ajuste a Valor Razorable Utilidad DOP	Pérdida DOP	Ventas de Cartera Propia Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	Utilidad DOP	Pérdida DOP	
Resultado por instrumentos financieros a su valor Razorable	-	-	574,049,161	(914,853,240)	1,599,382,882	(183,247,864)	311,671,397	(88,679,768)	-	-	1,298,322,668
Resultado por instrumentos financieros a su valor razonable - Instrumentos financieros derivados	-	-	752,129,679	(1,552,597,802)	-	-	-	-	-	-	(800,472,123)
Resultado por instrumentos financieros a su costo amortizado	-	-	-	-	-	-	-	-	134,295,617	-	134,295,617
Gastos por Custodia de Valores	-	(10,407,851)	-	-	-	-	-	-	-	-	(10,407,851)
Ingresos (gastos) por Servicios	702,941	(3,431,797)	-	-	-	-	-	-	-	-	(2,728,856)
Comisiones por Operaciones Bursátiles	-	(6,395,509)	-	-	-	-	-	-	-	-	(6,395,509)
Total	702,941	(20,228,157)	1,326,174,840	(2,467,451,042)	1,599,382,882	(183,247,864)	311,671,397	(88,679,768)	134,295,617	-	612,623,846

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

25. Gastos de administración y comercialización

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017 y 2016, la composición de los gastos de administración y comercialización, es como sigue:

	Al 31 de diciembre de	
	2017	2016
<i>Compensación al personal:</i>		
Sueldos al personal	51,942,197	42,162,785
Beneficio al personal	72,994,685	58,164,692
Aportes al plan de pensiones	3,692,736	3,024,691
Otras compensaciones al personal	7,610,623	4,258,052
	<u>136,240,241</u>	<u>107,610,220</u>
<i>Gastos operativos:</i>		
Viajes	1,002,181	787,845
Promoción y publicidad	29,698,554	20,593,524
Otros gastos operativos	2,194,190	3,470,690
	<u>32,894,925</u>	<u>24,852,059</u>
<i>Otros gastos de administración:</i>		
Servicios de proveedores locales	35,198,046	39,035,501
Arrendamientos (nota 26)	4,463,015	3,645,677
Asesoría legal	2,574,150	2,629,288
Gastos de depreciación	3,771,863	3,360,373
Gastos de amortización	3,527,202	3,826,610
Cuotas comisiones y pagadas	8,339,426	8,826,516
Gastos de comunicaciones	203,074	5,132,306
Seguro y reaseguro	108,765	100,207
Mantenimiento y reparaciones	211,607	263,466
Otros gastos de administración	12,025,389	15,381,043
	<u>70,422,537</u>	<u>82,200,987</u>
	<u>239,557,703</u>	<u>214,663,266</u>

26. Contingencias y compromisos

Al 31 de diciembre de 2017 y 2016, la Compañía tiene contingencias por derechos y obligaciones referentes a contratos de compraventa spot y forward de títulos valores de deuda según se presenta a continuación:

	Al 31 de diciembre de		1ro de enero
	2017	2016	de 2016
Contingentes			
Derechos por Contratos de Compra Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	414,993,651	93,505,606	-
Derechos por Contratos de Venta Spot de TVD-Portafolio TVD "T"	428,758,113	110,137,489	129,238,429
Derechos por Contratos de Compra Spot de Acciones - Portafolio e Acciones "T"		14,013,330	-
Derechos por Contratos de Venta Spot de Acciones - Portafolio de Acciones "T"	499,303	497,473,215	-
Derechos por Contratos de Compra de Divisas Implícitos	274,460,481	990,606,904	991,311,487
Derechos por Contratos de Venta de Divisas Implícito	2,204,069,760	1,974,395,592	905,542,687
Derechos por Contratos de Compra Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD)	12,880,011,474	7,319,644,655	3,862,501,154
Derechos por Contratos de Compra Forward de TVD con un tenor al vencimiento mayor a 365 días	662,869,313	-	-
Derechos por Contratos de Prestamos de TVD	-	-	3,645,600
Derechos por Contratos de Venta Forward de Títulos Valores de Deuda (TVD).	-	1,492,411,302	1,506,997,750
	<u>16,865,662,095</u>	<u>12,492,188,093</u>	<u>7,399,237,107</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

26. Contingencias y compromisos (continuación)

Encargos de confianza

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía refleja a valor nominal, un saldo de DOP21,557,619,615 (2016: DOP16,692,682,452) 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 cuatro líneas de crédito aprobadas por DOP3,955,852,000 (2016: DOP3,346,744,000) en bancos del país. Estas líneas están garantizadas con inversiones en bonos del Gobierno Dominicano y títulos emitidos por el Banco Central de la República Dominicana. El balance de inversiones restringidas puestas en garantías es de DOP1,646,874,730 (2016: 2,085,759,773). Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía está utilizando un monto de aproximadamente DOP1,860,000,000 (2016: DOP1,700,000,000) y posee un balance disponible de aproximadamente DOP2,095,852,000 (2016: DOP1,600,000,000).

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 31 de diciembre de 2017, la renta mensual es de DOP350,664 (2016: DOP330,628). Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, el gasto por este concepto ascendió a DOP4,463,015 (2016: DOP3,645,677) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

El total de pagos futuros mínimos por concepto de arrendamiento, derivados del contrato de arrendamiento operativo no cancelable vigentes al 31 de diciembre de 2017, durante los próximos dos (4) años es como sigue:

Año	Importe
	DOP
2018	4,418,366
2019	4,639,285
2020	4,871,249
2021	5,114,811
	19,043,711

Otros compromisos

La Compañía es miembro de la Bolsa de Valores de la República Dominicana, S. A., por lo que tiene la obligación, según lo establece la Ley 19-00, de pagar mensualmente el importe de DOP95,000.00, por concepto de mantenimiento y acceso al Sistema Integrado Bursátil Electrónico (SIBE), adicional a esto tiene el compromiso de pagar un monto mensual de DOP30,000.00 equivalentes al 0.003% de la emisión vigente. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, los gastos por este concepto ascendieron a DOP1,500,000 (2016: DOP1,606,451), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

26. 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 (2016: DOP62,000) por concepto de cuota de membresía. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, los gastos por este concepto ascendieron a DOP744,000 (2016: DOP795,000.00) los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados que se acompañan.

La Compañía tiene un acuerdo con CEVALDOM Depósito Centralizado de Valores, S. A., por custodia, transferencia, compensación y liquidación de valores, adicional a esto tiene el compromiso de pagarle de manera mensual DOP5,000.00 por cada emisión vigente. Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2017, los gastos por este concepto ascendieron a DOP10,467,851 (2016: DOP8,865,078), los cuales se incluyen en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

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

La Compañía mantiene diversos contratos con una relacionada, la cual realiza facturaciones de manera mensual por concepto de servicios generales, planeamiento, estrategia y soporte de tecnología. Al 31 de diciembre de 2017, el importe a pagar mensual es de DOP1,927,705 (2016: DOP2,043,443). Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2017, el gasto por este concepto ascendió a DOP25,402,647 (2016: DOP24,868,275) y se incluye en el rubro de gastos de administración y comercialización en los estados de resultados integrales que se acompañan.

27. Objetivos y políticas de gestión de los riesgos financieros

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

La Compañía está expuesta a los riesgos de mercado, liquidez y de crédito. La Administración de la Compañía con el soporte gerencial y del Consejo de Administración monitorea y administra estos riesgos. La Administración de la Compañía revisa y acuerda políticas para el manejo de estos riesgos, las cuales se resumen a continuación:

Riesgo crediticio

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo crediticio (continuación)

Al 31 de diciembre de 2017, la Compañía mantiene inversiones en instrumentos financieros, invertidos en títulos y valores de deuda, fondos de inversión, acciones, entre otros, los cuales son adquiridos en el mercado o directamente de la entidad emisora. La Compañía para manejar el riesgo de crédito, invierte en valores representativos de deuda del Ministerio de Hacienda de la República Dominicana, Banco Central de la República Dominicana y fondos de inversión de calificación de riesgo igual o superior a BBB, que significa una buena calidad crediticia y la existencia de una baja expectativa de riesgo crediticio.

Riesgo de tipo de cambio

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

	Variación en el Tipo de Cambio USD	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2017	+5%	154,832,456
	-5%	(154,832,456)
31 de diciembre de 2016	+5%	43,511,911
	-5%	(43,511,911)
1ro. de enero de 2016	+5%	(31,825,900)
	-5%	31,825,900

	Variación en el Tipo de Cambio EUR	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2017	+5%	3,543
	-5%	(3,543)
31 de diciembre de 2016	+5%	57,136
	-5%	(57,136)
1ro. de enero de 2016	+5%	42,641
	-5%	(42,641)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo de tipo de cambio (continuación)

	Variación en el Tipo de Cambio PYG	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2017	+5%	10,170,910
	-5%	(10,170,910)
31 de diciembre de 2016	+5%	9,416,042
	-5%	(9,416,042)
1ro. de enero de 2016	+5%	9,100,719
	-5%	(9,100,719)

	Variación en el Tipo de Cambio CAD	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta
31 de diciembre de 2017	+5%	-
	-5%	-
31 de diciembre de 2016	+5%	4,743,795
	-5%	(4,743,795)
1ro. de enero de 2016	+5%	-
	-5%	-

Riesgo de liquidez

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo de liquidez (continuación)

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

	2017					Total
	A la demanda	Menos de 3 meses	De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable	-	3,100,645,864	524,198,747	-	-	3,624,844,611
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	815,473,481	8,071,290	-	-	823,544,771
Obligaciones con bancos	-	37,178,889	1,933,357,919	-	-	1,970,536,808
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	20,750,687	62,252,060	985,670,330	-	1,068,673,077
Otras cuentas por pagar	-	7,366,036	-	-	-	7,366,036
Cuentas por pagar a relacionadas	2,224,156	-	-	-	-	2,224,156
Acumulaciones y otras obligaciones	-	50,612,888	-	-	-	50,612,888
	<u>2,224,156</u>	<u>4,032,027,845</u>	<u>2,527,880,016</u>	<u>985,670,330</u>	<u>-</u>	<u>7,547,802,347</u>
	2016					Total
	A la demanda	Menos de 3 meses	De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable	-	1,866,870,102	263,640,086	905,922	-	2,131,416,110
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	204,100,266	24,710,217	21,420	-	228,831,903
Obligaciones con bancos	-	617,152,272	1,155,069,667	-	-	1,772,221,939
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	15,959,589	47,878,767	761,713,767	-	825,552,123
Otras cuentas por pagar	-	5,378,068	-	-	-	5,378,068
Acumulaciones y otras obligaciones	-	47,320,686	-	-	-	47,320,686
	<u>-</u>	<u>2,756,780,983</u>	<u>1,491,298,737</u>	<u>762,641,109</u>	<u>-</u>	<u>5,010,720,829</u>

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo de liquidez (continuación)

	A la demanda	Menos de 3 meses	1ro. de enero de 2016			Total
			De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable	-	777,531,670	246,661,044	5,678,342	-	1,029,871,056
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	-	99,073,481	24,586,563	-	123,660,044
Obligaciones con bancos	-	930,172,914	911,308,217	-	-	1,841,481,131
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	22,191,781	1,014,498,630	-	-	1,036,690,411
Otras cuentas por pagar	-	13,432,269	-	-	-	13,432,269
Cuentas por pagar a relacionadas	37,108	-	-	-	-	37,108
Acumulaciones y otras obligaciones	-	28,534,873	-	-	-	28,534,873
	37,108	1,771,863,507	2,271,541,372	30,264,905	-	4,073,706,892

Riesgo de tasa de interés

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

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

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

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

Variación de la Tasa de Interés en Puntos Básicos	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta		
	2017	2016	1ro. enero de 2016
+500	(9,424,184)	(5,041,936)	(3,540,215)
-500	9,424,184	5,041,936	3,540,215

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

28. Gestión de capital

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

La Compañía administra su estructura de capital y solicita oportunamente a sus accionistas cualquier ajuste a ese capital considerando el entorno económico en el que se desarrolla la Compañía. Para mantener o ajustar su estructura de capital puede amortizar o suscribir nuevos préstamos. Estas políticas no tuvieron cambios significativos durante los años financieros 2017 y 2016.

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

	31 de diciembre de		1ro. de enero
	2017	2016	2016
Pasivos financieros a valor razonable	3,624,844,611	2,131,416,110	1,029,871,056
Instrumentos financieros derivados	823,544,771	228,831,903	123,660,044
Obligaciones con bancos y obligaciones por instrumentos financieros emitidos	2,752,902,881	2,419,717,931	2,818,659,381
Otras cuentas por pagar	7,366,036	5,378,068	13,432,269
Cuentas por pagar a relacionadas	2,224,156	-	37,108
Acumulaciones y otras obligaciones	50,612,888	47,320,686	28,534,873
Menos - Efectivo en caja y bancos	(2,050,852,717)	(1,281,365,491)	(630,864,483)
Pasivo neto	5,210,642,626	3,551,299,207	3,383,330,248
Patrimonio	1,986,041,564	1,655,092,412	1,385,596,539
Capital neto	7,196,684,190	5,206,391,619	4,768,926,787
	0.72	0.68	0.71

30. 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 presentamos a valor razonable y los que el valor en libros es aproximadamente similar al valor razonable:

	31 de diciembre de 2017		31 de diciembre de 2016		1ro de enero de 2016	
	Valor en libros	Valor razonable	Valor en libros	Valor razonable	Valor en libros	Valor razonable
Pasivos financieros						
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	(887,782,740)	(899,202,208)	(684,496,356)	(674,228,910)	(1,011,303,402)	(1,011,303,402)
	<u>(2,752,902,881)</u>	<u>(2,764,322,349)</u>	<u>(2,419,717,931)</u>	<u>(2,419,717,931)</u>	<u>(2,818,659,381)</u>	<u>(2,818,659,381)</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 a cobrar y pagar, cuentas a pagar relacionadas, obligaciones con bancos y otras obligaciones, tienen un valor razonable muy próximo a su valor contable debido en gran parte a los vencimientos a corto plazo de los mismos.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

30. 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.

31. Cambios en pasivos provenientes de actividades de financiamiento

	2017			
	Flujo de efectivo			Movimiento en moneda extranjera
	1ro. de enero de 2017	Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados	
Obligaciones con bancos (a)	1,733,203,202	4,933,277,593	(4,815,120,762)	8,881,219
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	675,000,000	200,000,000	-	-
	<u>2,408,203,202</u>	<u>5,133,277,593</u>	<u>(4,815,120,762)</u>	<u>8,881,219</u>
				<u>2,735,241,252</u>
	2016			
	Flujo de efectivo			Movimiento en moneda extranjera
	1ro. de enero de 2016	Producto de nuevos pasivos financieros	Pagos realizados	
Obligaciones con bancos (a)	1,804,919,010	15,744,688,848	(15,841,852,126)	25,447,470
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	1,000,000,000	675,000,000	(1,000,000,000)	-
	<u>2,804,919,010</u>	<u>16,419,688,848</u>	<u>(16,841,852,126)</u>	<u>25,447,470</u>
				<u>2,408,203,202</u>

(a) Al 31 de diciembre de 2017, este importe no incluye los intereses por pagar de las obligaciones con bancos ascendentes a DOP4,878,889 (2016: DOP1,018,186) (1ro. de enero de 2016: DOP2,436,969).

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

A continuación presentamos la composición detallada del estado de cartera de inversión al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016:

Equivalentes de efectivo USD

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

Certificado financiero DOP

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

1- Acciones

Acciones guaraníes (GS)

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

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

Acciones en dólares canadienses (CAD)

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2- Acciones (continuación)

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Acciones en pesos dominicanos (DOP)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
D08013300124	GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	121,209	176,126,373.72	177,307,555.43	1,181,181.71	DOP	N/A	50%
D08013400122	PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	16,217	16,226,730.20	17,876,809.95	1,650,079.75	DOP	N/A	7%
D08012152021	PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	905	1,100,154.20	1,157,820.80	57,666.60	DOP	N/A	0%
N/A	AFI Universal - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	1,297	15,684,862.36	15,872,452.71	187,590.35	DOP	N/A	1%
N/A	BHD LIQUIDEZ - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	101,140	122,511,663.25	122,498,717.36	(12,945.90)	DOP	N/A	42%
N/A	Reservas - Fondo Mutuo Corto Plazo Reservas Quisqueya	17	17,688.16	18,013.10	324.94	DOP	N/A	0%
N/A	BHD- Fondo Mutuo Renta Fija Plazo 30 dias	372	419,405.29	422,460.02	3,054.73	DOP	N/A	0%
Total		241,157	332,086,877.18	335,153,829.37	3,066,952.18			

Acciones en dólares estadounidenses (USD)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
US74348A1604	Proshares Ultrapro SQQQ	24,750	672,430.28	532,372.50	(140,057.78)	USD	N/A	41%
LU0974299876	Globalant US	3,000	112,500.00	139,320.00	26,820.00	USD	N/A	11%
N/A	Fondo Mutuo Renta Fija BHD 30 dias	2,984	30,520.11	30,796.77	276.66	USD	N/A	2%
N/A	Fondo de Inversión Abierto Plazo Mensual Dólar	51,29	51,810.20	52,339.91	529.71	USD	N/A	4%
D09014000119	Fidicomiso de Valores Inmobiliarios	118	120,253.30	120,665.62	412.32	USD	N/A	9%
D08013900121	JMMB Fondo de Inversión Cerrado	150	151,505.70	157,731.00	6,225.30	USD	N/A	12%
D08013800123	Fondo Cerrado De Desarrollo de Sociedades GAM Energía	245	274,412.00	277,510.28	3,098.27	USD	N/A	21%
Total		31,298.29	1,413,431.59	1,310,736.08	(102,695.52)			

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002243124	BCRD 15.5% 15-MAR-19	3,210,000.00	3,254,811.62	3,507,775.65	252,964.03	DOP	OTC	0.20%
DO1002229321	BCRD 14.5% 19-ENE-18	2,110,000.00	2,111,917.20	2,118,916.66	6,999.66	DOP	OTC	0.13%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	2,160,000.00	2,175,511.89	2,387,262.24	211,750.35	DOP	OTC	0.14%
DO1002235823	BCRD 15.5% 13-JUL-18	28,210,000.00	28,530,743.25	29,442,353.85	911,610.60	DOP	OTC	1.80%
DO1002232721	BCRD 15.5% 29-JUN-18	200,000.00	203,372.05	208,171.60	4,799.55	DOP	OTC	0.01%
DO1002260524	BCRD 12% 22-FEB-19	2,070,000.00	2,048,509.90	2,175,226.38	126,716.48	DOP	OTC	0.13%
DO1002249022	BCRD 14% 18-OCT-19	3,510,000.00	3,543,118.47	3,887,156.52	344,038.05	DOP	OTC	0.22%
DO1002251523	BCRD 13% 20-MAR-20	410,000.00	426,594.30	452,624.01	26,029.71	DOP	OTC	0.03%
DO1002240229	BCRD 15.5% 11-ENE-19	12,980,000.00	13,568,018.14	14,022,216.12	454,197.98	DOP	OTC	0.83%
DO1002243223	BCRD 15.5% 19-ABR-19	2,750,000.00	2,923,497.49	3,024,681.00	101,183.51	DOP	OTC	0.18%
DO1002213325	BCRD 12% 07-ENE-22	1,000,000.00	1,041,176.32	1,106,407.00	65,230.68	DOP	OTC	0.06%
DO1002237027	BCRD 15.5% 05-OCT-18	22,320,000.00	22,826,643.34	23,689,599.84	862,956.50	DOP	OTC	1.42%
DO1002253727	BCRD 13% 07-AGO-20	20,000.00	21,636.43	22,304.48	668.05	DOP	OTC	0.00%
DO1002213424	BCRD 10.5% 10-ENE-20	40,000.00	40,000.84	41,991.80	1,990.96	DOP	OTC	0.00%
DO1002231822	BCRD 14.5% 30-MAR-18	20,000.00	20,214.45	20,360.54	146.09	DOP	OTC	0.00%
DO1002245923	BCRD 13% 03-ENE-20	4,000,000.00	4,217,123.59	4,380,552.00	163,428.41	DOP	OTC	0.25%
DO1002217128	BCRD 11% 09-FEB-2024	26,680,000.00	27,615,205.67	28,367,856.84	752,651.17	DOP	OTC	1.70%
DO1002217425	BCRD 10.50% 04-OCT-2024	870,000.00	886,505.42	884,361.96	-2,143.46	DOP	OTC	0.06%
DO1002216112	BCRD 11% 03-FEB-23	3,500,000.00	3,729,065.69	3,729,344.50	278.81	DOP	OTC	0.22%
DO1002215726	BCRD 11% 30-SEPT-22	100,000.00	100,152.69	106,788.30	6,635.61	DOP	OTC	0.01%
DO1002214521	BCRD 11% 15-JUL-22	230,000.00	227,637.04	246,319.88	18,682.84	DOP	OTC	0.01%
DO1002260722	BCRD 12% 05-ABR-19	1,800,000.00	1,839,505.10	1,999,975.60	60,470.50	DOP	OTC	0.11%
DO1002216625	BCRD 11% 15-SEPT-2023	4,880,000.00	5,117,687.34	5,162,566.64	44,884.30	DOP	OTC	0.31%
DO1002216427	BCRD 11% 23-JUN-23	5,000,000.00	5,410,964.43	5,314,695.00	-96,269.43	DOP	OTC	0.32%
DO1002216724	BCRD 11% 05-ENE-2024	3,200,000.00	3,452,623.50	3,371,385.60	-81,237.90	DOP	OTC	0.20%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	101,400,000.00	104,813,717.40	105,975,675.00	1,161,957.60	DOP	OTC	6.46%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	100,000.00	102,043.70	102,926.00	882.3	DOP	OTC	0.01%
DO1005205013	MHRD 10.38% 06-MAR-26	43,700,000.00	44,258,425.24	44,235,499.80	-22,925.44	DOP	OTC	2.78%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	1,800,000.00	1,823,917.39	1,870,266.60	46,349.21	DOP	OTC	0.11%
DO1005205310	MHRD 11% 06-NOV-26	87,900,000.00	89,288,238.10	91,912,898.70	2,624,660.60	DOP	OTC	5.60%
DO1005205419	MHRD 11% 04-DIC-26	97,300,000.00	60,083,736.65	61,851,738.30	1,768,001.65	DOP	OTC	3.78%
DO1005205617	MHRD 11.25% 05-FEB-2027	97,700,000.00	98,987,878.74	101,613,275.80	2,625,397.06	DOP	OTC	6.23%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	335,700,000.00	347,391,246.37	360,437,061.60	13,045,815.23	DOP	OTC	21.39%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	389,800,000.00	393,458,975.74	402,388,201.20	8,929,225.46	DOP	OTC	24.84%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	13,400,000.00	14,911,887.54	14,389,295.20	-522,592.34	DOP	OTC	0.85%
DO1005241125	MHRD 16.95% 04-FEB-22	151,500,000.00	187,403,632.59	189,356,668.50	1,953,035.91	DOP	OTC	9.65%
DO2009305916	EGE HAINA 11.5% 21-JUL-26 [E9]	60,000.00	59,999.92	60,655.92	656	DOP	OTC	0.00%
DO2013000529	CONSORCIO REMIX 12% 27-ABR-19	2,257,100.00	2,260,810.51	2,125,475.86	(135,334.65)	DOP	OTC	0.14%
DO2013000412	CONSORCIO REMIX 11.75% 27-07-1	252,000.00	252,000.00	244,722.04	(7,277.96)	DOP	OTC	0.02%
DO2009307714	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E7]	300,000.00	322,106.99	318,311.40	(3,795.59)	DOP	OTC	0.02%
DO2009307615	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E6]	545,000.00	569,798.02	578,265.71	8,467.69	DOP	OTC	0.03%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda en DOP (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO2009307183	EGE HAINA 11.25% 14-AGO-27 [E8]	288,000.00	301,104.28	305,578.94	4,474.66	DOP	OTC	0.02%
DO2009307110	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E1]	1,057,554.00	1,057,554.00	1,137,616.13	80,062.13	DOP	OTC	0.07%
DO2009307318	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E3]	1,195,722.00	1,195,722.00	1,266,244.13	70,522.13	DOP	OTC	0.08%
DO2009307219	EGE HAINA 11.5% 28-JUN-27 [E2]	1,188,233.00	1,188,233.00	1,278,188.18	89,955.18	DOP	OTC	0.08%
DO2009308514	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [E1]	3,000,000.00	3,138,367.81	3,138,501.00	133.19	DOP	OTC	0.19%
DO2009308712	EHE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [E1]	64,197,277.00	67,158,222.64	67,161,072.69	2,850.05	DOP	OTC	4.09%
DO2009308811	EGE HAINA 11.00% 04-OCT-2027 [E1]	400,000.00	417,266.31	418,466.80	1,200.49	DOP	OTC	0.03%
DO1002217029	BCRD 0% 05-ENE-2018	30,000,000.00	29,962,940.30	29,960,100.00	(2,840.30)	DOP	OTC	1.91%
DO2006802923	PARVAL 9.45% 22-09-2018	311	309.4	311	1.6	DOP	OTC	0.00%
DO2006802022	PARVAL 9.75% 22-SEPT-18 [E2]	1,000,000.00	1,000,000.00	999,994.00	(6)	DOP	OTC	0.05%
DO2012502624	ALNAP 10.75% 08-SEP-2024 [E6]	48,894,136.00	48,894,136.00	51,006,362.68	2,112,226.68	DOP	OTC	3.12%
DO1005250928	MHRD 14.5% 10-FEB-23	200,000.00	223,231.60	228,875.20	5,643.60	DOP	OTC	0.01%
DO1005251025	MHRD 18.5% 04-FEB-28	1,000,000.00	1,451,994.22	1,411,445.00	(40,549.22)	DOP	OTC	0.06%
Total		1,569,405,333.00	1,637,309,727.62	1,675,364,587.59	38,054,859.97			100%

31 de diciembre de 2017

En USD (*):

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
USP3579EAG28	MH DOMREP 6.63% 20-ABR-27	4,114,000.00	4,784,997.49	4,996,041.60	211,044.11	USD	OTC	14.04%
USP3579EAT49	MHRD 6.6% 28-ENE-24	21,000.00	22,034.67	23,558.01	1,523.34	USD	OTC	0.07%
DO1005244525	MH CDEE 7% 31-JUL-23	210,000.00	227,602.83	232,422.96	4,820.13	USD	OTC	0.72%
USP3579EAY34	MH DOMREP 7.45% 30-ABR-44 [REG]	12,000.00	12,000.00	14,387.40	2,387.40	USD	OTC	0.04%
USP3579EBK21	MHRD 6.88% 29-ENE-26	191,000.00	220,982.29	219,336.76	(1,645.53)	USD	OTC	0.65%
DO1005205716	MHRD 6.00% 05-MAR-2027	1,397,000.00	1,497,805.36	1,535,582.40	37,777.04	USD	OTC	4.77%
DO2014300910	DPP 6.25% 03-FEB-2027 [E9]	189,460.00	189,460.00	206,730.79	17,270.79	USD	OTC	0.65%
DO2014301116	DPP 6.25% 31-MAR-2027 [E11]	166,124.00	166,124.00	181,406.58	15,282.58	USD	OTC	0.57%
DO2009360416	EGE HAINA 6% 17-MAR-20 [E7]	2,000.00	2,013.33	1,999.85	(13.48)	USD	OTC	0.01%
DO2009303911	EGE HAINA 5.75% 27-MAY-20 [E9]	2,000.00	1,986.99	1,999.96	10.97	USD	OTC	0.01%
DO2014304011	DPP 6.25% 30-JUN-2027 [E40]	9,256.00	9,323.09	10,128.75	805.66	USD	OTC	0.03%
DO2014304110	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E41]	304,003.00	304,003.00	327,133.37	23,130.37	USD	OTC	1.04%
DO2014304912	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E49]	858,809.00	858,809.00	918,769.33	59,960.33	USD	OTC	2.93%
DO2014304813	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E48]	799,111.00	799,111.00	854,903.33	55,792.33	USD	OTC	2.73%
DO2014305216	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E52]	648,996.00	648,996.00	694,307.60	45,311.60	USD	OTC	2.21%
DO2014305117	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E51]	699,477.00	699,477.00	748,313.09	48,836.09	USD	OTC	2.39%
DO2014305018	DPP 5.90% 14-NOV-2027 [E50]	700,018.00	700,018.00	748,891.86	48,873.86	USD	OTC	2.39%
DO2009904510	CEPM 5.50% 20-NOV-2027	1,081,399.00	1,081,399.00	1,114,961.30	33,562.30	USD	OTC	3.69%
DO2014304318	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E43]	2,158,090.00	2,238,467.17	2,322,290.44	83,823.27	USD	OTC	7.36%
DO2014304417	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E44]	9,334.00	10,118.48	10,044.19	(74.29)	USD	OTC	0.03%
DO2014304615	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E46]	113,489.00	123,027.27	122,123.92	(903.35)	USD	OTC	0.39%
DO2014304516	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E45]	588,277.00	637,719.18	633,036.64	(4,682.54)	USD	OTC	2.01%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

2. Títulos valores de deuda (continuación)

En USD (*): (continuación)									
Código ISIN	Títulos Valores de deuda			Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
DO2014304219	DPP 6.00% 17-AGOS-2027 [E42]			1,937,558.00	2,100,224.93	2,084,979.04	(15,245.89)	USD	OTC
DO2013001022	CONSORCIO REMIX 6.55% 15-DIC-2			584,017.00	584,017.00	584,006.20	(10.80)	USD	OTC
USPT0475AA22	BANRESERVAS 7% 01-FEB-23			623,000.00	625,438.93	660,934.47	35,495.54	USD	OTC
DO2014800117	EDENORTE 10% 15-JUL-2020			6,566,079.00	3,984,527.51	3,861,339.98	(123,187.53)	USD	OTC
DO2014700119	EDENORTE 10% 15-JUL-2020			5,319,975.00	3,228,347.81	3,128,538.69	(99,809.12)	USD	OTC
Total				29,305,472.00	25,758,033.33	26,238,168.51	480,135.18		100%

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

31 de diciembre de 2017

4. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda En DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0923	28/12/2017	02/01/2018	10,000,000	10,804.635	10,579,030	(225,605)	DOP	BVRD
MH0227	28/12/2017	02/01/2018	160,000,000	177,173.120	166,408,640	(10,764,480)	DOP	BVRD
MH0227	28/12/2017	04/01/2018	190,000,000	210,386.050	197,610,260	(12,775,790)	DOP	BVRD
Total			360,000,000	388,363.805	374,597,930	(23,765,875)		

b) Títulos Valores de Deuda USD

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

c) Acciones

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

d) Divisas

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

4. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda En DOP (continuación)

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

b) Títulos Valores de Deuda USD								
Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0923	28/12/2017	02/01/2018	10,000,000	10,804.635	10,579,030	225,605	DOP	BVRD
MH0332	29/12/2017	04/01/2018	190,000,000	219,206.420	204,000,720	15,205,700	DOP	BVRD
MH0332	29/12/2017	02/01/2018	160,000,000	184,597.760	171,790,080	12,807,680	DOP	BVRD
Total			360,000,000	414,608,815	386,369,830	28,238,985		

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

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

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

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

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

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

Contratos de compra	Fecha de Pecto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	29/09/2017	30/01/2018	53,000,000.00	53,954,114.78	54,909,033.71	954,918.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	14,000,000.00	14,152,614.00	15,015,235.95	862,621.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	03/01/2018	11,150,000.00	11,399,018.36	11,822,748.30	423,729.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	5,500,000.00	5,546,106.50	5,898,842.69	352,736.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/01/2018	5,000,000.00	4,983,220.00	5,278,672.84	315,452.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/09/2017	05/01/2018	14,400,000.00	14,836,606.48	15,040,501.76	203,895.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/03/2017	12/03/2018	3,770,000.00	3,794,283.75	3,947,530.16	193,246.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	11,010,000.00	11,404,733.66	11,597,353.22	192,619.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/07/2017	11/01/2018	5,100,000.00	5,287,751.40	5,468,749.98	180,998.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/07/2017	08/01/2018	5,500,000.00	5,725,478.00	5,899,428.27	173,950.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	2,700,000.00	2,721,116.70	2,893,495.80	172,379.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/06/2017	28/06/2018	2,200,000.00	2,160,435.20	2,324,287.90	163,852.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/09/2017	10/01/2018	4,600,000.00	4,614,807.54	4,774,812.43	160,004.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/07/2017	19/07/2018	1,400,000.00	1,324,224.50	1,475,005.39	150,780.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,800,000.00	1,784,786.40	1,929,188.84	144,402.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/07/2017	19/07/2018	5,500,000.00	5,657,971.00	5,799,748.21	141,777.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/08/2017	30/07/2018	3,000,000.00	2,922,022.01	3,063,201.26	141,179.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	6,800,000.00	7,030,302.34	7,170,458.76	140,156.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	17/01/2018	10,720,000.00	11,203,783.84	11,334,766.02	130,982.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/08/2017	21/02/2018	3,900,000.00	3,910,641.72	4,032,684.50	122,042.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	17/01/2018	10,250,000.00	10,716,208.90	10,837,812.66	121,603.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/09/2017	05/03/2018	8,500,000.00	8,671,163.96	8,789,519.65	118,355.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/06/2017	13/06/2018	5,200,000.00	5,226,034.37	5,344,202.05	118,167.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/08/2017	14/02/2018	5,800,000.00	5,887,366.35	6,000,703.52	113,337.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	11/01/2018	3,500,000.00	3,519,394.16	3,632,707.73	113,313.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/06/2017	07/06/2018	1,900,000.00	1,898,307.10	2,011,129.72	112,822.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	11/07/2018	2,300,000.00	2,252,455.52	2,357,391.40	104,935.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	20/04/2018	2,370,000.00	2,357,120.82	2,461,727.43	104,606.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/12/2017	17/01/2018	4,700,000.00	4,773,067.50	4,874,824.44	101,756.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	04/01/2018	2,900,000.00	2,911,078.77	3,011,707.69	100,628.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/07/2017	12/04/2018	1,200,000.00	1,139,423.89	1,238,344.59	98,920.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/02/2017	09/02/2018	1,670,000.00	1,681,339.37	1,758,383.55	97,044.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/08/2017	09/08/2018	2,400,000.00	2,353,638.12	2,448,531.47	94,893.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/03/2017	15/03/2018	1,650,000.00	1,633,712.73	1,726,924.77	93,212.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	04/01/2018	3,600,000.00	3,669,193.86	3,760,470.38	91,276.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/10/2017	09/04/2018	4,500,000.00	4,555,513.94	4,642,709.89	87,195.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/09/2017	27/03/2018	1,800,000.00	1,770,268.76	1,857,045.70	86,776.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/10/2017	11/01/2018	2,300,000.00	2,301,153.92	2,387,253.28	86,099.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,100,000.00	1,095,012.30	1,178,795.37	83,783.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	4,610,000.00	4,777,834.77	4,861,615.96	83,781.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/09/2017	27/03/2018	7,700,000.00	7,866,237.46	7,949,476.33	83,238.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	2,110,000.00	2,147,275.72	2,230,179.47	82,903.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

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

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Supervit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	9,310,000.00	9,722,922.74	9,805,547.70	82,624.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	16/01/2018	9,800,000.00	10,082,651.60	10,165,222.72	82,571.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/01/2017	05/01/2018	500,000.00	437,955.59	519,238.06	81,282.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/08/2017	22/02/2018	3,300,000.00	3,330,817.50	3,411,701.34	80,883.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/09/2017	27/03/2018	1,800,000.00	1,777,774.17	1,857,045.70	79,271.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	16/02/2018	8,800,000.00	9,177,099.57	9,253,358.35	76,258.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	05/01/2018	8,140,000.00	8,553,732.62	8,627,361.48	73,628.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/09/2017	03/01/2018	1,200,000.00	1,174,638.49	1,246,318.22	71,679.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	900,000.00	894,229.20	965,265.17	71,035.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	15/02/2018	9,560,000.00	9,981,285.66	10,051,608.20	70,322.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	3,160,000.00	3,236,814.97	3,303,643.62	66,828.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/04/2017	05/04/2018	500,000.00	451,197.00	515,950.54	64,753.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2017	31/01/2018	1,920,000.00	1,960,844.38	2,024,794.50	63,950.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	07/02/2018	4,660,000.00	4,843,637.01	4,907,067.73	63,430.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	971,625.63	1,034,831.77	63,206.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/10/2017	18/04/2018	4,200,000.00	4,270,780.74	4,332,489.76	61,709.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/10/2017	11/01/2018	900,000.00	872,966.23	934,142.59	61,176.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/09/2017	07/09/2018	1,600,000.00	1,569,929.60	1,630,166.32	60,236.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/08/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,320,967.38	2,380,113.06	59,145.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/09/2017	01/03/2018	1,000,000.00	975,119.17	1,033,864.55	58,745.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	10/04/2018	3,000,000.00	3,035,714.90	3,094,024.07	58,309.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/07/2017	15/01/2018	500,000.00	461,001.27	518,744.22	57,742.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	3,350,000.00	3,469,784.40	3,527,125.12	57,340.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/08/2017	20/02/2018	1,000,000.00	979,266.26	1,034,037.70	54,771.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	1,290,000.00	1,309,590.70	1,364,128.36	54,537.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/09/2017	20/03/2018	1,600,000.00	1,598,218.57	1,652,589.93	54,371.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	16/01/2018	4,560,000.00	4,769,109.06	4,822,594.04	53,484.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/09/2017	22/03/2018	800,000.00	773,139.19	825,784.98	52,645.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/10/2017	10/01/2018	200,000.00	155,030.32	207,596.90	52,566.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/09/2017	16/03/2018	800,000.00	775,146.83	826,179.01	51,032.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	983,902.54	1,034,831.77	50,929.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	12/04/2018	3,800,000.00	3,871,368.10	3,921,424.53	50,056.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	20/09/2017	21/03/2018	500,000.00	467,235.10	516,396.28	49,161.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/09/2017	22/03/2018	500,000.00	466,953.04	516,055.00	49,101.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/10/2017	29/03/2018	600,000.00	570,359.22	618,914.91	48,555.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	22/02/2018	3,360,000.00	3,480,362.15	3,528,196.03	47,833.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/04/2018	3,500,000.00	3,562,584.31	3,610,408.13	47,823.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	21/02/2018	6,140,000.00	6,402,532.71	6,450,152.92	47,622.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	3,810,000.00	3,964,532.87	4,012,001.73	47,468.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	16/01/2018	1,000,000.00	989,900.21	1,037,267.62	47,367.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	05/01/2018	6,600,000.00	6,806,584.26	6,853,662.43	47,078.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	04/01/2018	700,000.00	680,564.92	726,957.57	46,392.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,347,915.40	1,394,271.91	46,356.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	5,590,000.00	5,840,136.31	5,886,375.24	46,238.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,064,610.51	1,110,405.90	45,795.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/09/2017	06/03/2018	3,500,000.00	3,572,844.54	3,617,064.22	44,219.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	700,000.00	683,349.83	726,708.92	43,359.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/09/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,202,529.80	1,245,421.82	42,892.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/08/2017	17/08/2018	300,000.00	265,670.12	306,862.67	41,192.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/10/2017	09/01/2018	900,000.00	893,961.29	935,145.64	41,184.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	27/07/2017	27/07/2018	700,000.00	675,238.53	715,552.45	40,313.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/08/2017	15/02/2018	1,200,000.00	1,201,589.26	1,241,578.62	39,989.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	06/10/2017	31/01/2018	600,000.00	582,668.58	622,310.02	39,641.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/08/2017	26/02/2018	800,000.00	787,345.90	826,776.99	39,431.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/10/2017	19/01/2018	300,000.00	282,141.62	321,435.65	39,294.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	13/02/2018	4,630,000.00	4,830,583.16	4,869,680.92	39,097.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	22/01/2018	1,980,000.00	2,052,487.53	2,091,383.43	38,885.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	08/02/2018	700,000.00	686,280.48	724,619.22	38,338.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	3,400,000.00	3,542,641.76	3,580,973.38	38,331.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	14/03/2018	600,000.00	581,710.27	619,667.13	37,956.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	2,330,000.00	2,419,622.21	2,457,537.02	37,914.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/08/2017	22/02/2018	1,300,000.00	1,306,483.38	1,344,107.35	37,623.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/05/2017	28/08/2018	800,000.00	803,179.47	840,560.01	37,380.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2017	18/06/2018	200,000.00	167,783.85	205,138.70	37,354.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE 1018	26/07/2017	22/01/2018	860,000.00	871,184.88	908,441.87	37,256.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,208,341.89	1,245,370.86	37,028.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	09/08/2017	05/02/2018	1,880,000.00	1,943,773.14	1,980,459.87	36,686.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	17/04/2018	500,000.00	478,555.13	515,188.78	36,633.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	15/08/2017	13/02/2018	2,630,000.00	2,729,605.88	2,766,147.05	36,541.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	200,000.00	178,002.44	214,375.61	36,373.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/08/2017	20/02/2018	1,500,000.00	1,515,579.91	1,551,056.55	35,476.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	31/10/2017	01/02/2018	3,300,000.00	3,444,413.39	3,479,093.01	34,679.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	08/11/2017	08/02/2018	2,770,000.00	2,882,280.57	2,916,458.68	34,178.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	03/10/2017	03/04/2018	500,000.00	483,009.23	515,676.14	32,666.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	11/01/2017	11/01/2018	1,070,000.00	1,100,464.21	1,132,803.48	32,339.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	14/02/2018	4,700,000.00	4,831,691.31	4,863,279.45	31,588.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	30/10/2017	30/01/2018	2,270,000.00	2,363,944.71	2,394,252.81	30,308.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/08/2017	21/08/2018	600,000.00	581,056.86	611,120.90	30,064.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	12/01/2018	300,000.00	281,448.56	311,374.57	29,926.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	14/03/2017	14/03/2018	4,340,000.00	4,512,417.80	4,542,170.14	29,752.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/10/2017	18/01/2018	400,000.00	385,761.10	414,828.39	29,067.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	300,000.00	293,076.00	321,499.53	28,423.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	10/11/2017	09/01/2018	2,340,000.00	2,450,326.32	2,478,189.15	27,861.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/12/2017	19/06/2018	200,000.00	177,768.68	205,123.06	27,354.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/07/2017	05/07/2018	1,500,000.00	1,512,086.28	1,539,349.20	27,262.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	29/11/2017	15/01/2018	18,080,000.00	19,098,160.65	19,124,955.00	26,794.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/08/2017	05/04/2018	1,200,000.00	1,211,305.24	1,238,063.21	26,757.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/10/2017	03/01/2018	300,000.00	295,234.35	321,935.11	26,700.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	28/08/2017	22/02/2018	3,000,000.00	3,074,942.69	3,101,546.67	26,603.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/11/2017	22/05/2018	200,000.00	179,100.41	205,560.78	26,460.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	18/07/2017	12/01/2018	1,620,000.00	1,688,513.42	1,714,753.28	26,239.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/10/2017	12/04/2018	3,900,000.00	3,996,004.21	4,022,236.88	26,232.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/03/2018	300,000.00	285,588.00	311,749.95	26,161.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	26/07/2017	22/01/2018	1,320,000.00	1,368,567.61	1,394,255.62	25,688.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	27/07/2017	23/01/2018	1,180,000.00	1,220,915.43	1,246,128.85	25,213.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/09/2017	12/01/2018	800,000.00	805,436.47	830,264.23	24,827.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	28/11/2017	01/03/2018	4,460,000.00	4,655,445.45	4,690,044.54	24,599.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	16/01/2018	5,000,000.00	5,162,085.20	5,186,467.84	24,402.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	11/12/2017	13/03/2018	9,140,000.00	9,550,478.64	9,574,387.82	23,909.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	07/12/2017	06/04/2018	200,000.00	184,965.04	207,737.90	22,772.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	08/01/2018	1,000,000.00	1,015,809.41	1,038,175.11	22,365.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	20/12/2017	20/02/2018	8,850,000.00	9,274,337.10	9,296,654.92	22,317.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit, no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo contratado de negociación
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,500,000.00	1,557,410.68	1,579,620.40	22,209.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/11/2017	06/02/2018	3,110,000.00	3,253,355.50	3,275,537.42	22,181.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	1,560,000.00	1,626,121.95	1,647,813.97	21,692.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	200,000.00	192,457.35	214,083.87	21,626.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/09/2017	26/01/2018	1,100,000.00	1,118,467.12	1,139,912.67	21,445.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	22/01/2018	1,540,000.00	1,606,422.05	1,626,914.55	20,492.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	16/01/2018	200,000.00	193,930.61	214,354.32	20,423.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	04/01/2018	1,500,000.00	1,546,515.77	1,566,862.66	20,346.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	410,000.00	410,141.14	430,268.44	20,127.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	2,830,000.00	2,955,272.86	2,975,319.42	20,046.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/09/2017	06/03/2018	2,100,000.00	2,150,197.34	2,170,238.53	20,041.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	400,000.00	395,273.89	415,228.89	19,955.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	13/02/2018	5,840,000.00	6,123,294.46	6,143,145.12	19,850.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	30/01/2018	1,850,000.00	1,931,408.96	1,951,172.51	19,763.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	26/01/2018	2,300,000.00	2,407,679.46	2,427,426.45	19,746.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/10/2017	10/01/2018	2,300,000.00	2,367,751.31	2,387,448.06	19,696.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	23/01/2018	2,770,000.00	2,905,768.51	2,925,234.68	19,466.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/07/2017	24/01/2018	1,260,000.00	1,311,730.96	1,330,343.96	18,613.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/09/2017	26/01/2018	1,800,000.00	1,846,700.55	1,865,311.65	18,611.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	7,600,000.00	8,015,698.63	8,034,003.07	18,304.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/01/2018	2,360,000.00	2,481,981.61	2,499,289.94	17,308.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	15/01/2018	8,890,000.00	9,386,567.10	9,403,576.97	17,009.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	2,780,000.00	2,908,985.20	2,926,812.32	16,827.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	3,650,000.00	3,810,561.42	3,827,082.24	16,520.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	17/11/2017	15/02/2018	300,000.00	296,046.29	312,473.11	16,426.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	22/01/2018	760,000.00	786,361.11	802,781.17	16,420.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	10/01/2018	300,000.00	295,002.61	311,395.35	16,392.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	900,000.00	934,909.58	951,203.54	16,293.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	880,000.00	913,426.78	929,503.75	16,076.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/10/2017	18/01/2018	600,000.00	606,407.57	622,242.58	15,835.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	660,000.00	682,159.02	697,549.26	15,390.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	980,000.00	1,018,204.46	1,033,389.64	15,185.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	19/02/2018	300,000.00	297,376.31	312,371.21	14,994.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/01/2018	1,700,000.00	1,748,384.54	1,763,187.81	14,803.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	200,000.00	196,135.92	210,905.97	14,770.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/07/2017	10/07/2018	200,000.00	197,146.60	211,668.74	14,522.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/04/2018	200,000.00	191,571.65	206,043.50	14,471.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/07/2017	10/07/2018	200,000.00	197,331.20	211,668.74	14,337.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	12/01/2018	300,000.00	297,090.55	311,342.72	14,252.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	30/01/2018	1,720,000.00	1,799,858.37	1,814,063.09	14,204.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	3,590,000.00	3,744,578.17	3,758,762.79	14,184.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,000,000.00	1,039,256.27	1,053,080.26	13,823.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/12/2017	09/01/2018	200,000.00	193,878.75	207,631.12	13,752.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	3,800,000.00	3,974,725.75	3,987,481.89	12,756.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/09/2017	21/03/2018	200,000.00	193,930.14	206,462.66	12,532.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	22/01/2018	1,590,000.00	1,666,455.06	1,678,860.22	12,405.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/09/2017	12/03/2018	200,000.00	194,269.17	206,589.13	12,319.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/02/2017	09/02/2018	2,890,000.00	3,031,013.69	3,042,951.17	11,937.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/08/2017	22/02/2018	900,000.00	918,720.01	930,607.72	11,887.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	1,230,000.00	1,285,527.68	1,297,266.05	11,738.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/09/2017	03/01/2018	500,000.00	507,579.82	519,299.26	11,719.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/07/2017	16/01/2018	450,000.00	464,300.03	475,951.06	11,651.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	630,000.00	654,259.31	665,842.48	11,583.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	05/01/2018	710,000.00	740,944.08	752,509.42	11,565.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	500,000.00	507,486.42	519,001.35	11,514.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	1,580,000.00	1,654,586.11	1,666,077.18	11,491.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	17/01/2018	1,200,000.00	1,274,659.72	1,285,998.13	11,338.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	12/01/2018	2,100,000.00	2,168,127.80	2,179,399.01	11,271.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/10/2017	25/04/2018	1,400,000.00	1,431,051.37	1,442,289.71	11,238.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	04/05/2018	720,000.00	734,441.44	745,562.21	11,120.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/03/2017	15/03/2018	870,000.00	899,366.85	910,355.65	10,988.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/04/2017	24/04/2018	920,000.00	944,430.41	955,327.49	10,897.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	440,000.00	453,275.49	464,170.64	10,895.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2017	13/02/2018	4,630,000.00	4,859,007.84	4,869,680.92	10,673.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	3,440,000.00	3,603,718.62	3,614,322.17	10,603.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	27/04/2018	1,120,000.00	1,151,819.17	1,162,342.26	10,523.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	450,000.00	464,104.09	474,561.21	10,457.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/08/2017	13/02/2018	800,000.00	831,246.85	841,413.55	10,166.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/07/2017	04/01/2018	900,000.00	955,594.81	965,744.27	10,149.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/07/2017	08/01/2018	530,000.00	551,356.74	561,434.48	10,077.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	31/10/2017	12/01/2018	200,000.00	204,395.00	214,439.49	10,044.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/03/2017	02/03/2018	1,600,000.00	1,669,066.63	1,679,096.37	10,029.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	25/01/2018	2,250,000.00	2,407,470.82	2,417,359.89	9,889.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/01/2018	450,000.00	467,363.84	477,232.62	9,868.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	24/01/2018	400,000.00	412,482.69	422,331.42	9,848.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	7,040,000.00	7,445,951.05	7,455,745.55	9,794.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2017	25/01/2018	460,000.00	475,863.35	485,602.24	9,738.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,950,000.00	2,030,590.75	2,040,122.95	9,532.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	12/06/2018	200,000.00	195,605.71	205,134.50	9,528.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	11/01/2018	660,000.00	710,423.75	718,844.95	9,421.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	930,000.00	975,739.33	984,920.93	9,181.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	560,000.00	583,947.95	593,051.85	9,103.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	04/05/2018	330,000.00	332,464.39	341,552.76	9,088.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	07/02/2018	1,210,000.00	1,265,199.57	1,274,152.78	8,953.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	25/01/2018	470,000.00	487,306.99	496,139.37	8,832.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	01/11/2017	02/05/2018	200,000.00	203,466.25	212,244.11	8,777.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2017	06/02/2018	890,000.00	928,600.96	937,372.44	8,771.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	15/01/2018	410,000.00	425,015.48	433,685.78	8,670.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	2,110,000.00	2,198,710.77	2,208,370.46	8,659.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/10/2017	02/03/2018	200,000.00	204,971.81	213,598.40	8,626.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2017	25/01/2018	370,000.00	381,972.65	390,577.90	8,605.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	340,000.00	350,945.49	359,537.71	8,592.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2017	05/02/2018	890,000.00	928,978.91	937,558.13	8,579.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	360,000.00	371,452.89	379,722.96	8,270.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/08/2017	30/01/2018	450,000.00	466,356.17	474,609.53	8,253.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	25/10/2017	25/01/2018	600,000.00	634,276.71	642,488.02	8,211.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/10/2017	02/04/2018	300,000.00	301,258.83	309,430.00	8,171.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/07/2017	12/01/2018	870,000.00	912,779.30	920,886.02	8,106.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	18/01/2018	420,000.00	436,027.80	443,984.38	7,956.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	450,000.00	467,378.07	475,314.42	7,936.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	30/01/2018	930,000.00	973,025.89	980,859.70	7,833.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/03/2017	29/03/2018	150,000.00	148,918.79	156,648.56	7,729.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	16/05/2018	190,000.00	188,714.11	196,174.34	7,460.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/08/2017	31/01/2018	1,000,000.00	1,028,481.91	1,035,925.16	7,443.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	470,000.00	489,367.72	496,739.63	7,371.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	470,000.00	487,649.25	495,016.91	7,367.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	02/03/2018	740,000.00	769,123.31	776,366.07	7,242.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/08/2017	13/02/2018	400,000.00	413,469.56	420,706.77	7,237.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	12/01/2018	4,100,000.00	4,332,370.31	4,339,369.03	6,998.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	17/01/2018	190,000.00	193,918.91	200,890.52	6,971.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/02/2018	520,000.00	541,242.39	548,140.16	6,897.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/03/2018	1,320,000.00	1,375,301.79	1,382,052.06	6,750.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	17/11/2017	15/02/2018	100,000.00	102,374.96	109,055.97	6,681.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	20/02/2018	600,000.00	623,662.81	630,232.72	6,569.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/05/2017	24/05/2018	910,000.00	933,014.53	939,539.38	6,524.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/05/2018	160,000.00	159,011.03	165,403.40	6,392.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/10/2017	22/01/2018	1,400,000.00	1,445,008.76	1,451,397.17	6,388.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	16/01/2018	300,000.00	305,085.45	311,180.29	6,094.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	06/02/2018	270,000.00	278,326.02	284,403.76	6,077.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	690,000.00	720,417.65	726,482.49	6,064.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	10/04/2018	4,700,000.00	4,841,359.57	4,847,304.37	5,944.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	1,100,000.00	1,145,807.06	1,151,710.05	5,902.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	700,000.00	730,224.55	736,090.79	5,866.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	22/01/2018	130,000.00	1,316,452.57	1,317,317.83	5,675.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	06/02/2018	590,000.00	605,234.85	610,906.67	5,671.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2017	04/01/2018	450,000.00	471,367.78	477,038.35	5,670.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	16/11/2017	14/02/2018	190,000.00	194,144.16	199,609.81	5,665.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	110,000.00	110,794.91	116,354.72	5,559.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	04/04/2018	370,000.00	380,305.88	385,800.81	5,494.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	10/01/2018	1,600,000.00	1,655,327.13	1,660,775.22	5,448.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	02/03/2018	200,000.00	208,190.50	213,598.40	5,407.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	12/01/2018	230,000.00	238,020.14	243,428.02	5,407.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	24/01/2018	200,000.00	201,890.60	207,296.19	5,405.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	140,000.00	142,273.09	147,670.04	5,396.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2017	28/02/2018	460,000.00	477,329.32	482,697.82	5,368.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	920,000.00	967,562.19	972,928.85	5,366.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	1,350,000.00	1,419,703.92	1,424,909.63	5,205.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	370,000.00	382,566.35	387,746.35	5,178.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	12/04/2018	220,000.00	223,634.71	228,714.76	5,080.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	02/07/2018	210,000.00	210,738.56	215,779.04	5,040.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	13/02/2018	130,000.00	131,745.06	136,729.70	4,984.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	12/06/2018	300,000.00	302,738.13	307,701.74	4,963.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/08/2017	30/01/2018	270,000.00	279,813.70	284,765.72	4,952.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	50,000.00	47,432.20	52,319.29	4,887.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	13/02/2018	550,000.00	573,596.42	578,471.82	4,885.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/09/2017	02/03/2018	200,000.00	208,725.04	213,598.40	4,873.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	190,000.00	195,517.45	200,390.69	4,873.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	50,000.00	47,499.86	52,344.73	4,844.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	100,000.00	100,891.47	105,713.63	4,822.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,190,000.00	1,253,657.55	1,258,462.31	4,804.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	05/03/2018	50,000.00	47,660.21	52,422.97	4,762.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	24/01/2018	920,000.00	966,644.93	971,362.26	4,717.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	15/01/2018	180,000.00	185,684.94	190,398.63	4,713.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	4,730,000.00	4,939,829.79	4,944,409.75	4,579.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	50,000.00	47,942.67	52,515.31	4,572.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/08/2017	07/02/2018	180,000.00	184,988.49	189,543.39	4,554.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	06/03/2018	280,000.00	289,145.38	293,629.83	4,484.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/10/2017	23/01/2018	500,000.00	500,703.52	505,185.56	4,482.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2017	19/07/2018	80,000.00	77,561.90	81,952.75	4,390.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2017	25/01/2018	130,000.00	132,987.52	137,240.79	4,253.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	210,000.00	217,253.86	221,484.45	4,230.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	27/12/2017	26/02/2018	300,000.00	320,209.23	324,417.58	4,208.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	02/02/2018	190,000.00	196,112.83	200,281.98	4,169.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/02/2018	160,000.00	164,345.36	168,492.84	4,147.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	12/01/2018	210,000.00	218,244.59	222,260.37	4,015.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	12/01/2018	1,830,000.00	1,932,631.90	1,936,840.32	4,008.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	190,000.00	195,871.44	199,849.16	3,977.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	510,000.00	531,217.67	535,162.04	3,944.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	610,000.00	636,222.06	640,155.49	3,933.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	120,000.00	121,636.11	125,566.30	3,930.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	110,000.00	111,904.66	115,625.50	3,720.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	460,000.00	481,789.31	485,485.29	3,695.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	110,000.00	111,938.45	115,625.50	3,687.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	280,000.00	291,640.55	295,254.18	3,613.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	28/02/2018	6,410,000.00	6,726,086.86	6,729,625.32	3,538.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	460,000.00	482,035.89	485,485.29	3,449.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	470,000.00	494,196.35	497,639.92	3,443.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/10/2017	02/04/2018	80,000.00	80,043.87	83,447.51	3,403.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/09/2017	19/03/2018	400,000.00	409,665.77	413,037.72	3,373.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/07/2017	09/01/2018	330,000.00	346,160.82	349,504.71	3,343.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	460,000.00	482,941.09	486,268.61	3,327.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	30/01/2018	280,000.00	292,029.58	295,312.60	3,283.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	280,000.00	289,502.82	292,747.11	3,244.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2017	09/01/2018	210,000.00	219,289.62	222,412.09	3,122.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	13/02/2018	1,120,000.00	1,175,041.15	1,178,137.42	3,096.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	390,000.00	404,712.87	407,754.90	3,042.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	1,160,000.00	1,215,073.97	1,218,113.20	3,039.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	06/07/2017	03/01/2018	200,000.00	205,911.77	208,933.35	3,021.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	04/01/2018	920,000.00	972,303.81	975,278.41	2,974.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	01/02/2018	460,000.00	482,020.01	484,988.47	2,968.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	460,000.00	483,352.05	486,268.61	2,916.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	1,190,000.00	1,256,595.75	1,259,500.86	2,905.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	750,000.00	785,038.79	787,852.11	2,813.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	22/05/2018	310,000.00	317,151.60	319,945.24	2,793.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	440,000.00	453,596.51	456,343.29	2,746.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	430,000.00	449,421.82	452,080.34	2,652.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	09/11/2017	09/03/2018	300,000.00	309,058.29	311,688.30	2,630.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/06/2018	420,000.00	428,046.24	430,552.71	2,506.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	750,000.00	785,859.84	788,355.71	2,495.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	02/02/2018	260,000.00	271,606.92	274,056.12	2,449.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/09/2017	11/01/2018	700,000.00	724,151.47	726,555.35	2,397.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	20/02/2018	640,000.00	669,805.90	672,196.01	2,390.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	938,764.56	941,085.80	2,321.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	13/02/2018	230,000.00	239,616.03	241,922.66	2,306.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	460,000.00	484,750.41	487,051.84	2,301.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	08/01/2018	230,000.00	241,354.81	243,623.82	2,269.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,510,000.00	1,576,876.86	1,579,038.70	2,161.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	19/12/2017	16/02/2018	90,000.00	96,841.37	98,999.77	2,158.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	300.000.00	315.515.40	311.598.52	2.083.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	01/02/2018	480.000.00	504.030.79	506.074.93	2.044.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	10/01/2018	460.000.00	485.010.68	487.051.84	2.041.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	2.780.000.00	2.912.424.50	2.914.461.06	2.036.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2017	18/01/2018	280.000.00	293.974.11	295.998.15	2.024.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	100.000.00	103.470.24	105.468.78	1.998.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/03/2018	240.000.00	249.429.77	251.416.51	1.986.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	680.000.00	710.644.95	712.614.91	1.969.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2017	05/02/2018	470.000.00	493.189.54	495.114.97	1.925.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	05/01/2018	7.400.000.00	7.682.434.93	7.684.330.93	1.896.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	460.000.00	481.228.22	483.044.89	1.816.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/01/2017	25/01/2018	280.000.00	293.828.48	295.630.31	1.801.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0119	27/10/2017	10/01/2018	420.000.00	451.047.44	452.745.34	1.697.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	3.100.000.00	3.275.438.43	3.277.122.43	1.684.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	1.140.000.00	1.199.045.28	1.200.679.31	1.634.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/12/2017	01/06/2018	200.000.00	204.734.46	206.343.77	1.609.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2017	11/09/2018	110.000.00	109.816.73	111.387.18	1.570.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	440.000.00	460.772.09	462.297.02	1.524.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	27/03/2018	470.000.00	489.345.57	490.817.49	1.471.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	2.740.000.00	2.898.566.31	2.899.968.57	1.402.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	1.230.000.00	1.297.088.95	1.298.407.28	1.318.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	07/02/2018	130.000.00	135.574.25	136.892.45	1.318.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	15/02/2018	240.000.00	251.073.60	252.323.91	1.250.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	550.000.00	575.787.54	577.030.27	1.242.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	15/02/2018	330.000.00	345.766.15	346.994.11	1.227.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	04/04/2018	410.000.00	426.369.51	427.509.00	1.139.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/02/2017	02/02/2018	190.000.00	199.204.60	200.322.81	1.118.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	14/05/2018	130.000.00	133.231.76	134.304.73	1.072.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	320.000.00	336.862.73	337.877.88	1.015.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	2.830.000.00	2.990.684.66	2.991.609.04	924.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	11/01/2018	530.000.00	560.145.46	561.066.15	920.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	730.000.00	766.091.10	766.934.34	843.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4.740.000.00	5.010.188.01	5.010.970.95	802.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	02/03/2018	220.000.00	230.009.67	230.811.53	801.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	05/01/2018	1.360.000.00	1.440.653.20	1.441.441.02	787.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	90.000.00	94.060.95	94.801.25	740.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/01/2017	18/01/2018	90.000.00	94.432.43	95.153.28	720.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2017	31/01/2018	210.000.00	220.733.23	221.451.27	718.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	05/02/2018	280.000.00	294.248.03	294.962.11	714.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	10/01/2018	250.000.00	264.007.85	264.702.09	694.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	1.070.000.00	1.122.688.04	1.123.381.12	693.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	13/10/2017	08/02/2018	400,000.00	427,148.71	427,800.02	650.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/02/2017	16/02/2018	710,000.00	746,073.76	746,720.41	646.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,320,000.00	1,395,353.89	1,395,977.73	623.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	19/04/2018	90,000.00	92,834.73	93,447.77	613.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8,350,000.00	8,826,518.68	8,827,087.83	569.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	3,200,000.00	3,353,876.72	3,354,444.04	567.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	18/01/2018	190,000.00	200,446.83	200,850.08	403.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/10/2017	06/04/2018	200,000.00	204,941.00	205,311.40	370.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	410,000.00	429,343.72	429,707.95	364.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	19/02/2018	460,000.00	482,899.04	483,236.87	337.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	340,000.00	358,228.07	358,522.94	294.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	22/05/2018	240,000.00	247,224.34	247,497.71	273.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	890,000.00	932,464.14	932,687.17	223.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	12/02/2018	1,370,000.00	1,441,012.32	1,441,206.56	194.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	12/01/2018	4,570,000.00	4,836,748.91	4,836,906.67	157.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	220,000.00	231,564.64	231,645.96	81.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	1,480,000.00	1,566,643.37	1,566,721.37	78.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	320,000.00	338,696.44	338,750.57	54.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/05/2018	290,000.00	299,786.93	299,793.66	6.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	14/02/2018	1,280,000.00	1,346,000.92	1,345,994.60	(6.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/10/2017	26/04/2018	290,000.00	300,741.23	300,638.00	(103.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/04/2017	05/04/2018	110,000.00	114,710.00	114,580.21	(129.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	1,330,000.00	1,396,492.46	1,396,352.24	(140.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/04/2018	440,000.00	457,504.02	457,363.30	(140.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	05/02/2018	290,000.00	305,653.25	305,496.47	(156.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	870,000.00	914,178.39	914,017.64	(160.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,290,000.00	1,363,595.11	1,363,301.74	(293.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	590,000.00	622,253.85	622,019.66	(234.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	18/01/2018	1,540,000.00	1,628,182.73	1,627,942.73	(240.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	220,000.00	230,283.90	230,043.19	(240.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	929,863.61	929,581.84	(281.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	15/01/2018	140,000.00	148,387.43	148,087.83	(299.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	15/02/2018	390,000.00	410,351.08	410,026.35	(324.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	21/03/2018	550,000.00	575,258.87	574,931.37	(327.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	120,000.00	125,777.01	125,447.99	(329.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	230,000.00	242,868.97	242,530.22	(338.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	410,000.00	431,017.81	430,659.03	(358.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	14/12/2017	15/01/2018	90,000.00	99,812.85	99,431.16	(381.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	790,000.00	826,251.13	825,865.92	(385.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	520,000.00	547,323.27	546,885.48	(437.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	280,000.00	294,459.69	293,968.89	(490.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017
 S.- Contratos de compra forward (continuación)
 a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	300,000.00	318,229.13	317,711.39	(517.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	150,000.00	157,336.59	156,818.53	(518.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	420,000.00	440,271.27	439,743.84	(527.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	20/02/2018	470,000.00	494,283.11	493,643.94	(639.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,900,533.15	1,899,756.52	1,899,756.52	(776.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	1,370,000.00	1,449,043.14	1,448,234.76	(808.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	100,000.00	106,257.94	105,447.92	(810.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	3,978,846.52	3,978,015.23	3,978,015.23	(831.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	480,000.00	508,346.58	507,512.89	(833.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	140,000.00	148,867.47	147,999.08	(868.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	1,240,000.00	1,305,171.64	1,304,278.71	(892.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	03/10/2017	03/04/2018	900,000.00	929,857.89	928,934.02	(923.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,050,000.00	1,111,332.47	1,110,407.92	(924.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/12/2017	09/01/2018	600,000.00	623,890.75	622,843.34	(1,047.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	01/03/2018	70,000.00	74,519.39	73,446.91	(1,072.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	10/01/2018	1,200,000.00	1,271,684.49	1,270,592.01	(1,092.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	08/01/2018	110,000.00	117,668.05	116,515.74	(1,152.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	90,000.00	96,791.78	94,546.34	(1,245.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	23/01/2018	190,000.00	201,952.40	200,647.87	(1,304.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,370,000.00	1,449,700.67	1,448,234.76	(1,465.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	140,000.00	149,338.01	147,786.19	(1,551.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/10/2017	06/04/2018	200,000.00	206,906.61	205,311.40	(1,595.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	27/04/2018	80,000.00	84,557.78	82,917.88	(1,639.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	660,000.00	699,223.84	697,549.26	(1,674.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	530,000.00	558,347.84	556,662.32	(1,685.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	31/01/2018	90,000.00	96,628.22	94,907.69	(1,720.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	2,820,000.00	2,953,091.49	2,951,364.01	(1,727.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	1,920,000.00	2,018,739.45	2,016,988.68	(1,750.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	20/02/2018	2,960,000.00	3,110,678.22	3,108,906.54	(1,771.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	19/12/2017	19/02/2018	60,000.00	66,725.05	64,944.56	(1,780.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	240,000.00	253,883.74	252,073.50	(1,810.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	240,000.00	254,116.01	252,273.83	(1,842.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/02/2017	02/02/2018	200,000.00	212,728.22	210,866.11	(1,862.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	910,000.00	954,180.68	952,318.12	(1,862.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,064,675.54	1,066,675.54	1,064,698.71	(1,976.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	10/01/2018	430,000.00	457,297.57	457,297.59	(2,009.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	440,000.00	466,406.61	464,396.11	(2,010.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	480,000.00	510,392.39	508,346.29	(2,046.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	03/01/2018	2,290,000.00	2,430,176.71	2,428,099.95	(2,076.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	760,000.00	796,845.54	794,747.95	(2,097.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/08/2017	07/02/2018	120,000.00	128,462.86	126,362.26	(2,100.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	470,000.00	493,582.08	491,455.92	(2,126.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	870,000.00	922,404.37	920,237.45	(2,166.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	90,000.00	97,184.71	95,005.41	(2,179.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	10/01/2018	90,000.00	97,483.84	95,292.75	(2,191.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	910,000.00	956,920.31	954,722.82	(2,197.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	26/02/2018	180,000.00	191,064.12	188,846.12	(2,218.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/10/2017	11/04/2018	700,000.00	724,107.31	721,886.02	(2,221.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	620,000.00	651,417.87	649,145.66	(2,272.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	03/04/2018	90,000.00	96,159.49	93,860.94	(2,297.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	03/01/2018	90,000.00	97,742.96	95,426.82	(2,316.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	05/02/2018	800,000.00	845,101.08	842,748.88	(2,352.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	440,000.00	465,147.57	462,749.26	(2,398.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,200,000.00	1,255,157.03	1,252,752.43	(2,404.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	26/02/2018	540,000.00	568,927.45	566,489.23	(2,438.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	21/02/2018	180,000.00	191,549.87	189,017.56	(2,532.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	370,000.00	391,908.14	389,179.94	(2,728.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/06/2018	910,000.00	936,438.76	933,705.93	(2,732.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	12/03/2018	180,000.00	191,243.61	188,476.24	(2,767.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	21/11/2017	22/02/2018	40,000.00	46,060.50	43,275.98	(2,784.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	180,000.00	191,273.42	188,405.83	(2,867.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2017	16/02/2018	90,000.00	97,492.33	94,609.47	(2,882.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,560,000.00	4,823,386.32	4,820,401.84	(2,984.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2017	17/04/2018	90,000.00	96,481.37	93,456.75	(3,024.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2017	18/01/2018	90,000.00	98,178.77	95,139.51	(3,039.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	07/12/2017	09/03/2018	90,000.00	101,828.94	98,787.72	(3,041.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	2,590,000.00	2,727,311.18	2,724,259.56	(3,051.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	14/02/2018	180,000.00	192,386.57	189,293.50	(3,093.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/01/2018	630,000.00	668,585.28	665,486.49	(3,098.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/02/2018	910,000.00	960,247.81	957,107.91	(3,139.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	920,000.00	969,448.73	966,281.76	(3,166.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	06/02/2018	180,000.00	192,761.09	189,591.72	(3,169.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	04/03/2018	200,000.00	210,581.59	207,339.99	(3,241.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/05/2018	380,000.00	399,947.05	396,704.94	(3,242.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	14/03/2018	1,170,000.00	1,227,889.88	1,224,637.87	(3,252.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	22/01/2018	1,640,000.00	1,735,608.22	1,732,317.25	(3,290.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	1,210,000.00	1,272,920.78	1,269,582.38	(3,338.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	08/01/2018	820,000.00	871,978.90	868,584.39	(3,394.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30/11/2017	28/02/2018	70,000.00	80,353.22	76,923.19	(3,430.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	01/12/2017	04/05/2018	200,000.00	210,848.38	207,339.99	(3,508.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superválit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	460.000.00	490.111.98	486.875.72	(3.536.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	25/01/2018	690.000.00	731.922.58	728.374.81	(3.547.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1.170.000.00	1.240.763.85	1.237.062.66	(3.701.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1.640.000.00	1.737.012.98	1.733.304.23	(3.708.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	06/03/2018	950.000.00	999.569.93	995.752.25	(3.817.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1.400.000.00	1.484.175.30	1.480.327.30	(3.848.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	05/01/2018	5.800.000.00	6.151.133.12	6.147.260.02	(3.873.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	1.040.000.00	1.096.284.50	1.092.318.51	(3.945.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2.740.000.00	2.899.963.83	2.895.886.33	(4.077.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	910.000.00	965.859.46	961.772.47	(4.086.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	480.000.00	511.761.23	507.641.48	(4.119.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	26/03/2018	1.460.000.00	1.549.242.08	1.545.061.33	(4.180.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	14/02/2018	1.730.000.00	1.823.506.17	1.819.320.87	(4.185.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	11/01/2018	2.240.000.00	2.375.506.57	2.371.253.96	(4.252.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	18/01/2018	6.920.000.00	7.319.466.53	7.315.171.22	(4.295.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	360.000.00	381.235.71	376.923.29	(4.312.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	160.000.00	173.101.21	168.757.91	(4.343.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	04/01/2018	730.000.00	778.220.69	773.862.21	(4.358.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	08/02/2018	270.000.00	288.649.94	284.258.75	(4.391.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	15/01/2018	2.290.000.00	2.426.801.65	2.422.234.20	(4.567.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	460.000.00	484.890.85	480.221.76	(4.669.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	1.140.000.00	1.200.890.88	1.196.026.39	(4.864.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1.200.000.00	1.273.198.36	1.268.271.38	(4.926.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	1.830.000.00	1.943.018.09	1.938.039.47	(4.978.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	26/01/2018	1.000.000.00	1.060.476.16	1.055.402.81	(5.073.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	360.000.00	381.478.37	376.343.96	(5.134.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	550.000.00	586.825.49	581.657.39	(5.168.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	3.820.000.00	4.022.985.80	4.017.749.70	(5.236.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	26/09/2017	27/03/2018	100.000.00	106.976.01	103.737.60	(5.238.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	22/01/2018	270.000.00	290.755.59	285.198.57	(5.557.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	21/03/2018	320.000.00	340.201.14	334.464.86	(5.736.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	05/01/2018	590.000.00	631.090.97	625.324.73	(5.766.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	420.000.00	449.200.62	443.358.58	(5.842.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	21/02/2018	1.270.000.00	1.276.460.81	1.270.618.08	(5.842.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	830.000.00	883.860.33	877.796.72	(6.063.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	200.000.00	213.821.54	207.614.45	(6.207.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	02/01/2018	1.310.658.50	1.310.658.50	1.304.428.32	(6.230.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1.090.000.00	1.158.548.63	1.152.245.18	(6.303.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	09/02/2018	640.000.00	680.141.15	673.664.99	(6.476.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	02/02/2018	2.920.000.00	3.084.339.71	3.077.861.00	(6.478.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,090,000.00	1,158,795.21	1,152,245.18	(6,550.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/08/2017	06/08/2018	100,000.00	108,903.13	102,301.87	(6,601.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,820,000.00	1,930,157.26	1,923,544.93	(6,612.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/09/2017	26/03/2018	500,000.00	522,556.10	515,887.82	(6,668.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	180,000.00	196,767.45	190,056.31	(6,711.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	20/09/2017	19/03/2018	900,000.00	941,088.32	934,272.38	(6,815.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/01/2018	670,000.00	715,786.88	708,688.61	(7,098.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	1,360,000.00	1,442,506.75	1,435,406.16	(7,099.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	480,000.00	493,774.25	486,464.42	(7,309.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	540,000.00	577,416.16	569,917.51	(7,498.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	19/01/2018	520,000.00	557,228.07	549,600.98	(7,627.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/11/2017	08/05/2018	300,000.00	316,250.93	308,611.78	(7,639.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	450,000.00	479,269.18	471,583.40	(7,685.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	8,710,000.00	9,153,172.62	9,145,270.19	(7,902.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/10/2017	05/03/2018	200,000.00	209,638.97	201,655.82	(7,983.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	520,000.00	557,948.46	549,805.63	(8,142.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	3,610,000.00	3,803,349.58	3,795,163.17	(8,186.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	15/02/2018	2,090,000.00	2,205,592.63	2,197,320.70	(8,271.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	08/01/2018	910,000.00	972,302.05	963,902.92	(8,399.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	30/01/2018	1,460,000.00	1,548,270.03	1,539,844.25	(8,425.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	06/02/2018	540,000.00	577,244.90	568,742.83	(8,502.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	1,090,000.00	1,160,767.81	1,152,245.18	(8,522.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	08/02/2018	500,000.00	535,294.31	526,436.59	(8,857.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	15/02/2018	1,390,000.00	1,470,284.59	1,461,375.97	(8,908.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	7,520,000.00	7,958,532.60	7,949,434.62	(9,097.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	11/09/2017	08/03/2018	300,000.00	320,833.48	311,714.72	(9,118.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	5,090,000.00	5,381,627.52	5,372,218.65	(9,408.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	1,360,000.00	1,438,331.23	1,428,700.32	(9,630.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2017	15/01/2018	1,640,000.00	1,744,428.50	1,734,700.48	(9,728.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	400,000.00	425,064.26	415,230.19	(9,834.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	22/02/2018	2,640,000.00	2,781,806.72	2,771,706.70	(10,100.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/08/2017	23/08/2018	200,000.00	214,655.07	204,695.18	(10,159.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	12/01/2018	1,610,000.00	1,714,160.96	1,703,996.13	(10,164.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/09/2017	19/03/2018	100,000.00	113,545.99	103,294.49	(10,251.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	11/01/2018	1,090,000.00	1,164,155.87	1,153,869.11	(10,286.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	319,831.84	309,418.78	(10,413.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	02/02/2018	1,820,000.00	1,929,076.71	1,918,392.82	(10,683.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	5,794,420.81	5,994,420.81	5,783,691.24	(10,729.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	20/06/2018	1,540,000.00	1,590,796.35	1,579,801.16	(10,997.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/10/2017	18/04/2018	1,100,000.00	1,145,532.04	1,133,987.88	(11,544.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	23/01/2018	400,000.00	426,195.27	414,631.72	(11,563.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	27/12/2017	26/01/2018	2,730,000.00	2,893,161.78	2,881,366.78	(11,795.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	1,160,000.00	1,237,815.55	1,225,995.67	(11,819.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	16/02/2018	1,820,000.00	1,925,201.64	1,913,076.53	(12,125.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	2,270,000.00	2,412,383.82	2,400,113.02	(12,270.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2017	01/02/2018	2,250,000.00	2,384,397.47	2,372,108.87	(12,288.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	24/02/2017	23/02/2018	500,000.00	525,417.80	512,735.26	(12,682.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	2,450,000.00	2,587,151.51	2,573,450.27	(13,701.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/10/2017	18/04/2018	700,000.00	735,417.78	721,515.49	(13,902.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	2,730,000.00	2,900,148.47	2,885,898.47	(14,250.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/09/2017	21/09/2018	2,500,000.00	2,554,818.15	2,540,501.42	(14,316.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	07/02/2018	1,750,000.00	1,857,659.19	1,842,997.99	(14,661.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	17/05/2018	500,000.00	526,787.84	514,097.30	(14,690.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/09/2017	27/08/2018	800,000.00	830,636.93	815,787.96	(14,848.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	529,152.93	513,628.45	(15,524.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	22/01/2018	800,000.00	872,437.97	856,906.22	(15,531.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	29/05/2018	500,000.00	529,363.27	513,628.45	(15,734.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2,180,000.00	2,320,325.10	2,304,096.40	(16,228.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	04/01/2018	4,300,000.00	4,574,985.49	4,558,366.46	(16,619.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	25/01/2018	4,550,000.00	4,819,841.10	4,803,051.31	(16,789.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	7,570,000.00	8,020,933.15	8,004,121.15	(16,812.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,370,000.00	4,637,006.88	4,619,819.21	(17,187.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	900,000.00	981,931.56	964,690.24	(17,241.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	16/02/2018	700,000.00	746,357.06	729,044.47	(17,312.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	16/02/2018	200,000.00	231,071.83	213,736.58	(17,335.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	16/03/2018	8,200,000.00	8,603,016.49	8,585,111.33	(17,905.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/08/2017	22/02/2018	3,100,000.00	3,223,106.90	3,204,931.56	(18,175.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	24/01/2018	3,100,000.00	3,291,260.03	3,273,068.47	(18,191.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	25/01/2018	6,300,000.00	6,669,091.96	6,650,378.74	(18,713.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	19/12/2017	19/06/2018	900,000.00	942,735.60	923,667.68	(19,067.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/08/2017	09/08/2018	300,000.00	326,260.31	307,031.09	(19,229.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/02/2018	3,070,000.00	3,241,198.39	3,221,154.66	(20,043.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/08/2017	16/02/2018	420,000.00	461,769.86	441,510.86	(20,259.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	03/01/2018	5,490,000.00	5,842,524.55	5,821,036.17	(21,488.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/10/2017	11/04/2018	100,000.00	124,726.30	103,070.39	(21,655.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	04/08/2017	05/01/2018	200,000.00	231,884.78	208,896.69	(22,988.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	19/07/2018	300,000.00	339,886.41	316,825.20	(23,061.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	26/04/2018	200,000.00	235,553.80	212,364.76	(23,189.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0122	15/02/2017	09/02/2018	470.000.00	541.865.89	517.962.55	(23.903.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2017	21/02/2018	5.500.000.00	5.799.705.50	5.775.536.70	(24.168.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	07/07/2017	05/01/2018	200.000.00	233.125.26	208.896.69	(24.228.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/08/2017	16/01/2018	270.000.00	310.094.23	285.540.90	(24.553.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	400.000.00	437.616.57	412.540.91	(25.075.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	18/01/2018	9.120.000.00	9.666.046.60	9.640.803.69	(25.242.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2017	03/01/2018	9.390.000.00	9.981.462.01	9.956.198.48	(25.263.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	09/01/2018	600.000.00	648.724.40	622.853.34	(25.871.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	01/02/2018	200.000.00	240.107.06	214.043.01	(26.064.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/08/2017	31/01/2018	100.000.00	133.129.88	107.031.72	(26.098.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/04/2017	10/04/2018	100.000.00	129.302.65	103.153.33	(26.149.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	9.120.000.00	9.669.136.63	9.642.744.63	(26.393.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	12/03/2018	900.000.00	956.567.47	930.130.13	(26.437.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8.210.000.00	8.705.307.50	8.678.837.53	(26.469.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	04/06/2018	100.000.00	132.515.45	105.790.26	(26.725.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/03/2017	15/03/2018	300.000.00	338.783.24	312.015.31	(26.767.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	03/04/2018	200.000.00	233.137.64	206.298.28	(26.839.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	18/04/2018	800.000.00	853.895.66	824.718.46	(29.177.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	31/07/2017	25/01/2018	890.000.00	1.012.045.48	981.870.43	(30.175.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/02/2018	7.300.000.00	7.698.960.28	7.668.759.06	(30.201.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	03/10/2017	31/01/2018	1.100.000.00	1.176.269.68	1.146.041.52	(30.228.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/10/2017	09/01/2018	300.000.00	342.035.00	311.421.67	(30.613.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	17/10/2017	17/04/2018	300.000.00	339.900.48	309.065.25	(30.835.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/10/2017	11/10/2018	800.000.00	842.385.28	811.251.30	(31.133.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/10/2017	03/04/2018	900.000.00	960.718.41	929.310.11	(31.408.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	200.000.00	246.444.41	213.654.86	(32.789.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	10/01/2018	3.630.000.00	3.876.446.43	3.843.474.28	(32.972.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	26/02/2018	600.000.00	673.572.69	640.596.85	(32.975.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	30/01/2018	2.700.000.00	2.924.170.75	2.890.132.24	(34.038.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2017	05/04/2018	2.500.000.00	2.613.903.03	2.579.653.78	(34.249.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/03/2018	6.340.000.00	6.664.195.62	6.629.824.02	(34.371.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/10/2017	19/01/2018	5.700.000.00	5.946.039.69	5.910.916.68	(35.122.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/09/2017	07/03/2018	200.000.00	241.852.02	206.672.68	(35.179.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	02/11/2017	15/06/2018	1.400.000.00	1.472.351.06	1.436.882.59	(35.468.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	22/01/2018	200.000.00	243.255.05	207.370.16	(35.884.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/09/2017	12/01/2018	200.000.00	250.994.15	214.439.49	(36.554.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	05/01/2018	1.100.000.00	1.179.410.67	1.142.288.73	(37.121.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	400,000.00	456,246.24	428,878.98	(37,367.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	12/01/2018	900,000.00	971,628.07	934,047.26	(37,580.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	19/04/2018	900,000.00	965,906.50	927,594.71	(38,311.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/07/2017	11/01/2018	200,000.00	252,842.67	214,460.78	(38,381.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	08/01/2018	4,100,000.00	4,381,279.93	4,342,859.32	(38,420.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	05/01/2018	600,000.00	682,243.84	643,765.63	(38,478.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	16/01/2018	100,000.00	147,321.73	107,177.16	(40,144.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/11/2017	05/02/2018	100,000.00	147,558.83	106,980.65	(40,578.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	20/07/2017	16/01/2018	300,000.00	353,874.61	311,523.67	(42,350.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/08/2017	30/01/2018	200,000.00	249,576.24	207,222.40	(42,353.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	12/10/2018	400,000.00	450,387.09	407,576.96	(42,810.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	11/01/2018	1,200,000.00	1,286,790.62	1,245,476.14	(43,314.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	25/01/2018	150,000.00	150,607.50	107,081.34	(43,526.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	20/03/2018	100,000.00	148,355.05	103,968.25	(44,386.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	18/01/2018	100,000.00	151,604.79	107,155.86	(44,448.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/12/2017	17/04/2018	900,000.00	972,473.10	927,730.84	(44,742.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/11/2017	21/05/2018	400,000.00	455,933.90	411,132.82	(44,801.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/10/2017	08/02/2018	800,000.00	873,219.07	828,183.74	(45,035.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	18/01/2018	500,000.00	580,978.52	535,779.32	(45,199.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/10/2017	16/10/2018	100,000.00	147,154.32	101,823.89	(45,330.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	08/01/2018	900,000.00	1,010,865.60	965,360.99	(45,504.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	12/10/2017	10/01/2018	900,000.00	980,779.50	935,063.55	(45,715.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	17/01/2018	800,000.00	875,590.92	829,735.44	(45,855.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/09/2017	13/03/2018	200,000.00	252,841.55	206,680.35	(46,161.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	06/04/2018	200,000.00	259,087.33	212,766.94	(46,320.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	03/11/2017	01/11/2018	100,000.00	148,945.86	101,753.63	(47,192.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/10/2017	19/04/2018	500,000.00	563,170.20	515,190.76	(47,979.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	100,000.00	132,550.95	104,378.31	(48,172.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	900,000.00	987,654.95	939,404.75	(48,250.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/11/2017	09/05/2018	1,400,000.00	1,489,470.90	1,441,077.20	(48,393.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	08/11/2017	04/05/2018	700,000.00	773,264.43	724,536.10	(48,728.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27/12/2017	01/03/2018	400,000.00	464,598.82	415,325.57	(49,273.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/09/2017	02/03/2018	500,000.00	583,410.27	533,995.99	(49,414.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	12/01/2018	1,100,000.00	1,191,030.47	1,141,589.96	(49,440.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/11/2017	16/02/2018	1,600,000.00	1,704,523.98	1,655,064.45	(49,459.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31/10/2017	01/05/2018	1,100,000.00	1,184,830.07	1,133,127.06	(51,703.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/12/2017	05/06/2018	900,000.00	976,298.49	924,392.38	(51,906.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	06/09/2017	31/08/2018	200,000.00	258,539.70	204,378.57	(54,161.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	13/02/2018	1,100,000.00	1,193,188.94	1,138,535.01	(54,653.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	500,000.00	591,712.67	536,205.19	(55,507.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,017,265.78	1,961,273.03	(55,992.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	6,790,000.00	7,186,471.09	7,130,162.59	(56,308.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	17/01/2018	400,000.00	485,019.68	428,666.04	(56,353.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	02/03/2018	400,000.00	484,249.55	427,196.79	(57,052.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/11/2017	18/04/2018	700,000.00	779,028.55	721,741.84	(57,286.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26/10/2017	25/04/2018	400,000.00	469,696.66	411,965.21	(57,731.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	19/06/2018	500,000.00	570,441.36	512,679.71	(57,761.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/09/2017	26/03/2018	4,600,000.00	4,807,229.38	4,749,094.26	(58,135.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/12/2017	09/01/2018	500,000.00	594,601.70	536,258.43	(58,343.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/09/2017	08/03/2018	300,000.00	370,362.36	311,714.72	(58,647.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	05/01/2018	400,000.00	487,983.46	429,177.09	(58,806.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/12/2017	19/01/2018	800,000.00	888,460.46	829,578.11	(58,882.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	23/01/2018	4,600,000.00	4,827,484.14	4,768,430.71	(59,053.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	18/01/2018	600,000.00	681,359.11	622,242.58	(59,116.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	17/01/2018	600,000.00	683,243.97	622,301.58	(60,942.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	15/02/2018	400,000.00	488,966.28	427,514.01	(61,452.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/11/2017	19/01/2018	400,000.00	490,335.67	428,580.87	(61,754.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/06/2017	15/06/2018	1,300,000.00	1,437,438.60	1,375,048.21	(62,390.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	10/04/2018	6,800,000.00	7,076,657.89	7,014,138.86	(62,519.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	24/11/2017	25/01/2018	600,000.00	689,721.53	625,949.28	(63,772.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	24/01/2018	500,000.00	582,412.18	518,259.24	(64,152.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/11/2017	20/03/2018	700,000.00	787,108.11	722,676.79	(64,431.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	200,000.00	276,390.40	211,399.54	(64,990.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,443,628.47	2,378,570.60	(65,057.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	03/10/2017	03/04/2018	1,900,000.00	2,037,241.42	1,971,306.91	(65,934.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/11/2017	03/01/2018	400,000.00	482,341.08	415,439.41	(66,901.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	17/01/2018	3,600,000.00	3,926,093.55	3,857,994.40	(68,099.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	01/02/2018	700,000.00	817,680.93	749,150.54	(68,530.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	300,000.00	390,230.72	321,125.80	(69,104.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/08/2017	20/02/2018	1,300,000.00	1,414,813.00	1,344,348.99	(70,464.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	08/01/2018	400,000.00	491,070.99	417,905.02	(73,165.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/10/2017	23/01/2018	3,900,000.00	4,116,044.33	4,042,659.24	(73,385.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/11/2017	10/05/2018	600,000.00	713,266.47	636,689.46	(76,577.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	23/01/2018	900,000.00	1,015,824.04	939,084.19	(76,739.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	12/01/2018	600,000.00	720,209.20	643,318.47	(76,890.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/11/2017	08/01/2018	4,500,000.00	4,750,672.43	4,671,856.19	(78,816.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	27/04/2018	600,000.00	717,007.93	637,430.39	(79,577.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/08/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,366,062.88	1,284,503.22	(81,559.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0423	11/08/2017	07/02/2018	1,100,000.00	1,214,337.76	1,132,340.89	(81,996.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/12/2017	11/01/2018	2,000,000.00	2,160,489.04	2,075,793.57	(84,695.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	28/03/2018	200,000.00	298,715.84	212,901.11	(85,814.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/11/2017	08/05/2018	700,000.00	806,974.04	720,456.25	(86,517.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/11/2017	04/01/2018	1,100,000.00	1,279,669.26	1,142,381.88	(87,287.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	404,339.65	316,918.34	(87,421.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/11/2017	21/03/2018	1,100,000.00	1,224,971.61	1,135,412.94	(89,558.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,164,739.00	1,072,197.45	(92,541.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/10/2017	24/01/2018	4,600,000.00	4,741,796.79	4,647,360.73	(94,436.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	22/01/2018	800,000.00	952,165.16	856,906.22	(95,258.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	11/01/2018	1,000,000.00	1,133,927.76	1,037,896.78	(96,030.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/11/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,445,733.89	1,345,515.58	(99,218.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/11/2017	06/02/2018	2,100,000.00	2,344,049.89	2,246,379.09	(97,670.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/11/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,172,384.50	1,072,197.45	(100,187.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/06/2018	300,000.00	418,449.02	316,918.34	(101,530.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/01/2017	04/07/2018	900,000.00	1,027,110.60	922,635.29	(104,475.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	05/09/2017	06/03/2018	1,700,000.00	1,872,662.53	1,768,682.78	(103,979.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/02/2018	10,920,000.00	11,593,296.96	11,485,294.95	(108,002.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	800,000.00	971,747.20	857,757.96	(113,989.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	800,000.00	972,830.45	857,502.44	(115,328.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	800,000.00	973,786.07	857,502.44	(116,283.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	14/03/2018	1,100,000.00	1,262,586.47	1,136,297.04	(116,289.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	1,700,000.00	1,939,149.87	1,822,735.66	(116,414.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	19/02/2018	1,100,000.00	1,292,314.30	1,175,214.08	(117,100.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	08/01/2018	1,700,000.00	1,944,236.52	1,823,459.65	(120,776.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	1,700,000.00	1,944,158.19	1,822,916.66	(121,241.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/01/2018	1,300,000.00	1,515,455.85	1,392,195.79	(123,260.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/12/2017	10/01/2018	2,100,000.00	2,306,132.88	2,179,767.47	(126,365.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/10/2017	18/01/2018	6,100,000.00	6,662,955.66	6,536,507.72	(126,447.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29/11/2017	15/05/2018	800,000.00	958,413.68	823,116.59	(135,297.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30/11/2017	04/01/2018	1,300,000.00	1,486,006.88	1,350,064.05	(135,942.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2017	23/05/2018	1,200,000.00	1,370,221.14	1,234,220.16	(136,000.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	24/10/2017	24/04/2018	1,800,000.00	2,051,189.94	1,912,804.13	(138,385.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/11/2017	08/01/2018	2,700,000.00	2,942,299.48	2,804,031.88	(139,267.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	24/11/2017	23/01/2018	1,800,000.00	1,959,128.07	1,818,668.03	(140,460.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	10/01/2018	1,500,000.00	1,752,878.45	1,608,615.58	(144,262.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,530,089.46	2,380,573.19	(149,516.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31/10/2017	31/01/2018	4,300,000.00	4,608,652.37	4,455,504.00	(153,148.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	11/01/2018	1,100,000.00	1,299,167.46	1,141,696.46	(157,481.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	22/08/2017	20/02/2018	2,100,000.00	2,353,153.74	2,183,736.81	(169,416.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	16/11/2017	15/05/2018	800,000.00	1,019,544.57	848,539.31	(171,005.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	2,700,000.00	2,973,860.39	2,799,826.13	(174,034.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/12/2017	06/06/2018	1,700,000.00	1,920,819.75	1,746,346.87	(174,472.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/12/2017	05/01/2018	1,500,000.00	1,735,834.35	1,557,634.65	(178,199.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	22/11/2017	22/05/2018	1,700,000.00	1,926,984.16	1,748,239.74	(178,744.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	2,600,000.00	2,875,411.60	2,696,128.87	(179,282.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	12/01/2018	2,600,000.00	2,881,537.00	2,698,303.54	(183,233.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	29/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,575,320.52	2,391,028.21	(184,292.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/12/2017	15/03/2018	2,600,000.00	2,872,194.82	2,685,006.99	(187,187.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/12/2017	08/01/2018	2,600,000.00	2,887,606.77	2,699,215.88	(188,390.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/11/2017	08/05/2018	3,400,000.00	3,691,279.89	3,500,663.56	(190,616.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	25/01/2018	1,900,000.00	2,229,297.28	2,034,545.40	(194,751.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/07/2017	12/07/2018	2,000,000.00	2,308,172.00	2,110,329.23	(197,842.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/06/2017	15/06/2018	1,900,000.00	2,207,613.80	2,009,685.85	(197,927.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/04/2017	05/04/2018	4,800,000.00	5,157,716.15	4,955,666.77	(202,049.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30/11/2017	30/05/2018	2,100,000.00	2,362,062.34	2,158,816.66	(203,245.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	01/09/2017	01/03/2018	4,300,000.00	4,681,587.97	4,470,561.44	(211,026.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	13/03/2018	2,600,000.00	2,898,671.46	2,685,441.49	(213,229.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/11/2017	05/01/2018	4,000,000.00	4,367,362.27	4,153,692.39	(213,669.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	14/02/2018	3,100,000.00	3,421,513.94	3,207,272.57	(214,241.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/12/2017	10/01/2018	2,200,000.00	2,499,455.12	2,283,645.97	(215,809.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	12/06/2018	4,200,000.00	4,533,785.87	4,313,663.10	(220,122.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	11/01/2018	2,100,000.00	2,405,141.39	2,179,563.25	(225,578.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	11/01/2018	2,900,000.00	3,335,344.64	3,109,681.36	(225,663.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	31/01/2018	2,500,000.00	2,902,520.00	2,675,793.01	(226,727.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2017	03/01/2018	2,100,000.00	2,411,619.48	2,181,056.88	(230,562.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	1,600,000.00	1,943,904.81	1,712,670.96	(231,233.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/12/2017	08/01/2018	4,400,000.00	4,808,293.25	4,567,903.80	(240,389.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/12/2017	16/01/2018	3,300,000.00	3,672,478.36	3,423,411.28	(249,067.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/09/2017	02/03/2018	19,200,000.00	20,766,993.59	20,515,903.07	(251,090.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/12/2017	11/01/2018	3,000,000.00	3,366,306.80	3,113,749.49	(252,557.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	20/10/2017	15/02/2018	4,400,000.00	4,840,648.70	4,572,627.94	(263,020.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/12/2017	28/03/2018	3,100,000.00	3,478,073.17	3,212,405.08	(265,668.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	08/12/2017	05/01/2018	2,500,000.00	2,879,631.17	2,611,208.64	(268,422.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/10/2017	24/01/2018	9,000,000.00	9,597,605.57	9,328,328.53	(269,277.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	12/06/2018	5,800,000.00	6,231,947.20	5,956,963.33	(274,983.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	3,300,000.00	3,703,968.56	3,422,109.66	(281,858.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/11/2017	08/01/2018	6,100,000.00	6,831,354.87	6,543,002.26	(288,352.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	04/01/2018	2,500,000.00	2,891,352.69	2,596,277.02	(295,075.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/12/2017	09/01/2018	3,600,000.00	4,033,629.88	3,737,120.06	(296,509.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	18/01/2018	3,500,000.00	3,937,313.70	3,629,748.40	(307,565.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	4,600,000.00	5,245,661.98	4,933,087.77	(312,574.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	15/01/2018	4,400,000.00	4,892,566.43	4,564,625.76	(327,940.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	29/11/2017	26/03/2018	1,800,000.00	2,199,130.67	1,867,435.24	(331,695.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29/11/2017	28/05/2018	3,000,000.00	3,421,221.30	3,084,460.00	(336,761.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/11/2017	29/05/2018	4,100,000.00	4,552,291.80	4,215,130.60	(337,161.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	22/01/2018	3,100,000.00	3,658,194.89	3,320,511.59	(337,683.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/12/2017	04/01/2018	4,300,000.00	4,804,816.99	4,465,596.47	(339,220.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	23/01/2018	3,300,000.00	3,876,136.55	3,534,386.80	(341,749.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	06/12/2017	06/02/2018	4,300,000.00	4,795,170.53	4,452,529.29	(342,641.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	4,200,000.00	4,854,902.80	4,503,676.45	(351,226.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	24/11/2017	24/01/2018	1,600,000.00	2,020,104.06	1,667,910.31	(352,193.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	15/01/2018	3,300,000.00	3,889,927.10	3,537,197.55	(352,729.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	18/01/2018	5,200,000.00	5,745,715.08	5,392,769.06	(352,946.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	12/01/2018	5,200,000.00	5,766,106.74	5,396,607.08	(369,499.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/07/2017	04/07/2018	4,600,000.00	5,236,088.00	4,857,252.93	(378,835.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/11/2017	12/01/2018	3,400,000.00	3,915,494.10	3,528,911.76	(386,582.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/12/2017	10/01/2018	5,200,000.00	5,790,045.53	5,397,992.48	(392,053.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	26/11/2018	4,400,000.00	4,854,885.24	4,454,765.18	(400,120.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	08/01/2018	3,700,000.00	4,381,918.47	3,968,706.29	(413,212.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/02/2018	4,200,000.00	4,912,406.68	4,489,755.11	(422,651.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	22/01/2018	5,000,000.00	5,808,329.18	5,355,663.85	(452,665.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	18/01/2018	3,200,000.00	3,884,987.32	3,428,987.66	(455,999.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	18/01/2018	4,100,000.00	4,751,341.12	4,279,875.63	(471,465.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	25/01/2018	3,500,000.00	4,220,852.91	3,747,846.79	(473,006.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/12/2017	05/01/2018	4,100,000.00	4,873,772.39	4,399,065.17	(474,707.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/11/2017	06/02/2018	8,800,000.00	9,596,016.67	9,113,643.50	(482,373.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	31/10/2017	01/02/2018	13,200,000.00	14,234,447.04	13,751,190.62	(483,256.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	6,300,000.00	7,270,842.60	6,751,490.19	(519,352.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	17/01/2018	4,700,000.00	5,444,501.36	4,906,617.40	(537,883.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/02/2018	6,100,000.00	7,066,136.86	6,517,096.28	(549,040.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/12/2017	08/01/2018	8,700,000.00	9,610,930.77	9,031,991.60	(578,939.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	11/01/2018	6,700,000.00	7,764,078.92	7,184,436.25	(579,642.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00129	31/10/2017	01/02/2018	17,200,000.00	18,500,037.82	17,918,218.08	(582,719.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	13/02/2018	8,700,000.00	9,892,162.85	9,300,207.01	(591,955.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/11/2017	12/01/2018	8,000,000.00	8,911,986.08	8,302,472.43	(609,513.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/11/2017	16/03/2018	4,600,000.00	5,398,615.80	4,750,529.31	(648,086.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	25/01/2018	7,800,000.00	9,008,739.49	8,352,344.26	(656,395.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/12/2017	10/01/2018	8,600,000.00	9,610,698.52	8,926,666.79	(684,031.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/12/2017	08/01/2018	8,000,000.00	9,006,469.02	8,305,279.63	(701,189.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	26/01/2018	10,900,000.00	12,004,421.00	11,295,498.33	(708,922.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	19/01/2017	17/01/2018	30,700,000.00	32,639,380.37	31,876,455.95	(762,924.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	12/12/2017	11/01/2018	11,300,000.00	12,497,461.98	11,728,456.40	(768,005.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/12/2017	12/01/2018	8,500,000.00	9,600,065.17	8,821,376.96	(778,688.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	19/01/2018	9,400,000.00	10,563,270.73	9,747,542.83	(815,617.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	15/01/2018	10,300,000.00	11,503,278.87	10,684,869.26	(818,409.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	11/01/2018	11,900,000.00	13,175,355.37	12,351,206.30	(824,149.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	21/11/2017	18/01/2018	6,800,000.00	7,948,501.63	7,098,330.32	(850,171.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	11,500,000.00	13,231,807.40	12,326,597.53	(905,209.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	28/11/2017	29/05/2018	4,900,000.00	5,998,220.94	5,061,959.07	(936,261.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	11,300,000.00	13,067,828.50	12,109,815.75	(958,012.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	04/12/2017	05/01/2018	8,200,000.00	9,617,388.56	8,564,764.35	(1,052,624.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	15/01/2018	16,700,000.00	18,430,124.82	17,324,829.57	(1,105,295.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/11/2017	15/05/2018	8,600,000.00	9,968,183.76	8,848,503.33	(1,119,680.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	11/01/2018	17,700,000.00	19,519,231.84	18,371,470.89	(1,147,760.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	13/02/2018	18,300,000.00	20,144,151.20	18,934,981.43	(1,209,169.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	9,900,000.00	11,843,921.37	10,597,151.54	(1,246,769.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	05/09/2017	06/03/2018	19,500,000.00	21,553,236.47	20,275,485.61	(1,277,750.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/11/2017	07/02/2018	20,100,000.00	22,778,091.82	21,499,003.90	(1,279,087.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	14/03/2018	20,900,000.00	22,893,995.13	21,602,249.35	(1,291,745.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/08/2017	30/07/2018	10,500,000.00	11,966,651.12	10,673,872.17	(1,292,778.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	18/01/2018	16,200,000.00	18,211,936.24	16,800,549.75	(1,411,386.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	15/12/2017	12/01/2018	17,600,000.00	19,682,456.44	18,267,307.94	(1,415,148.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/11/2017	08/02/2018	22,500,000.00	24,707,946.58	23,291,332.01	(1,416,614.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	31/10/2017	01/02/2018	41,700,000.00	44,912,026.32	43,441,261.28	(1,470,765.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/12/2017	08/01/2018	17,100,000.00	19,262,319.88	17,752,535.22	(1,509,784.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/12/2017	04/01/2018	11,400,000.00	13,755,733.37	12,232,760.80	(1,522,972.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	24/11/2017	08/01/2018	8,200,000.00	10,100,299.79	8,561,569.37	(1,538,730.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/12/2017	06/03/2018	21,400,000.00	23,748,398.69	22,131,470.18	(1,616,928.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/11/2017	23/01/2018	16,000,000.00	18,283,167.45	16,585,268.67	(1,697,898.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/12/2017	22/01/2018	15,500,000.00	17,772,263.39	16,069,040.10	(1,703,223.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	05/01/2018	18,300,000.00	21,421,313.43	19,634,851.86	(1,786,461.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	08/01/2018	17,800,000.00	20,930,828.65	19,092,695.12	(1,838,133.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	20/10/2017	18/04/2018	25,300,000.00	28,303,641.44	26,219,167.58	(2,084,473.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	01/03/2018	39,600,000.00	43,596,318.34	40,967,924.19	(2,630,394.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	08/12/2017	09/01/2018	43,700,000.00	48,028,834.16	45,363,756.60	(2,665,077.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	12/01/2018	43,400,000.00	47,971,453.45	45,040,912.95	(2,930,540.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	18/01/2018	42,900,000.00	47,880,573.25	44,491,581.84	(3,388,991.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	15/12/2017	16/01/2018	40,400,000.00	45,144,802.02	41,649,092.55	(3,495,709.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	33,700,000.00	38,466,922.35	34,945,978.03	(3,520,944.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	33,700,000.00	38,466,922.35	34,945,978.03	(3,520,944.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	33,700,000.00	39,565,912.37	36,012,439.62	(3,553,472.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	01/12/2017	03/01/2018	101,900,000.00	110,187,827.40	106,451,542.34	(3,736,285.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00129	18/12/2017	17/01/2018	31,000,000.00	37,534,697.88	32,338,138.81	(5,196,559.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	48,700,000.00	58,106,502.81	52,041,715.41	(6,064,787.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	01/03/2018	58,200,000.00	68,981,230.96	62,193,590.08	(6,787,640.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	21/03/2018	61,800,000.00	74,879,994.92	65,872,538.42	(9,007,456.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/01/2017	09/01/2018	43,700,000.00	43,002,111.87	45,367,399.93	2,365,288.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/10/2017	30/01/2018	45,600,000.00	45,892,536.77	47,253,036.01	1,360,499.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,324,686.71	42,498,290.52	1,173,603.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	01/02/2018	45,500,000.00	46,038,852.41	47,141,487.65	1,102,635.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/01/2017	10/01/2018	11,400,000.00	11,489,649.60	12,225,478.39	735,828.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/08/2017	15/01/2018	47,900,000.00	49,103,183.82	49,691,002.33	587,818.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26/06/2017	26/06/2018	7,000,000.00	6,677,556.58	7,167,920.36	510,363.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/01/2017	23/01/2018	14,700,000.00	14,868,535.18	15,237,715.59	369,180.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/10/2017	10/01/2018	12,300,000.00	12,518,749.70	12,768,328.38	249,578.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/07/2017	05/04/2018	32,200,000.00	33,039,228.60	33,240,807.55	201,578.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	10/10/2017	11/04/2018	12,600,000.00	12,800,867.32	12,995,852.94	194,985.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	03/10/2017	04/01/2018	9,000,000.00	9,186,882.79	9,346,597.27	159,714.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	4,380,000.00	4,462,753.08	4,618,162.22	155,409.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	16/10/2017	16/01/2018	12,600,000.00	12,918,013.16	13,071,206.71	153,193.55	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/07/2017	05/04/2018	41,300,000.00	42,492,454.90	42,634,948.81	142,493.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	05/04/2018	22,900,000.00	23,536,808.24	23,642,660.21	105,851.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/10/2017	11/04/2018	2,300,000.00	2,277,219.20	2,372,606.61	95,387.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31/08/2017	01/03/2018	4,800,000.00	4,881,739.82	4,962,549.85	80,810.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	11/01/2018	2,600,000.00	2,625,039.36	2,698,634.14	73,594.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	300,000.00	262,522.50	321,755.06	59,232.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/09/2017	13/03/2018	5,600,000.00	5,729,609.24	5,787,359.68	57,750.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/01/2017	03/01/2018	2,100,000.00	2,198,959.60	2,253,626.89	54,667.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	11/01/2018	4,800,000.00	4,930,005.88	4,982,093.80	52,087.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/10/2017	11/10/2018	1,200,000.00	1,174,493.39	1,216,876.95	42,383.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	13/02/2018	13,830,000.00	14,511,114.67	14,545,936.74	34,822.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/01/2017	31/01/2018	1,870,000.00	1,944,607.40	1,971,876.16	27,268.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	21/12/2017	19/01/2018	300,000.00	286,183.17	312,334.36	26,151.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/10/2017	01/02/2018	800,000.00	803,198.80	828,664.65	25,465.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	01/03/2018	4,530,000.00	4,729,776.03	4,753,498.15	23,722.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	940,000.00	973,002.17	991,014.37	18,012.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	23/01/2018	1,860,000.00	1,948,516.70	1,964,237.01	15,720.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	470,000.00	486,397.13	495,507.19	9,110.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	480,000.00	499,529.15	507,002.04	7,472.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	490,000.00	510,716.49	517,864.59	6,848.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2017	22/01/2018	350,000.00	364,142.93	369,688.99	5,546.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/02/2017	21/02/2018	350,000.00	364,690.40	367,679.73	2,989.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	12/12/2017	23/01/2018	920,000.00	970,755.55	971,558.09	802.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/10/2017	09/02/2018	2,900,000.00	3,001,747.45	3,002,072.99	325.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31/10/2017	02/05/2018	1,338,274.70	1,338,274.70	1,338,580.49	305.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	30/10/2017	25/04/2018	500,000.00	519,251.25	514,784.40	(4,466.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	25/01/2018	5,800,000.00	6,023,172.39	6,018,029.97	(5,142.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2017	24/01/2018	4,580,000.00	4,842,715.32	4,835,694.71	(7,020.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/10/2017	15/02/2018	1,600,000.00	1,653,314.69	1,646,115.47	(7,199.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	22/09/2017	19/01/2018	11,500,000.00	11,952,740.11	11,938,594.18	(14,145.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/09/2017	14/09/2018	400,000.00	427,402.96	408,065.32	(19,337.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	17/10/2017	14/02/2018	8,900,000.00	9,535,110.35	9,513,095.76	(22,014.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/12/2017	10/01/2018	100,000.00	153,042.51	107,241.04	(45,801.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	05/10/2017	05/01/2018	2,800,000.00	2,972,110.84	2,924,553.68	(47,557.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	2,700,000.00	2,944,249.43	2,894,070.72	(50,178.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	24/01/2018	3,900,000.00	4,092,789.31	4,042,568.45	(50,220.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	26/01/2018	400,000.00	481,398.56	428,282.76	(53,115.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	22/09/2017	21/03/2018	1,200,000.00	1,303,619.82	1,239,435.41	(64,184.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/10/2017	25/04/2018	2,800,000.00	2,953,364.83	2,884,579.42	(68,785.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	30/01/2018	300,000.00	386,265.74	310,805.85	(75,459.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/10/2017	11/01/2018	14,000,000.00	15,087,716.31	15,012,254.85	(75,461.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	15/01/2018	22,800,000.00	24,551,385.88	24,438,819.45	(112,566.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	21/03/2018	2,600,000.00	2,813,047.30	2,684,326.03	(128,721.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	04/01/2018	800,000.00	965,186.29	830,808.65	(134,377.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	01/11/2017	01/03/2018	4,500,000.00	4,941,145.83	4,806,370.79	(134,775.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	20/03/2018	1,500,000.00	1,694,626.76	1,549,303.06	(145,323.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	21/03/2018	2,900,000.00	3,139,649.25	2,994,055.95	(145,593.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/10/2017	23/01/2018	5,100,000.00	5,433,290.71	5,286,738.40	(146,552.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	12/07/2017	09/01/2018	4,800,000.00	5,102,491.20	4,950,975.32	(151,515.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,440,467.39	1,284,503.22	(155,964.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/11/2017	23/01/2018	1,700,000.00	1,924,435.70	1,762,491.52	(161,944.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	13/03/2018	2,200,000.00	2,451,394.44	2,272,771.40	(178,623.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	23/01/2018	2,300,000.00	2,503,451.14	2,323,853.59	(179,597.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	28/03/2018	2,600,000.00	2,868,912.13	2,682,858.81	(186,053.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	14/12/2018	4,200,000.00	4,427,362.06	4,239,758.74	(187,603.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	29/09/2017	21/09/2018	1,700,000.00	1,923,602.67	1,734,891.74	(188,710.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/11/2017	09/05/2018	2,600,000.00	2,873,401.40	2,675,783.54	(197,617.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/10/2017	15/01/2018	18,100,000.00	19,625,862.39	19,400,992.63	(224,869.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	25/10/2017	23/01/2018	9,600,000.00	10,134,448.13	9,891,677.50	(242,770.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	23/11/2017	21/02/2018	1,900,000.00	2,215,644.74	1,964,492.26	(251,152.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	11/12/2017	13/03/2018	4,300,000.00	4,703,953.48	4,442,235.00	(260,818.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	10/01/2018	3,500,000.00	3,909,861.79	3,632,945.79	(276,916.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	31/10/2017	10/01/2018	9,000,000.00	9,633,520.60	9,342,024.32	(291,496.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0326	23/11/2017	22/01/2018	2,700,000.00	3,029,479.98	2,728,205.39	(301,274.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	18/10/2017	17/04/2018	4,200,000.00	4,667,324.54	4,352,924.87	(314,399.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	02/02/2018	4,200,000.00	4,833,260.80	4,494,474.23	(338,786.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	19/01/2018	4,200,000.00	4,838,921.07	4,500,099.13	(338,821.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/11/2017	13/02/2018	5,300,000.00	6,036,942.31	5,665,643.35	(371,298.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	11/01/2018	6,700,000.00	7,579,300.67	7,184,436.25	(394,864.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	44,500,000.00	46,291,556.01	45,882,545.04	(409,010.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	12/12/2017	13/03/2018	2,600,000.00	3,199,167.87	2,711,738.15	(427,429.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	31/01/2018	6,800,000.00	7,734,259.35	7,178,156.97	(456,102.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2017	10/01/2018	5,100,000.00	5,776,319.13	5,293,721.00	(482,598.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	18/01/2018	6,100,000.00	6,810,378.41	6,326,308.84	(484,069.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/12/2017	04/04/2018	7,800,000.00	8,552,399.14	8,050,195.29	(502,203.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/11/2017	11/01/2018	19,200,000.00	20,433,421.73	19,927,966.72	(505,425.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	07/02/2018	5,900,000.00	6,635,661.20	6,310,652.89	(525,008.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	28/02/2018	4,300,000.00	5,137,756.62	4,593,143.09	(544,613.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	05/12/2017	09/01/2018	7,600,000.00	8,445,037.12	7,889,348.97	(555,688.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	16/02/2018	6,100,000.00	7,080,212.04	6,518,965.54	(561,246.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	14/03/2018	8,600,000.00	9,461,099.40	8,888,963.85	(572,135.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/10/2017	26/04/2018	8,100,000.00	9,180,444.70	8,606,079.73	(574,364.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	13/12/2017	13/03/2018	6,800,000.00	7,660,180.17	7,077,504.42	(582,675.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	22/02/2018	23,500,000.00	24,965,218.04	24,295,448.92	(669,769.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	8,400,000.00	9,654,949.01	8,973,504.07	(681,444.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	22/01/2018	5,900,000.00	7,002,280.77	6,319,683.35	(682,597.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	25/10/2017	25/04/2018	61,400,000.00	63,967,401.23	63,265,278.04	(702,123.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	02/02/2018	6,800,000.00	7,999,175.76	7,276,767.80	(722,407.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/12/2017	17/01/2018	7,800,000.00	8,873,287.91	8,142,896.97	(730,390.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	05/10/2017	03/04/2018	12,900,000.00	14,217,905.03	13,384,136.39	(833,768.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	26/02/2018	8,500,000.00	9,914,801.04	9,075,122.08	(839,678.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/10/2017	19/01/2018	53,300,000.00	56,119,420.85	55,278,713.69	(840,707.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	08/12/2017	04/01/2018	9,600,000.00	10,873,580.35	10,027,921.02	(845,659.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	12/12/2017	12/06/2018	15,800,000.00	17,096,590.49	16,239,228.48	(857,362.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	22/01/2018	8,600,000.00	9,566,611.84	8,689,839.39	(876,772.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	20/03/2018	12,500,000.00	13,792,768.13	12,914,563.34	(878,204.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	14/09/2017	13/03/2018	14,900,000.00	16,383,935.70	15,484,211.98	(899,723.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	28/12/2017	07/02/2018	6,700,000.00	7,890,420.68	6,975,768.67	(914,632.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/06/2018	16,000,000.00	17,390,536.12	16,437,160.28	(953,375.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	10,400,000.00	12,106,039.37	11,145,317.15	(960,722.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/12/2017	16/02/2018	12,400,000.00	14,245,792.79	13,251,667.66	(994,125.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	8,400,000.00	10,034,769.64	8,991,522.52	(1,043,247.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

100

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0223	11/07/2017	09/01/2018	77,000,000.00	95,053,257.78	87,983,818.56	(7,069,439.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18/04/2017	18/04/2018	98,600,000.00	111,627,623.60	101,684,911.15	(9,942,712.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	12/09/2017	09/03/2018	223,800,000.00	245,916,811.20	232,646,511.69	(13,270,299.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/11/2017	04/01/2018	98,400,000.00	119,136,664.74	105,588,040.56	(13,548,624.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	07/12/2017	07/03/2018	83,300,000.00	100,168,430.03	86,606,055.79	(13,562,374.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	12/02/2018	129,900,000.00	150,229,665.41	134,461,944.06	(15,767,721.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/05/2018	103,900,000.00	128,375,533.24	110,115,215.99	(18,260,317.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	293,400,000.00	339,364,146.63	314,582,731.74	(24,781,414.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	293,400,000.00	339,364,146.63	314,582,731.74	(24,781,414.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/11/2017	21/03/2018	207,700,000.00	259,566,220.90	221,387,155.84	(38,179,065.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	14/06/2018	334,300,000.00	403,529,794.03	353,630,691.84	(49,899,102.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/10/2017	12/01/2018	100,000,000.00	102,949,039.00	103,791,522.41	841,883.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	12/01/2018	30,000,000.00	31,942,407.90	31,137,456.72	(804,951.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/10/2017	05/01/2018	136,600,000.00	147,554,363.80	146,563,976.21	(990,387.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	17/10/2017	12/01/2018	60,000,000.00	63,877,220.40	62,274,913.45	(1,602,306.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/12/2017	02/01/2018	24,900,000.00	27,766,537.80	26,027,890.84	(1,738,646.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	41,500,000.00	49,777,963.50	43,903,654.12	(5,874,309.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	16/11/2017	15/05/2018	69,400,000.00	82,079,736.21	73,610,785.04	(8,468,951.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	05/01/2018	101,000,000.00	117,294,730.85	108,367,215.20	(8,927,515.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	30/11/2017	30/05/2018	82,700,000.00	96,844,811.63	85,426,860.81	(11,417,950.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	04/12/2017	18/01/2018	96,700,000.00	112,571,176.63	100,864,158.32	(11,707,018.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	04/12/2017	18/01/2018	108,400,000.00	128,791,340.80	116,156,956.84	(12,634,383.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/09/2017	10/01/2018	38,905,637.69	38,905,637.69	39,754,806.73	849,169.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/08/2017	03/01/2018	1,100,000.00	1,097,710.32	1,146,832.19	49,121.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	27/09/2017	02/02/2018	10,570,000.00	10,570,933.20	10,577,495.83	6,562.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	03/10/2017	30/01/2018	23,500,000.00	24,407,570.00	24,375,853.48	(31,716.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	13/09/2017	03/01/2018	14,100,000.00	14,718,890.38	14,658,331.21	(60,559.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29/09/2017	16/02/2018	9,800,000.00	10,465,703.64	10,140,752.03	(324,951.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	06/12/2017	15/01/2018	5,700,000.00	6,609,371.37	6,111,399.44	(497,971.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/10/2017	08/02/2018	73,200,000.00	78,838,018.83	78,287,402.84	(550,615.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20/11/2017	19/01/2018	8,900,000.00	9,832,352.91	9,173,130.51	(659,222.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	05/01/2017	04/01/2018	18,600,000.00	20,091,217.80	19,334,825.54	(756,392.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	02/02/2018	8,700,000.00	9,861,317.85	9,071,324.12	(789,993.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	30/08/2017	19/01/2018	20,100,000.00	22,013,640.60	20,963,486.62	(1,050,153.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	16/01/2018	12,500,000.00	14,555,150.87	13,397,144.73	(1,158,006.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	18/10/2017	18/04/2018	17,100,000.00	19,060,601.81	17,721,255.56	(1,339,346.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/10/2017	23/01/2018	71,500,000.00	78,059,234.18	76,578,380.66	(1,480,853.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	24/10/2017	23/01/2018	58,400,000.00	62,487,581.86	60,884,748.50	(1,602,833.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	09/01/2018	16,700,000.00	19,525,444.39	17,911,031.45	(1,614,412.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/11/2017	31/01/2018	31,600,000.00	34,596,446.79	32,735,235.07	(1,861,211.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/11/2017	31/01/2018	31,600,000.00	34,596,446.79	32,735,235.07	(1,861,211.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017
5.- Contratos de compra forward (continuación)
a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0423	27/11/2017	25/01/2018	24,900,000.00	27,524,345.27	25,652,731.95	(1,871,613.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	19/01/2018	20,800,000.00	24,219,799.82	22,286,205.23	(1,933,594.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	16,300,000.00	19,440,069.69	17,447,835.36	(1,992,234.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	19/01/2018	25,200,000.00	29,027,362.07	27,000,594.80	(2,026,767.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	02/02/2018	25,200,000.00	29,019,455.22	26,966,845.36	(2,052,609.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/11/2017	30/01/2018	20,600,000.00	24,410,164.93	22,500,638.56	(2,359,526.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	06/02/2018	24,900,000.00	29,080,242.75	26,635,637.81	(2,444,604.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	33,800,000.00	38,588,374.04	36,107,671.14	(2,480,702.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	23/01/2018	20,300,000.00	24,368,117.23	21,741,833.95	(2,626,283.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	06/12/2017	15/01/2018	35,600,000.00	39,422,589.76	36,703,406.67	(2,719,183.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/12/2017	20/02/2018	38,000,000.00	43,413,317.98	40,594,423.18	(2,818,894.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	14/12/2017	13/02/2018	33,900,000.00	38,102,521.99	35,275,258.99	(2,827,263.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	17/11/2017	16/01/2018	35,400,000.00	39,434,986.74	36,494,501.89	(2,940,484.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	29/11/2017	27/03/2018	17,400,000.00	21,097,152.00	18,062,758.82	(3,034,393.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	06/02/2018	33,200,000.00	38,773,656.99	35,514,183.74	(3,259,473.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	20/11/2017	19/01/2018	44,600,000.00	49,232,802.62	45,968,721.42	(3,264,081.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	19/01/2018	42,000,000.00	48,430,284.00	45,000,991.33	(3,429,292.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2017	25/01/2018	34,400,000.00	39,133,488.77	35,651,561.46	(3,481,927.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2017	25/01/2018	34,400,000.00	39,133,488.77	35,651,561.46	(3,481,927.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/12/2017	07/02/2018	42,000,000.00	48,710,550.00	44,923,291.74	(3,787,258.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	01/12/2017	30/01/2018	33,100,000.00	38,294,941.97	34,488,710.20	(3,806,231.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	22/01/2018	57,700,000.00	64,063,645.63	60,210,868.94	(3,852,776.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	24/11/2017	23/01/2018	36,900,000.00	43,184,184.30	38,469,986.64	(4,714,197.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	22/11/2017	23/01/2018	41,000,000.00	48,698,930.68	43,912,078.42	(4,786,852.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2017	01/03/2018	55,500,000.00	62,601,428.94	57,407,151.27	(5,194,277.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	24/11/2017	24/01/2018	28,700,000.00	35,219,209.52	29,918,141.25	(5,301,068.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	10/11/2017	15/01/2018	93,900,000.00	107,217,838.94	100,649,348.52	(6,568,490.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	29/12/2017	26/02/2018	89,100,000.00	96,669,222.96	89,817,264.69	(6,851,958.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/11/2017	13/02/2018	84,000,000.00	97,236,673.53	89,795,102.20	(7,441,571.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/11/2017	13/02/2018	59,200,000.00	71,137,980.32	63,284,167.26	(7,853,823.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	18/12/2017	09/01/2018	102,700,000.00	111,818,862.09	103,873,402.50	(7,945,459.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	26/01/2018	82,700,000.00	96,886,619.48	88,547,460.58	(8,339,158.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	18/01/2018	99,900,000.00	116,279,565.09	107,048,708.38	(9,230,856.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	01/03/2018	81,900,000.00	97,061,572.51	87,519,845.84	(9,541,726.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	28/12/2017	22/01/2018	126,700,000.00	142,723,765.47	132,103,777.91	(10,619,987.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/12/2017	12/01/2018	200,000,000.00	221,406,126.04	207,583,044.82	(13,823,081.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	23/11/2017	21/02/2018	77,700,000.00	95,919,550.40	80,790,564.86	(15,128,985.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	15/01/2018	300,000,000.00	345,119,122.20	321,563,413.80	(23,555,708.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			10,879,500,000.00	12,205,431,283.46	11,434,045,657.94	(771,385,725.52)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

5.- Contratos de compra forward
a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Supervit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0723	02/11/2017	05/01/2018	3,000.00	2,783.81	3,318.33	534.52	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	28/12/2017	26/02/2018	29,000.00	31,560.01	31,764.49	204.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	02/10/2017	29/03/2018	38,000.00	42,193.71	41,573.42	(620.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	13/10/2017	11/04/2018	184,000.00	202,826.10	201,142.75	(1,683.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0723	13/12/2017	13/03/2018	17,000.00	20,411.57	18,710.06	(1,701.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	21/12/2017	19/06/2018	35,000.00	39,981.92	38,119.40	(1,862.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	02/11/2017	31/01/2018	202,000.00	216,552.08	221,632.05	5,079.97	USD	Alpha Sociedad de Valores
DF0927	15/12/2017	13/02/2018	1,823,377.00	2,036,803.65	1,983,648.07	(53,155.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DF3227	01/09/2017	25/01/2018	389,389.00	394,338.84	425,285.18	30,946.34	USD	Alpha Sociedad de Valores
DF3227	01/09/2017	25/01/2018	307,131.00	311,034.75	335,444.15	24,409.41	USD	Alpha Sociedad de Valores
DF3127	01/08/2017	25/01/2018	193,834.00	196,298.18	211,702.77	15,404.59	USD	Alpha Sociedad de Valores
DF0927	10/10/2017	09/01/2018	924,668.00	995,799.93	1,008,011.69	12,211.76	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0723	30/11/2017	23/05/2018	377,000.00	405,947.82	395,004.72	(10,943.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0723	24/11/2017	23/05/2018	1,337,000.00	1,439,635.37	1,400,227.55	(39,407.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0027	02/11/2017	24/01/2018	144,000.00	154,197.95	158,026.34	3,828.39	USD	Alpha Sociedad de Valores
			6,004,398.00	6,490,365.69	6,473,610.97	(16,754.72)		

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

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

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

d) Divisas Implícitas		Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
Contratos de compra	MH0227	02/10/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,047,139.43	2,067,320.22	20,180.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	CE1018	23/10/2017	16/01/2018	450,000.00	483,982.90	488,833.39	4,850.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	CE1018	20/11/2017	09/01/2018	930,000.00	1,013,654.47	1,015,640.90	1,986.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	B00126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	549,474.80	555,616.44	6,141.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	CE1018	06/12/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,072,789.41	1,093,517.43	20,728.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	MH0227	18/12/2017	17/01/2018	30,700,000.00	34,200,633.95	34,483,305.94	282,671.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
	MH0332	27/12/2017	11/01/2018	199,200,000.00	235,092,806.04	233,872,974.30	(1,219,831.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total				234,750,000.00	274,460,481.00	273,577,206.62	(883,272.38)		

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

6. Contratos de venta forward:

a) Títulos Valores de Deuda en DOP

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

6.- Contratos de venta forward

a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0129	13/09/2017	06/03/2018	19,500,000.00	21,553,236.51	20,275,495.61	1,277,750.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	18/12/2017	17/01/2018	30,700,000.00	32,639,349.70	31,890,520.66	748,829.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,172,384.00	1,072,543.25	99,840.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	12/01/2018	1,000,000.00	1,164,739.00	1,072,543.25	92,195.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	02/10/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,017,272.99	1,961,273.03	55,999.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	14/08/2017	15/02/2018	720,000.00	843,621.93	790,017.29	53,604.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	07/12/2017	15/03/2018	300,000.00	338,783.10	312,015.31	26,767.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/12/2017	10/04/2018	100,000.00	129,302.65	103,153.33	26,149.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	529,363.50	513,964.26	15,399.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	18/01/2018	7,520,000.00	7,958,532.64	7,954,253.23	4,279.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	31/01/2018	340,000.00	358,228.07	358,609.00	(380.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/09/2017	13/02/2018	400,000.00	413,464.68	420,848.28	(7,383.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	930,000.00	975,741.04	985,217.30	(9,476.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	04/05/2018	720,000.00	734,430.19	745,733.88	(11,303.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2017	16/01/2018	450,000.00	464,300.03	475,951.06	(11,651.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	05/01/2018	710,000.00	740,944.08	752,668.55	(11,724.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	03/11/2017	25/04/2018	1,400,000.00	1,431,051.37	1,443,495.80	(12,444.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	660,000.00	682,159.02	697,993.34	(15,834.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/11/2017	16/01/2018	5,000,000.00	5,162,065.20	5,189,055.33	(26,990.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	14/11/2017	09/01/2018	900,000.00	893,961.00	935,384.35	(41,423.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,064,610.51	1,111,299.22	(46,688.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	16/01/2018	9,800,000.00	10,082,651.60	10,170,548.44	(87,896.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	17/01/2018	10,720,000.00	11,203,783.84	11,340,979.78	(137,195.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	23/01/2018	1,700,000.00	1,924,435.70	1,763,468.33	160,967.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	23/01/2018	920,000.00	970,755.52	972,295.15	(1,539.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	23/01/2018	1,860,000.00	1,948,516.65	1,955,727.14	(7,210.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/12/2017	11/01/2018	199,200,000.00	226,710,033.44	213,666,903.29	13,043,130.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/12/2017	15/01/2018	35,600,000.00	39,422,585.60	36,717,611.00	2,704,974.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0423	19/12/2017	25/01/2018	24,900,000.00	27,524,335.50	25,668,511.13	1,855,824.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	19/12/2017	15/01/2018	5,700,000.00	6,609,371.39	6,113,745.00	495,626.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
			366,220,000.00	407,664,010.45	387,441,814.58	20,222,195.87		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017
6.- Contratos de venta forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BOO427	28/12/17	04/1/18	4,111,000.00	4,929,992.10	4,989,371.40	(59,379.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			4,111,000.00	4,929,992.10	4,989,371.40	(59,379.29)		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2017 fue de DOP 46,7111 por USD 1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR								
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
NADA QUE REPORTAR	0	0						
Total	0	0						

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Suprávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	05/01/2017	05/01/2018	464,023.80	1,751,404.99	1,766,748.86	(15,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/02/2017	09/02/2018	1,670,000.00	1,751,404.99	1,766,748.86	(15,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/03/2017	02/03/2018	410,000.00	1,751,404.99	1,766,748.86	(15,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/03/2017	15/03/2018	1,650,000.00	1,751,404.99	1,766,748.86	(15,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/03/2017	12/03/2018	3,770,000.00	1,751,404.99	1,766,748.86	(15,343.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/04/2017	05/04/2018	4,800,000.00	5,273,557.24	5,318,715.02	(45,157.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	26/06/2017	26/06/2018	7,000,000.00	7,017,512.06	7,146,803.52	(129,291.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/06/2017	28/06/2018	2,200,000.00	2,243,613.28	2,319,415.33	(75,802.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	04/07/2017	04/07/2018	900,000.00	1,068,442.79	1,095,360.63	(26,917.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00129	07/07/2017	05/01/2018	200,000.00	244,531.43	245,488.35	(956.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	03/01/2018	11,150,000.00	11,825,162.20	11,880,560.08	(55,397.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2017	02/07/2018	210,000.00	218,586.23	223,848.23	(5,262.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	300,000.00	274,949.90	277,038.33	(2,088.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	900,000.00	931,511.39	937,415.09	(5,903.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	5,500,000.00	5,773,942.12	5,820,224.29	(46,282.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	1,300,000.00	1,401,767.45	1,411,238.81	(9,471.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	09/01/2018	14,000,000.00	14,732,559.21	14,863,041.98	(130,482.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	300,000.00	327,646.91	336,199.61	(8,552.70)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	11/07/2017	06/07/2018	5,000,000.00	5,165,411.78	5,300,246.69	(134,834.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	13/07/2017	09/01/2018	43,700,000.00	45,332,728.65	45,715,158.00	(382,429.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2017	09/01/2018	210,000.00	227,850.72	229,533.58	(1,682.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	14/07/2017	10/01/2018	11,400,000.00	11,965,638.64	12,068,213.09	(102,574.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	18/07/2017	12/04/2018	1,200,000.00	1,170,886.90	1,193,464.42	(22,577.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/07/2017	16/01/2018	450,000.00	483,982.91	488,833.40	(4,850.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	19/07/2017	17/01/2018	30,700,000.00	34,200,664.62	34,483,336.86	(282,672.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	16/01/2018	1,800,000.00	1,863,483.25	1,879,424.42	(15,941.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	300,000.00	306,292.44	308,823.98	(2,531.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	19/07/2017	17/01/2018	2,700,000.00	2,840,064.65	2,868,915.07	(28,850.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	20/07/2017	19/07/2018	1,400,000.00	1,386,821.76	1,425,481.31	(38,659.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/07/2017	17/01/2018	1,290,000.00	1,366,562.76	1,381,597.82	(15,035.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/07/2017	19/01/2018	2,110,000.00	2,242,264.63	2,258,105.53	(15,840.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	19/01/2018	630,000.00	682,617.94	691,903.67	(9,285.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	22/01/2018	760,000.00	821,539.74	833,052.13	(11,512.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2017	20/04/2018	2,370,000.00	2,372,217.40	2,419,218.69	(47,001.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	880,000.00	954,159.93	966,519.33	(12,359.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	22/01/2018	860,000.00	910,992.27	919,907.58	(8,915.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/07/2017	23/04/2018	1,070,000.00	1,072,809.37	1,093,537.77	(20,728.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/07/2017	27/07/2018	700,000.00	677,949.83	705,178.86	(27,229.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	190,000.00	204,957.59	207,792.82	(2,834.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2017

d) Divisas implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pácto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	02/08/2017	30/01/2018	440,000.00	475,136.86	479,801.92	(4,665.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2017	31/01/2018	1,920,000.00	2,057,054.79	2,078,802.77	(21,747.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	04/08/2017	30/07/2018	3,000,000.00	2,936,323.38	3,014,459.40	(78,136.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00129	04/08/2017	05/01/2018	200,000.00	243,290.94	244,802.27	(1,511.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2017	31/01/2018	210,000.00	231,256.24	235,418.48	(4,162.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/08/2017	01/02/2018	4,380,000.00	4,684,093.08	4,728,276.67	(44,183.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2017	06/02/2018	270,000.00	292,543.56	295,420.58	(2,877.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	11/08/2017	06/08/2018	100,000.00	109,588.40	113,830.72	(4,242.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	11/08/2017	09/08/2018	2,400,000.00	2,372,229.90	2,434,547.20	(62,317.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	14/08/2017	09/08/2018	300,000.00	328,584.28	337,216.03	(8,631.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	15/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	992,840.90	1,004,081.63	(11,240.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	15/08/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,341,525.60	2,363,605.94	(22,080.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	17/08/2017	30/01/2018	200,000.00	250,529.67	252,936.77	(2,407.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	17/08/2017	13/02/2018	1,000,000.00	980,563.99	991,872.28	(11,308.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	17/08/2017	11/07/2018	2,300,000.00	2,374,434.29	2,439,045.41	(64,611.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	17/08/2017	17/08/2018	300,000.00	268,709.16	275,320.44	(6,611.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	21/08/2017	15/02/2018	1,200,000.00	1,213,030.36	1,226,549.78	(13,519.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	22/08/2017	20/02/2018	1,000,000.00	990,290.24	1,001,931.95	(11,641.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	25/08/2017	21/02/2018	41,100,000.00	41,790,017.53	42,198,556.13	(408,538.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	28/08/2017	22/02/2018	900,000.00	929,177.89	936,817.88	(7,639.99)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	30/08/2017	23/02/2018	2,300,000.00	2,471,039.43	2,492,174.36	(21,134.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	05/09/2017	02/03/2018	200,000.00	220,429.15	222,492.96	(2,063.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	06/09/2017	31/08/2018	200,000.00	261,399.97	268,654.63	(7,254.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	08/09/2017	07/03/2018	200,000.00	244,950.65	247,652.70	(2,702.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	12/09/2017	10/01/2018	4,600,000.00	4,861,506.17	4,884,847.58	(23,341.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	12/09/2017	05/01/2018	14,400,000.00	15,657,850.32	15,751,838.19	(93,987.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	14/09/2017	12/01/2018	1,200,000.00	1,267,601.03	1,275,621.37	(8,020.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	15/09/2017	11/01/2018	700,000.00	761,907.12	766,624.23	(4,717.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	19/09/2017	20/03/2018	1,600,000.00	1,629,204.87	1,644,679.84	(15,474.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	20/09/2017	19/03/2018	400,000.00	417,291.17	421,116.15	(3,824.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	20/09/2017	21/03/2018	500,000.00	477,061.29	481,358.71	(4,297.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	27/09/2017	26/03/2018	4,600,000.00	4,904,538.29	4,960,913.56	(56,375.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	29/09/2017	21/09/2018	1,700,000.00	1,964,396.85	2,023,198.72	(58,801.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2017	25/01/2018	130,000.00	139,170.54	139,918.60	(748.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/09/2017	28/03/2018	1,900,000.00	2,047,132.22	2,067,312.94	(20,180.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	02/10/2017	30/01/2018	45,600,000.00	46,109,917.59	46,562,640.98	(452,723.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/10/2017	05/03/2018	200,000.00	219,871.85	221,644.52	(1,772.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	03/10/2017	03/04/2018	900,000.00	951,041.79	961,341.55	(10,299.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.*Estados Financieros***ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (CONTINUACIÓN)****Por los años terminados el 31 de diciembre de 2017 y 2016***(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)*

	<u>2017</u>	<u>2016</u>
Flujos de efectivo de actividades de financiamiento:		
Producto de nuevas obligaciones con bancos	4,933,277,593	15,744,688,848
Producto de nuevas obligaciones por instrumentos financieros emitidos	200,000,000	675,000,000
Pago de obligaciones con bancos	(4,815,120,762)	(15,841,852,126)
Pago de obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	(1,000,000,000)
Dividendos pagados	(250,000,000)	-
Intereses pagados	(128,549,359)	(158,848,511)
Flujos de efectivo neto usado en actividades de financiamiento	<u>(60,392,528)</u>	<u>(581,011,789)</u>
 Aumento neto en el efectivo	769,487,226	650,501,008
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	1,281,365,491	630,864,483
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	<u>2,050,852,717</u>	<u>1,281,365,491</u>
 Transacciones no monetarias:		
Capital	250,000,000	210,717,400
Reserva legal	50,000,000	42,143,480
Resultados acumulados	<u>(300,000,000)</u>	<u>(252,860,880)</u>

Las notas adjuntas son parte integral de los estados financieros.

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manual Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pecto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de rescotación
CE1018	30/10/2017	30/01/2018	350.000.00	389,339.46	390,882.46	(1,543.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	30/10/2017	26/04/2018	12,900.000.00	14,985,116.53	15,122,581.71	(137,465.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	31/10/2017	31/01/2018	4,300.000.00	4,630,432.16	4,658,028.69	(27,596.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	31/10/2017	01/05/2018	1,100.000.00	1,219,898.22	1,228,769.35	(8,871.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2017	31/01/2018	450.000.00	486,653.40	488,540.20	(1,886.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	01/11/2017	11/01/2018	19,200.000.00	21,468,840.90	21,547,978.23	(79,137.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/11/2017	31/01/2018	4,610.000.00	5,008,839.97	5,032,427.30	(23,587.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	02/11/2017	08/01/2018	4,500.000.00	4,989,326.54	5,010,885.03	(21,558.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2017	31/01/2018	6,800.000.00	7,371,047.54	7,405,758.84	(34,711.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	02/11/2017	11/01/2018	6,700.000.00	7,861,251.35	7,873,893.21	(12,641.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	03/11/2017	01/11/2018	100.000.00	152,223.25	156,389.28	(4,166.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2017	02/01/2018	450.000.00	484,371.38	485,968.42	(1,597.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	03/11/2017	21/03/2018	200.000.00	219,894.61	221,127.97	(1,233.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	07/11/2017	04/01/2018	1,100.000.00	1,286,695.98	1,288,612.46	(1,916.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	07/11/2017	06/02/2018	8,800.000.00	9,656,320.78	9,686,774.67	(30,453.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2017	06/02/2018	11,010.000.00	11,984,493.11	12,029,750.62	(45,257.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	09/01/2018	930.000.00	1,013,654.21	1,015,640.64	(1,986.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	90.000.00	98,800.13	99,296.48	(496.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	08/02/2018	3,030.494.54	3,030,494.54	3,068,530.23	(38,035.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2017	06/02/2018	2,720.000.00	2,43,336.15	244,415.36	(1,079.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	08/11/2017	06/02/2018	2,100.000.00	2,450,373.17	2,460,644.67	(10,271.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	09/11/2017	18/04/2018	700.000.00	798,633.34	807,535.29	(8,901.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	09/11/2017	08/05/2018	3,400.000.00	3,806,763.35	3,845,479.92	(38,716.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	09/11/2017	09/05/2018	1,400.000.00	1,537,440.07	1,548,791.16	(11,351.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	09/11/2017	18/01/2018	16,900.000.00	20,057,254.77	20,108,508.37	(51,253.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	09/01/2018	2,545.121.38	2,545,121.38	2,553,355.02	(7,633.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2017	08/02/2018	3,350.000.00	3,649,032.35	3,665,216.06	(16,183.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	520.000.00	576,471.76	579,328.99	(2,857.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2017	14/02/2018	440.000.00	489,811.68	492,239.39	(2,427.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	15/11/2017	14/05/2018	12,900.000.00	15,318,901.75	15,428,303.82	(109,402.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	15/11/2017	15/05/2018	8,600.000.00	10,278,225.54	10,522,535.39	(244,309.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	16/01/2018	4,560.000.00	4,968,562.21	4,975,793.68	(7,231.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	15/02/2018	330.000.00	364,404.37	365,347.64	(943.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2017	14/05/2018	135.384.77	135,384.77	136,219.42	(827.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC00126	16/11/2017	12/01/2018	3,400.000.00	4,099,862.59	4,100,219.42	(356.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2017	13/02/2018	5,840.000.00	6,448,174.46	6,463,303.02	(15,128.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2017	22/02/2018	3,360.000.00	3,680,121.06	3,692,004.35	(11,883.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

d) Divisas Implícitas (continuación)	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Contratos de venta								
CE1018	17/11/2017	19/04/2018	90,000.00	93,369.80	94,071.68	(701.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	20/03/2018	700,000.00	800,664.61	804,440.62	(3,776.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/11/2017	17/05/2018	500,000.00	547,111.47	550,758.69	(3,647.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2017	09/01/2018	480,000.00	529,960.61	530,449.70	(489.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	21/11/2017	22/05/2018	200,000.00	186,727.81	188,004.57	(1,276.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	21/11/2017	22/02/2018	40,000.00	48,778.31	48,956.02	(177.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	20/02/2018	750,000.00	828,990.84	832,153.93	(3,163.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2017	12/04/2018	220,000.00	224,288.68	225,418.09	(1,129.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	20/02/2018	9,200,000.00	11,061,403.92	11,096,734.48	(35,330.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/11/2017	21/05/2018	400,000.00	471,069.51	476,972.76	(5,903.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2017	22/05/2018	310,000.00	323,338.86	326,017.44	(2,678.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	22/11/2017	22/01/2018	8,600,000.00	9,903,955.67	9,918,193.43	(14,237.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/11/2017	22/01/2018	200,000.00	243,731.76	244,385.23	(653.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	23/11/2017	08/01/2018	400,000.00	498,665.51	498,954.95	(289.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	24/01/2018	20,900,000.00	23,674,883.24	23,734,731.20	(60,047.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2017	23/05/2018	1,200,000.00	1,416,343.06	1,430,002.86	(13,659.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2017	01/03/2018	3,800,000.00	4,211,939.45	4,228,926.91	(16,987.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	27/11/2017	24/05/2018	103,900,000.00	131,108,245.57	133,016,774.34	(1,908,528.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/11/2017	29/05/2018	4,100,000.00	4,717,504.47	4,765,332.85	(47,828.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	440,000.00	487,520.58	488,585.56	(1,064.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	26/01/2018	1,350,000.00	1,484,485.42	1,490,192.91	(5,707.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	01/03/2018	4,460,000.00	4,933,859.43	4,953,758.52	(19,899.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2017	02/03/2018	740,000.00	815,631.80	818,684.23	(3,052.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	9,900,000.00	12,322,376.17	12,350,750.26	(28,374.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/11/2017	30/01/2018	8,400,000.00	10,440,731.29	10,464,772.62	(24,041.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/11/2017	28/05/2018	3,000,000.00	3,540,995.27	3,577,952.08	(36,956.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	15/01/2018	18,080,000.00	19,881,297.09	19,940,545.93	(59,248.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	30/01/2018	140,000.00	149,228.98	149,541.69	(312.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2017	01/03/2018	510,000.00	563,054.25	565,908.92	(2,854.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	12/01/2018	600,000.00	745,655.77	746,646.65	(990.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	29/11/2017	30/01/2018	1,200,000.00	1,498,461.91	1,502,844.43	(4,382.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	29/05/2018	500,000.00	549,484.58	555,626.33	(6,141.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	30/11/2017	30/05/2018	2,100,000.00	2,447,155.49	2,472,759.96	(25,604.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	30/11/2017	30/05/2018	82,700,000.00	100,556,115.74	101,796,509.11	(1,240,393.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	15/01/2018	8,890,000.00	9,771,638.05	9,794,670.11	(23,032.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	01/03/2018	4,530,000.00	5,012,559.73	5,041,096.59	(28,536.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2017	02/03/2018	220,000.00	243,636.52	244,799.54	(963.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

d) Divisas Implícitas (continuación)	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Contratos de venta								
BO0126	01/12/2017	01/03/2018	39,600,000.00	44,141,055.33	44,429,079.30	(288,023.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2017	26/11/2018	4,400,000.00	5,031,864.69	5,167,131.60	(135,266.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/12/2017	06/03/2018	21,400,000.00	24,073,576.08	24,235,519.72	(161,943.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2017	06/03/2018	2,780,000.00	3,091,867.79	3,112,666.87	(20,799.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	04/12/2017	04/06/2018	200,000.00	221,370.63	222,966.80	(1,596.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	05/01/2018	1,100,000.00	1,236,765.12	1,239,802.53	(3,037.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/04/2018	18,600,000.00	20,993,730.82	21,144,820.75	(151,089.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	05/12/2017	04/04/2018	7,800,000.00	8,738,316.95	8,801,205.81	(62,888.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	06/02/2018	4,300,000.00	4,824,637.31	4,839,853.15	(15,215.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	06/12/2017	29/05/2018	500,000.00	549,264.23	555,632.08	(6,367.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2017	23/04/2018	440,000.00	456,959.80	462,993.49	(6,033.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	10/01/2018	12,400,000.00	15,024,637.22	15,056,116.17	(31,478.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	06/12/2017	04/06/2018	100,000.00	135,507.23	136,611.13	(1,103.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2017	10/01/2018	2,200,000.00	2,617,441.42	2,627,279.67	(9,838.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2017	07/03/2018	890,000.00	990,289.76	994,811.49	(4,521.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	07/12/2017	07/02/2018	12,100,000.00	14,648,911.05	14,693,852.71	(44,941.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2017	06/06/2018	1,700,000.00	1,993,250.23	2,012,839.39	(19,589.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	09/01/2018	7,040,000.00	7,732,951.60	7,752,924.09	(19,972.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2017	10/01/2018	1,200,000.00	1,321,114.63	1,324,156.89	(3,042.26)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	11/12/2017	13/03/2018	4,300,000.00	4,777,361.01	4,807,664.80	(30,303.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	360,000.00	405,543.10	404,275.63	1,267.47	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2017	13/03/2018	3,590,000.00	3,986,976.94	4,014,754.10	(27,777.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	8,600,000.00	9,612,276.80	9,674,434.27	(62,157.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/06/2018	15,800,000.00	17,798,073.10	17,977,987.29	(179,914.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	11/01/2018	17,700,000.00	20,473,758.90	20,523,680.06	(49,921.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	12/01/2018	300,000.00	297,716.37	298,173.70	(457.33)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	20,800,000.00	23,261,391.36	23,397,316.89	(135,925.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	12/12/2017	14/03/2018	1,100,000.00	1,271,923.11	1,279,619.52	(7,696.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/02/2018	190,000.00	206,441.17	208,604.69	(2,163.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2017	13/03/2018	1,320,000.00	1,464,428.91	1,475,241.15	(10,812.24)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/02/2018	2,300,000.00	2,550,647.68	2,559,801.98	(9,154.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	13/03/2018	2,200,000.00	2,489,412.25	2,506,238.10	(16,825.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	13/12/2017	12/06/2018	5,800,000.00	6,489,431.44	6,552,364.67	(62,933.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	12/01/2018	460,000.00	509,750.89	510,957.00	(1,206.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	1,100,000.00	1,220,079.66	1,225,794.03	(5,714.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	420,000.00	468,629.90	471,797.35	(3,167.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2017	13/03/2018	620,000.00	693,280.61	697,390.23	(4,109.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas (continuación)	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Contratos de venta								
MH0332	13/12/2017	12/01/2018	400,000.00	483.210.62	484,856.17	(1,645.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	13/12/2017	13/02/2018	12,200,000.00	14,792.190.49	14,854,489.06	(62,298.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	13/12/2017	13/03/2018	6,800,000.00	7,920.443.19	7,967,393.93	(46,950.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	15/01/2018	4,400,000.00	4,893.877.39	4,907,444.90	(13,567.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	15/01/2018	16,700,000.00	18,435.100.50	18,486,208.94	(51,108.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	14/12/2017	12/06/2018	4,200,000.00	4,720.239.98	4,772,866.48	(52,626.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	05/01/2018	101,000,000.00	121,345,799.34	121,016,398.49	329,400.85	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/06/2018	41,500,000.00	51,142,347.06	51,750,374.81	(608,027.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	15/12/2017	13/02/2018	16,600,000.00	20,135,294.82	20,203,385.51	(68,090.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/12/2017	02/01/2018	24,900,000.00	28,194,272.05	28,263,757.84	(69,485.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	830,000.00	920.164.30	921,684.97	(1,720.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	480,000.00	532,756.29	534,194.73	(1,438.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	16/01/2018	1,320,000.00	1,453,090.33	1,454,603.40	(1,513.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	25/01/2018	420,000.00	469,176.51	471,990.16	(2,813.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	13/02/2018	370,000.00	412,491.29	415,774.36	(3,283.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2017	15/03/2018	2,110,000.00	2,343,971.18	2,355,526.24	(11,555.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	17/01/2018	1,400,000.00	1,546,005.44	1,553,606.81	(7,601.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	19/01/2018	520,000.00	560,635.19	582,076.94	(1,441.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2017	20/03/2018	470,000.00	526,713.85	529,088.91	(2,375.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	18/12/2017	17/01/2018	11,300,000.00	13,565,647.68	13,604,111.00	(38,463.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	20/03/2018	1,500,000.00	1,723,676.41	1,734,663.79	(10,987.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	21/03/2018	2,900,000.00	3,196,675.96	3,220,103.43	(23,427.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00729	19/12/2017	18/01/2018	26,800,000.00	32,648,902.39	32,779,839.26	(130,936.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	947,293.41	952,545.73	(5,252.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	3,100,000.00	3,413,664.46	3,424,514.65	(10,850.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	8,350,000.00	9,198,837.17	9,226,163.91	(27,326.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,740,000.00	5,221,520.07	5,238,116.45	(16,596.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	140,000.00	155,109.94	155,699.72	(589.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	18/01/2018	4,370,000.00	4,831,860.99	4,856,273.43	(24,412.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	13/02/2018	1,120,000.00	1,237,346.90	1,242,558.09	(5,211.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	16/02/2018	3,610,000.00	4,008,773.42	4,027,949.45	(19,176.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	19/03/2018	1,950,000.00	2,167,224.31	2,180,772.39	(13,548.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	134,000.00	135,844.09	135,844.09	(1,607.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	20/03/2018	900,000.00	1,002,208.40	1,008,804.99	(6,596.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2017	21/03/2018	550,000.00	614,263.66	617,744.98	(3,481.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	19/12/2017	18/01/2018	4,100,000.00	4,841,541.12	4,850,900.04	(9,358.92)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	21/03/2018	2,600,000.00	2,864,174.70	2,885,165.37	(20,990.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	20/12/2017	19/06/2018	16,000,000.00	18,134,207.35	18,298,561.15	(164,353.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	14/12/2018	4,200,000.00	4,618,821.65	4,734,576.78	(115,755.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	19/01/2018	3,300,000.00	3,708,884.66	3,728,900.23	(20,015.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	20/03/2018	12,500,000.00	14,034,848.61	14,130,142.61	(95,294.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2017	18/06/2018	200,000.00	177,020.15	178,640.56	(1,620.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/01/2018	2,180,000.00	2,418,454.96	2,426,972.01	(8,517.05)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	19/02/2018	3,440,000.00	3,803,851.22	3,814,752.99	(10,901.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/02/2018	8,850,000.00	9,792,971.35	9,840,498.99	(47,527.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	220,000.00	245,792.39	247,257.14	(1,464.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2017	20/03/2018	3,660,000.00	4,068,566.35	4,102,965.92	(34,399.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	20/12/2017	19/01/2018	100,000.00	154,781.08	155,326.17	(545.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	21/12/2017	19/06/2018	200,000.00	187,064.57	188,605.50	(1,540.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	19/02/2018	486,370.45	486,370.45	488,066.53	(1,696.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	3,160,000.00	3,460,915.24	3,487,719.55	(26,804.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	4,730,000.00	5,275,271.03	5,306,262.30	(30,991.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2017	21/03/2018	150,000.00	167,974.26	168,821.84	(847.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	19/02/2018	6,100,000.00	7,401,051.93	7,378,110.27	22,941.66	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	21/12/2017	21/03/2018	61,800,000.00	75,205,079.86	75,740,595.89	(535,516.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2017	22/01/2018	630,000.00	697,746.51	696,302.88	1,443.63	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2017	27/03/2018	470,000.00	523,874.47	527,338.32	(3,463.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00126	27/12/2017	28/03/2018	2,600,000.00	2,925,462.13	2,949,421.35	(23,959.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	24/01/2018	180,000.00	205,252.11	206,028.43	(776.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2017	26/02/2018	3,070,000.00	3,428,930.99	3,423,295.35	5,635.64	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	27/12/2017	27/03/2018	300,000.00	298,335.95	300,494.42	(2,158.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	07/02/2018	1,750,000.00	1,950,553.03	1,947,680.41	2,872.62	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	3,810,000.00	4,260,368.99	4,289,061.61	(28,692.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	460,000.00	518,880.44	522,698.30	(3,817.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	380,000.00	428,025.41	431,174.77	(3,149.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,200,000.00	1,343,825.52	1,353,713.23	(9,887.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2017	28/03/2018	1,480,000.00	1,658,599.89	1,670,803.67	(12,203.78)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0332	28/12/2017	28/03/2018	200,000.00	300,228.17	302,749.52	(2,521.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,963,740,000.00	2,204,069,759.81	2,218,930,640.24	(14,860,890.43)		

e) Oro

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

7.- Contratos de compra de futuros
a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

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

b) Acciones Cuenta 6.1.5

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

c) Divisas Cuenta 6.1.3

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

d) Oro Cuenta 6.1.4

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

8.- Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

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

b) Acciones Cuenta 6.1.5

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

c) Divisas Cuenta 6.1.3

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

d) Oro Cuenta 6.1.4

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017

9. Inversiones en otras obligaciones DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
N/A	Pagares Ministerio de Hacienda MH1218	2.000.000.000.00	399.999.999.97	399.999.999.97	-	DOP	100%
Total		2.000.000.000.00	399.999.999.97	399.999.999.97	-		100%

9. Inversiones en otras obligaciones USD (*)

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

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de DOP46,7111 por USD1,00.

10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
DO1002217029	BCRD 0% 05-ENE-2018	100.000.000.00	99.874.028.30	99.867.000.00	(7.028.30)	DOP	OTC	19.85%
DO1002234823	BCRD 15.5% 13-JUL-18	120.000.000.00	124.746.169.01	125.242.200.00	496.030.99	DOP	OTC	24.59%
DO1002243926	BCRD 15% 05-JUL-19	720.000.00	773.615.56	795.754.08	22.138.52	DOP	OTC	26.90%
DO1005204214	MHRD 11.5% 10-MAY-24	192.000.000.00	205.704.928.78	206.174.976.00	470.047.22	DOP	OTC	2.40%
DO1005204412	MHRD 11.38% 06-JUL-29	500.000.000.00	521.116.324.70	522.562.500.00	1.446.175.30	DOP	OTC	0.66%
DO1005204719	MHRD 10.38% 04-MAR-22	90.000.000.00	92.311.986.03	92.633.400.00	321.413.97	DOP	OTC	1.44%
DO1005205112	MHRD 10.88% 14-ENE-26	222.500.000.00	230.537.198.16	231.185.732.50	648.534.34	DOP	OTC	13.10%
DO1005205914	MHRD 10.50% 07-ABR-2023	22.600.000.00	22.778.116.83	23.329.844.40	551.727.57	DOP	OTC	2.50%
DO1005206011	MHRD 12.00% 05-MAR-2032	321.400.000.00	337.360.294.85	345.083.323.20	7.723.028.35	DOP	OTC	2.35%
Total		1.569.220.000.00	1.635.202.662.22	1.646.874.730.18	11.672.067.96			100.00%

En USD (*)

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

b) Acciones

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

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2017
10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida
c) Inversiones en otras obligaciones

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

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

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	Banco Multiple Santa Cruz	4,776,791.67	4,776,791.67	4,776,791.67	-	DOP	0.56%
N/A	Banco Multiple Santa Cruz	14,004,408.52	14,004,408.52	14,004,408.52	-	DOP	1.65%
N/A	Banco Multiple Vimenca	30,000,000.00	30,000,000.00	30,000,000.00	-	DOP	3.53%
Total		48,781,200.19	48,781,200.19	48,781,200.19	-		100%

Equivalentes de efectivo USD

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
N/A	Banco Multiple Lafise	2,000,000.00	2,000,000.00	2,000,000.00	-	USD	100%
Total		2,000,000.00	2,000,000.00	2,000,000.00	-		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1- Acciones en guaraníes (GS)
Acciones GS

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	Banco Continental S.A.E.C.A.	75.000	24,867,850,000.00	23,250,000,000.00	(1,617,850,000.00)	GS	BVPASA	100%
Total			24,867,850,000.00	23,250,000,000.00	(1,617,850,000.00)			-

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de GS127.472 por DOP1.00

Acciones en pesos dominicanos (DOP)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
CA69423W8896	Pacific Exploration & Prod. Equity	46,436	2,469,930.84	2,727,186.28	257,255.44	CAD	BVRD	100%
Total			2,469,930.84	2,727,186.28	257,255.44			-

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de CAD34.7889 por DOP1.00

Acciones en pesos dominicanos (DOP)

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
DO8013300124	GAM - Fondo Cerrado Fija	110,296	110,296,000.00	135,195,432.30	24,899,432.30	DOP	BVRD	64%
DO8013400122	PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	16,013	16,022,607.80	17,062,011.63	1,039,403.83	DOP	BVRD	9%
DO8012152021	PIONEER - Fondo Nacional United Renta Fija	905	1,100,154.20	1,107,502.80	7,348.60	DOP	BVRD	1%
N/A	AFI Universal - Fondo Abierto Deposito Financiero Flexible	453	4,999,999.50	5,145,319.30	145,319.80	DOP	N/A	0%
N/A	BHD LIQUIDEZ - Fondo Mutuo Renta Fija Nacional	44,422	50,611,375.10	50,613,427.18	2,052.08	DOP	N/A	26%
Total		172,089	183,030,136.60	209,123,693.21	26,093,556.61			

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
DO8013800123	GAM - Fondo Cerrado GAM Energía	10,000	10,049,210.00	10,672,360.00	623,150.00	USD	BVRD	77%
US74348A4186	Proshares Ultrapro Short SOQQ	3,000	39,267.00	39,090.00	(177.00)	USD	N/A	23%
Total			10,088,477.00	10,711,450.00	622,973.00			-

2. Títulos valores de deuda

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002213424	BCRD 10.01.2020	630.000.00	639.043.75	640.180.17	1.136.42	DOP	OTC	0.56%
DO1002213820	BCRD 20.01.2022	270.000.00	276.397.33	276.736.23	338.90	DOP	OTC	3.58%
DO1002213523	BCRD 12.01.2018	440.000.00	448.053.07	449.020.00	966.93	DOP	OTC	0.00%
DO1002213325	BCRD 07.01.2022	310.000.00	314.583.73	314.985.11	401.38	DOP	OTC	11.31%
DO1002212822	BCRD 30.07.2021	20.000.00	18.955.05	19.988.98	1.033.93	DOP	OTC	4.02%
DO1002230121	BCRD 09.02.2018	1.400.000.00	1.472.485.26	1.470.624.40	(1.860.86)	DOP	OTC	0.51%
DO1002247224	BCRD 21.07.2017 B00717	270.000.00	269.256.24	269.709.75	453.51	DOP	OTC	0.06%
DO1002260524	BCRD 22.02.2019	90.000.00	94.563.65	94.766.76	203.11	DOP	OTC	0.01%
DO1002232523	BCRD 18.05.2018	10.000.00	10.753.87	10.773.85	19.98	DOP	OTC	0.58%
DO1002232622	BCRD 01.06.2018	5,140.000.00	5,577.429.85	5,568.377.88	(9,051.97)	DOP	OTC	0.07%
DO1002251523	BCRD 20.03.2020	31,480.000.00	34,397.569.06	34,470.694.44	73,125.38	DOP	OTC	0.00%
DO1002253727	BCRD 07.08.2020	120.000.00	131.477.55	132.549.36	1,071.81	DOP	OTC	0.00%
DO1002249824	BCRD 05.01.2018	30.000.00	33,326.73	33,333.51	6.78	DOP	OTC	0.13%
DO1002231822	BCRD 30.03.2018	10.000.00	11,021.33	11,155.23	133.90	DOP	OTC	0.00%
DO1002235823	BCRD 13.07.2018	820.000.00	911,298.90	911,657.96	359.06	DOP	OTC	0.17%
DO1002232721	BCRD 29.06.2018	60.000.00	65,074.40	65,944.56	870.16	DOP	OTC	0.00%
DO1002237027	BCRD 05.10.2018	4,660.000.00	4,731,515.74	4,719,130.74	(12,385.00)	DOP	OTC	2.88%
DO1002240229	BCRD 11.01.2019	500.000.00	537,699.69	540,245.50	2,545.81	DOP	OTC	0.03%
DO1002248925	BCRD 13.10.2017	1,550.000.00	1,529,840.09	1,549,496.25	19,656.16	DOP	OTC	0.03%
DO1002243124	BCRD 15.03.2019	400.000.00	400,739.79	400,740.80	1.01	DOP	OTC	0.15%
DO1002229321	BCRD 19.01.2018	150.000.00	158,207.37	158,199.00	-8.37	DOP	OTC	0.18%
DO1002249022	BCRD 18.10.2019	790.000.00	766,790.81	778,770.15	11,979.34	DOP	OTC	0.00%
DO1002243926	BCRD 05.07.2019	45,000.000.00	44,574,885.02	44,522,145.00	(52,740.02)	DOP	OTC	0.17%
DO1002213622	BCRD 19.01.2018 (2)	100.000.00	99,783.05	99,474.40	(308.65)	DOP	OTC	0.36%
DO1002246820	BCRD 12.05.2017	8,200.000.00	9,279,741.30	9,294,454.00	14,712.70	DOP	OTC	0.02%
DO1002213929	BCRD Nota 11.03.2022	4,500.000.00	4,335,854.15	4,352,260.50	16,406.35	DOP	OTC	0.01%
DO1002230527	BCRD 23.02.2018	29,300.000.00	29,519,766.90	29,169,673.60	(350,093.30)	DOP	OTC	0.33%
DO2006301124	BMC221 29.04.2021	6,900.000.00	7,079,523.47	6,877,450.80	(202,072.67)	DOP	OTC	0.91%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

2. Títulos valores de deuda en DOP (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1005205617	MH2 2027	100,000.00	99,968.50	100,567.40	598.90	DOP	OTC	1.99%
DO1005252429	MH5 2028	4,000,000.00	4,372,220.00	4,377,716.00	5,496.00	DOP	OTC	3.49%
DO2006301124	BMC221 29.04.2021	7,000,000.00	7,589,078.97	6,999,189.40	(589,889.57)	DOP	OTC	4.98%
DO2006301025	BMC321 29.04.2021	10,000,000.00	10,844,642.24	9,998,842.00	(845,800.24)	DOP	OTC	4.98%
DO2006301223	BMC421 29.04.2021	10,000,000.00	10,000,000.00	9,998,842.00	(1,158.00)	DOP	OTC	1.00%
DO2006301421	BM1421 29.04.2021	2,000,000.00	2,000,000.00	1,999,768.40	(231.60)	DOP	OTC	1.00%
DO2006301520	BM1521 29.04.2021	2,000,000.00	2,000,000.00	1,999,768.40	(231.60)	DOP	OTC	0.75%
DO2006300928	BMC921 29.04.2021	1,500,000.00	1,500,000.00	1,499,826.30	(173.70)	DOP	OTC	2.34%
DO2006802220	Parallax 22.09.2020							
	PV4915	4,700,000.00	4,806,111.15	4,699,915.40	(106,195.75)	DOP	OTC	0.18%
DO2012700327	BUC 03.12.2017 3ERA	360,067.00	360,067.00	360,022.03	(44.97)	DOP	OTC	0.00%
DO2012700723	BUC 03.12.2017 7MA	5,421.00	5,421.00	5,420.32	(0.68)	DOP	OTC	6.75%
DO2012700426	BUC 03.12.2017	13,539,933.00	13,539,933.00	13,538,241.86	(1,691.14)	DOP	OTC	0.46%
	EGE HAINA 27.06.2026							
	E10626	930,000.00	967,805.27	968,656.38	851.11	DOP	OTC	0.71%
DO2009305114	EGE HAINA 27.06.2026							
DO2009305312	EGE HAINA 27.06.2026	1,429,127.00	1,491,513.25	1,488,530.09	(2,983.16)			
Total		200,714,548.00	207,262,397.53	205,237,844.91	(2,024,552.62)			100%

31 de diciembre de 2016

En USD (*):

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
USP3579EAG28	BSRD 2027	665,000.00	751,456.85	752,248.00	791.15	USD	OTC	21.74%
USP3579EAS65	BSRD 2024	55,000.00	55,670.14	55,247.50	(422.64)	USD	OTC	1.80%
USP3579EAT49	BSRD 28.01.2024	3,000.00	3,314.00	3,131.97	(182.03)	USD	OTC	0.10%
USP3579EBE60	BSRD 27.01.2045	71,000.00	67,441.06	67,479.47	38.41	USD	OTC	2.32%
USP3579EBK21	DR01 2026	233,000.00	260,188.97	242,717.27	(17,471.70)	USD	OTC	7.62%
USP3579EAY34	BSRD 2044	12,000.00	13,758.57	12,130.38	(1,628.19)	USD	OTC	0.39%
DO1005244525	MH CDEEE 2023	449,000.00	501,639.79	516,522.87	14,883.08	USD	OTC	14.68%
DO2009304620	EGE HAINA 28.04.2025 EGT625	10,000.00	8,965.17	10,228.94	1,261.77	USD	OTC	0.33%
USP10475AA22	RESERVAS 01.02.2023	1,561,000.00	1,573,866.50	1,571,310.41	(2,556.09)	USD	OTC	51.03%
Total		3,059,000.00	3,236,301.05	3,231,014.81	(5,286.24)			100%

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de DOP45.5544 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

3. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

e) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

f) 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
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

4. 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
							DOP	Alpha Sociedad de Valores
							DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total								

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de DOP46,7111 por USD1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
GAM001	28/12/2016	02/01/2017	5,000.00	5,325,000.00	5,336,180.00	(11,180.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
GAM001	28/12/2016	02/01/2017	5,000.00	5,325,000.00	5,336,180.00	(11,180.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			10,000.00	10,650,000.00	10,672,360.00	(22,360.00)		0

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		0
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		0

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

e) Oro

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00	0	0
Total			0.00	0.00	0.00	0.00	0	0

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5. - Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	02/03/2016	02/03/2017	5,020,000.00	5,238,211.78	5,443,005.85	204,794.07	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	12/04/2017	13,140,000.00	13,948,443.82	14,136,379.12	187,935.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	14/02/2017	16,980,000.00	18,278,903.13	18,457,861.75	178,958.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/01/2016	06/01/2017	3,150,000.00	3,269,884.28	3,445,440.22	175,555.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/12/2016	04/01/2017	3,120,000.00	3,241,729.19	3,413,707.32	171,978.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	10/03/2017	10,640,000.00	11,383,546.38	11,521,826.71	138,280.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	16/06/2017	5,510,000.00	5,756,965.99	5,859,660.11	102,694.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	29/11/2017	4,350,000.00	4,378,292.67	4,463,549.39	85,256.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	03/11/2016	01/02/2017	13,210,000.00	13,049,472.21	13,118,369.43	68,897.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/08/2016	27/01/2017	3,980,000.00	3,894,646.40	3,962,237.85	67,591.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	27/01/2017	16,750,000.00	18,200,088.21	18,260,065.77	59,977.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/01/2017	19,280,000.00	21,006,747.38	21,064,905.58	58,158.20	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2016	04/08/2017	2,460,000.00	2,537,502.68	2,593,172.22	55,669.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2016	08/02/2017	7,850,000.00	8,488,819.93	8,541,386.28	52,566.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	07/02/2017	4,200,000.00	4,521,792.92	4,570,641.15	48,848.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	16/03/2017	3,780,000.00	4,040,870.05	4,089,352.19	48,482.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	10/02/2017	8,370,000.00	9,056,713.73	9,104,285.62	47,571.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	23/01/2017	9,260,000.00	10,055,654.91	10,101,234.07	45,579.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	25/04/2017	2,850,000.00	3,013,986.97	3,059,059.44	45,072.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	28/02/2017	5,640,000.00	6,073,208.70	6,117,203.38	43,994.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2016	23/02/2017	4,350,000.00	4,678,187.74	4,721,823.07	43,635.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	12/06/2017	2,980,000.00	3,128,971.66	3,171,376.61	42,404.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	27/12/2016	26/01/2017	8,700,000.00	9,586,710.88	9,627,315.87	40,604.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/01/2017	8,900,000.00	9,672,667.13	9,713,154.15	40,487.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	14/02/2017	14,450,000.00	15,667,571.12	15,707,662.09	40,090.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	26/12/2016	25/01/2017	8,700,000.00	9,590,405.46	9,628,775.20	38,369.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	27/12/2016	26/01/2017	9,130,000.00	10,066,328.81	10,103,148.72	36,819.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	4,150,000.00	4,453,219.01	4,489,632.69	36,413.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/06/2017	1,790,000.00	1,866,287.47	1,902,229.48	35,942.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	20/03/2017	2,500,000.00	2,667,005.06	2,702,865.93	35,860.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	17/10/2016	17/01/2017	3,590,000.00	3,531,800.28	3,566,085.30	34,285.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	31/01/2017	10,120,000.00	10,992,867.44	11,025,338.73	32,471.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NU0218	25/10/2016	23/01/2017	2,820,000.00	2,931,623.97	2,963,987.46	32,263.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	09/02/2017	1,700,000.00	1,818,687.97	1,849,432.51	30,744.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28/12/2016	28/03/2017	600,000.00	587,967.13	617,954.62	29,987.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/02/2016	16/02/2017	780,000.00	821,071.58	847,617.44	26,545.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	13/02/2017	1,830,000.00	1,863,987.05	1,889,591.82	25,604.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	14/02/2017	3,910,000.00	4,224,916.19	4,250,308.56	25,392.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2016	05/01/2017	4,180,000.00	4,547,487.38	4,572,768.49	25,281.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/02/2017	4,560,000.00	4,941,181.61	4,966,359.53	25,177.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	10/05/2017	1,080,000.00	1,131,659.52	1,156,139.85	24,480.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	23/01/2017	5,010,000.00	5,441,287.92	5,465,138.52	23,850.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2016

5. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	16/11/2016	15/05/2017	1,790,000.00	1,890,947.68	1,914,491.67	23,543.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/01/2017	1,060,000.00	1,133,339.53	1,156,113.17	22,773.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/01/2016	05/01/2017	390,000.00	404,526.29	426,645.86	22,119.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	30/01/2017	2,110,000.00	2,277,842.02	2,299,126.80	21,284.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/11/2016	10/01/2017	2,440,000.00	2,399,051.06	2,419,990.75	20,939.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	08/12/2017	1,090,000.00	1,095,861.35	1,116,416.46	20,555.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/08/2016	11/08/2017	1,230,000.00	1,274,918.23	1,294,947.72	20,029.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0219	12/12/2016	11/01/2017	2,010,000.00	2,075,838.89	2,095,093.60	19,254.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	10/01/2017	2,740,000.00	2,975,951.17	2,995,087.74	19,136.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	22/02/2017	10,660,000.00	11,554,085.80	11,573,026.61	18,960.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	12/12/2016	10/02/2017	2,300,000.00	2,298,438.33	2,316,989.20	18,550.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	31/01/2017	5,580,000.00	6,060,715.19	6,079,188.75	18,473.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/10/2016	30/03/2017	1,130,000.00	1,201,272.27	1,219,738.15	18,465.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	31/01/2017	5,090,000.00	5,527,218.61	5,545,353.17	18,134.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	1,920,000.00	2,078,688.81	2,096,419.70	17,730.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	21/10/2016	19/01/2017	1,930,000.00	1,900,309.90	1,917,992.02	17,682.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	27/01/2017	4,440,000.00	4,822,795.04	4,840,280.12	17,485.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	27/01/2017	4,440,000.00	4,823,788.19	4,840,280.12	16,491.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	27/01/2017	4,440,000.00	4,824,096.41	4,840,280.12	16,183.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	12/12/2016	11/01/2017	3,460,000.00	3,725,384.54	3,741,393.26	16,008.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	26/01/2017	2,670,000.00	2,895,917.67	2,911,171.46	15,253.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	31/01/2017	2,970,000.00	3,220,446.83	3,235,697.24	15,250.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/01/2017	2,320,000.00	2,518,397.80	2,533,575.64	15,177.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	18/04/2017	560,000.00	587,770.11	601,824.28	14,054.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	4,280,000.00	4,672,687.14	4,686,612.84	13,925.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	21/03/2017	8,920,000.00	9,628,690.29	9,642,280.62	13,590.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/07/2016	05/01/2017	990,000.00	967,395.11	980,793.17	13,398.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	23/03/2017	510,000.00	537,757.92	551,119.64	13,361.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	12/01/2017	4,150,000.00	4,521,616.17	4,534,917.89	13,301.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	19/10/2016	17/01/2017	1,870,000.00	1,844,394.46	1,857,543.04	13,148.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/05/2017	870,000.00	917,080.83	930,176.02	13,095.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	27/07/2017	590,000.00	609,773.57	622,837.84	13,064.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	17/02/2017	860,000.00	921,661.95	934,403.60	12,741.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

S. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	14/11/2016	12/01/2017	850,000.00	916,776.13	928,838.60	12,062.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	1,080,000.00	1,164,647.67	1,176,617.18	11,969.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	1,460,000.00	1,578,677.25	1,590,612.11	11,934.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	03/11/2016	01/02/2017	850,000.00	832,275.33	844,104.01	11,828.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/07/2016	02/03/2017	880,000.00	942,781.04	954,152.42	11,371.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	13/01/2017	1,560,000.00	1,693,299.32	1,704,421.82	11,122.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	02/11/2016	31/01/2017	1,380,000.00	1,359,595.61	1,370,524.56	10,928.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	19/06/2017	420,000.00	435,617.64	446,413.09	10,795.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/08/2016	21/02/2017	1,310,000.00	1,411,739.03	1,422,428.11	10,689.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/09/2016	05/09/2017	200,000.00	199,264.64	209,609.16	10,344.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	13/01/2017	1,030,000.00	1,115,239.72	1,125,355.43	10,115.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28/12/2016	28/03/2017	200,000.00	195,989.04	205,984.87	9,995.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	17/02/2017	1,060,000.00	1,141,899.38	1,151,706.76	9,807.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	11/01/2017	1,720,000.00	1,870,205.07	1,879,830.15	9,625.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	10/01/2017	1,080,000.00	1,061,542.48	1,071,143.45	9,600.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	21/03/2017	7,570,000.00	8,174,185.04	8,182,966.85	8,781.81	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	21/02/2017	640,000.00	686,173.53	694,926.71	8,753.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	470,000.00	502,318.31	510,906.66	8,588.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	14/02/2017	3,590,000.00	3,894,040.00	3,902,457.22	8,417.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/01/2017	1,660,000.00	1,803,568.87	1,811,954.48	8,385.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	17/01/2017	2,670,000.00	2,907,067.39	2,915,333.64	8,266.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	24/02/2017	1,240,000.00	1,337,655.69	1,345,776.17	8,120.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2016	04/08/2017	100,000.00	97,499.50	105,413.50	7,914.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	07/12/2016	06/01/2017	3,080,000.00	3,224,248.74	3,232,153.70	7,904.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	15/12/2016	16/03/2017	210,000.00	223,749.19	231,547.12	7,797.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	27/01/2017	1,600,000.00	1,736,597.25	1,744,245.09	7,647.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	20/03/2017	3,330,000.00	3,592,610.20	3,600,217.42	7,607.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	760,000.00	820,588.90	827,989.86	7,400.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	18/01/2017	450,000.00	483,880.14	491,270.42	7,390.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2016	16/02/2017	1,230,000.00	1,329,334.28	1,336,627.50	7,293.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	17/01/2017	450,000.00	484,071.23	491,348.37	7,277.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	31/10/2016	04/01/2017	2,160,000.00	2,330,982.83	2,338,205.70	7,222.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2016

S. - Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	26/10/2016	24/04/2017	240,000.00	250,499.62	257,650.67	7,151.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	20/12/2016	19/01/2017	440,000.00	480,463.84	487,415.37	6,951.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	22/07/2016	18/01/2017	270,000.00	261,342.47	268,260.76	6,918.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	14/02/2017	2,900,000.00	3,145,603.36	3,152,402.77	6,799.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	09/01/2017	2,550,000.00	2,781,088.60	2,787,840.85	6,752.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2016	24/01/2017	100,000.00	102,330.72	109,067.28	6,736.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	20/03/2017	450,000.00	479,805.48	486,515.87	6,710.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/04/2017	140,000.00	143,673.93	150,296.23	6,622.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	12/01/2017	460,000.00	496,151.02	502,665.60	6,514.58	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	13/02/2017	480,000.00	515,393.54	521,860.15	6,466.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	06/01/2017	420,000.00	452,937.41	459,392.03	6,454.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	10/01/2017	1,010,000.00	995,356.36	1,001,717.48	6,361.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/11/2016	07/02/2017	230,000.00	244,078.77	250,297.02	6,218.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	2,670,000.00	2,896,196.70	2,902,384.62	6,187.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	100,000.00	103,018.40	109,188.53	6,170.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	100,000.00	103,018.40	109,188.53	6,170.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	13/02/2017	1,460,000.00	1,581,335.45	1,587,324.62	5,989.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	12/10/2017	80,000.00	76,929.69	82,885.29	5,955.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	07/02/2017	750,000.00	810,244.63	816,185.92	5,941.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	03/02/2017	1,660,000.00	1,801,700.81	1,807,641.60	5,940.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	16/02/2017	160,000.00	167,984.39	173,870.24	5,885.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	2,230,000.00	2,435,992.21	2,441,856.69	5,864.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	06/02/2017	130,000.00	135,633.39	141,494.74	5,861.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/04/2017	560,000.00	595,328.67	601,184.91	5,856.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	2,250,000.00	2,457,942.47	2,463,756.75	5,814.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	23/01/2017	220,000.00	234,223.18	239,986.12	5,762.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	31/01/2017	220,000.00	234,063.26	239,681.28	5,618.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/05/2017	90,000.00	90,537.61	96,122.35	5,584.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	26/01/2017	890,000.00	964,894.92	970,390.49	5,495.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	28/02/2017	230,000.00	243,972.76	249,460.42	5,487.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/01/2017	1,690,000.00	1,839,230.98	1,844,700.64	5,469.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	06/02/2017	80,000.00	81,649.77	87,073.69	5,423.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	830,000.00	896,857.53	902,239.41	5,381.88	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	17/10/2016	17/01/2017	1,780,000.00	1,762,874.07	1,768,142.57	5,268.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2016	14/07/2017	390,000.00	407,423.99	412,671.13	5,247.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2016	01/02/2017	1,620,000.00	1,759,411.24	1,764,645.17	5,233.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	02/12/2016	03/01/2017	4,360,000.00	4,718,170.09	4,723,371.12	5,201.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	15/11/2016	08/02/2017	210,000.00	214,724.80	219,857.03	5,132.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	27/07/2016	27/07/2017	120.000.00	121.551.35	126.678.88	5,127.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	170.000.00	178.907.05	183.912.66	5,005.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	06/02/2017	420.000.00	452.154.37	457.136.86	4,982.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	21/12/2016	20/01/2017	140.000.00	142.019.59	146.972.07	4,952.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/02/2017	100.000.00	103.730.78	108.599.62	4,868.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	09/03/2017	120.000.00	125.178.63	129.968.20	4,787.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	18/11/2016	17/01/2017	300.000.00	293.450.15	298.234.94	4,784.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2016	04/08/2017	60.000.00	58.499.71	63.248.10	4,748.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	2.680.000.00	2.895.066.98	2.899.793.26	4,726.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	20/02/2017	530.000.00	570.956.74	575.577.98	4,621.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	24/02/2017	260.000.00	277.559.85	282.178.87	4,619.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	23/01/2017	540.000.00	584.457.53	589.056.85	4,599.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2016	26/06/2017	90.000.00	91.044.72	95.540.07	4,495.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/10/2016	10/01/2017	160.000.00	170.456.99	174.895.63	4,438.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/07/2016	08/02/2017	100.000.00	104.423.72	108.807.47	4,383.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/07/2016	03/01/2017	110.000.00	104.487.67	108.831.91	4,344.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2016	02/03/2017	450.000.00	483.615.06	487.918.85	4,303.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2016	01/05/2017	410.000.00	435.328.00	439.607.11	4,279.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/04/2017	140.000.00	146.018.40	150.296.23	4,277.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	15/02/2017	630.000.00	680.469.36	684.723.21	4,253.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	04/01/2017	920.000.00	1,002.376.87	1,006.608.00	4,229.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/01/2017	890.000.00	967.107.81	971.315.42	4,207.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/02/2017	1,000.000.00	1,081.796.30	1,085.996.19	4,199.89	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/01/2017	420.000.00	453.668.73	457.864.34	4,195.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/05/2017	100.000.00	102.752.74	106.916.78	4,164.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	10/01/2017	280.000.00	273.552.37	277.703.86	4,151.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	11/01/2017	670.000.00	728.219.86	732.259.42	4,039.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	25/07/2016	19/01/2017	490.000.00	482.913.52	486.951.34	4,037.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	19/01/2017	890.000.00	967.454.24	971.469.57	4,015.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	21/03/2017	270.000.00	287.916.58	291.862.75	3,946.17	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	27/01/2017	70.000.00	72.443.01	76.310.72	3,867.71	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/10/2016	26/04/2017	100.000.00	103.482.42	107.316.39	3,833.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/01/2017	2,310.000.00	2,518.470.56	2,522.254.95	3,784.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	29/03/2017	320.000.00	320.092.20	323.876.25	3,784.05	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2016	01/02/2017	630.000.00	682.527.12	686.250.90	3,723.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/01/2017	910.000.00	989.598.12	993.300.35	3,702.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	27/10/2016	24/02/2017	1,130.000.00	1,241.249.97	1,244.947.65	3,697.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	29/06/2017	360.000.00	378.338.08	381.954.76	3,616.68	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/08/2016	24/02/2017	250.000.00	267.725.51	271.325.84	3,600.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/11/2016	05/01/2017	1,950.000.00	1,928.408.90	1,931.865.34	3,456.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	09/12/2016	07/02/2017	650,000.00	703,918.67	707,361.13	3,442.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	07/12/2016	06/01/2017	10,170,000.00	10,074,383.57	10,077,656.78	3,273.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	2,030,000.00	2,215,364.66	2,218,636.75	3,272.09	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2016	28/02/2017	110,000.00	116,089.74	119,307.16	3,217.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	01/12/2016	03/01/2017	1,430,000.00	1,411,644.93	1,414,814.83	3,169.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2016	04/08/2017	40,000.00	38,999.80	42,165.40	3,165.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	05/10/2016	03/01/2017	420,000.00	412,457.22	415,540.02	3,082.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/01/2017	8,880,000.00	9,694,399.48	9,697,479.18	3,079.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	17/11/2016	18/01/2017	750,000.00	742,090.00	745,168.79	3,078.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	17/10/2016	17/01/2017	1,980,000.00	1,963,738.89	1,966,810.28	3,071.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	14/03/2017	360,000.00	386,607.28	389,586.82	2,979.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	14/11/2016	13/01/2017	2,050,000.00	2,031,561.63	2,034,541.10	2,979.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	03/08/2016	30/01/2017	580,000.00	574,817.81	577,794.11	2,976.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	03/11/2017	130,000.00	131,187.04	134,094.98	2,907.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	1,960,000.00	2,117,510.68	2,120,404.84	2,894.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	25/01/2017	350,000.00	378,785.51	381,674.86	2,889.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	01/03/2017	670,000.00	723,711.44	726,573.00	2,861.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	17/11/2016	16/01/2017	90,000.00	96,901.78	99,743.89	2,842.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	13/01/2017	180,000.00	193,835.61	196,664.06	2,828.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	22/03/2017	430,000.00	461,923.61	464,743.98	2,820.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	17/01/2017	220,000.00	237,396.34	240,214.76	2,818.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/10/2016	03/02/2017	120,000.00	127,860.40	130,672.89	2,812.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/08/2016	11/08/2017	90,000.00	91,943.17	94,752.27	2,809.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/10/2016	05/04/2017	830,000.00	891,265.26	894,042.77	2,777.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	26/12/2016	27/03/2017	90,000.00	96,291.64	99,066.21	2,774.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	30/11/2016	11/01/2017	1,800,000.00	1,782,866.57	1,785,634.83	2,768.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	23/01/2017	950,000.00	1,033,561.97	1,036,303.71	2,741.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2016	07/02/2017	180,000.00	193,172.14	195,884.62	2,712.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	28/03/2017	130,000.00	137,657.03	140,368.89	2,711.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2016	10/04/2017	300,000.00	320,187.79	322,862.55	2,674.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2016	02/02/2017	350,000.00	378,539.74	381,189.88	2,650.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/10/2016	06/03/2017	120,000.00	127,383.02	130,028.55	2,645.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0217	15/12/2016	13/01/2017	1,960,000.00	1,942,629.03	1,945,219.79	2,590.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	21/10/2016	21/02/2017	210,000.00	226,734.54	229,324.55	2,590.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	28/12/2016	27/01/2017	960,000.00	1,059,581.64	1,062,163.48	2,581.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	17/01/2017	890,000.00	969,241.65	971,777.88	2,536.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	02/12/2016	02/01/2017	370,000.00	396,105.89	398,632.45	2,526.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	21/11/2016	20/01/2017	680,000.00	711,345.55	713,864.32	2,518.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/08/2016	24/02/2017	450,000.00	485,875.05	488,386.51	2,511.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	06/03/2017	120,000.00	127,519.57	130,028.55	2,508.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	13/06/2017	100,000.00	103,907.42	106,403.01	2,495.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	09/12/2016	01/03/2017	220,000.00	239,733.69	242,194.67	2,460.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	14/03/2017	1,350,000.00	1,458,493.25	1,460,950.59	2,457.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/08/2016	24/02/2017	170,000.00	182,080.30	184,501.57	2,441.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
LC0217	27/10/2016	25/01/2017	540,000.00	534.941.00	537,352.61	2,411.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	13/01/2017	520,000.00	513.764.13	516,078.72	2,314.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	02/12/2016	02/01/2017	1,530,000.00	1,511.465.75	1,513,752.93	2,287.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/03/2017	1,070,000.00	1,155.862.59	1,158,123.94	2,261.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	06/07/2016	05/01/2017	530,000.00	522.812.33	525,071.09	2,258.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	27/09/2016	25/01/2017	1,190,000.00	1,181.999.90	1,184,165.93	2,166.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	27/01/2017	180,000.00	194.127.56	196,227.57	2,100.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	13/01/2017	890,000.00	970.301.37	972,394.50	2,093.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	09/06/2017	430,000.00	455.774.20	457,860.22	2,086.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	13/02/2017	320,000.00	345.832.41	347,906.77	2,074.36	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/01/2017	1,830,000.00	1,995.140.54	1,997,199.11	2,058.57	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2016	02/02/2017	900,000.00	978.178.09	980,202.54	2,024.45	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/10/2016	29/06/2017	130,000.00	135.908.28	137,928.11	2,019.83	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	05/01/2017	610,000.00	665.391.90	667,317.89	1,925.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	06/02/2017	540,000.00	585.841.64	587,747.39	1,905.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/01/2017	860,000.00	937.167.36	939,021.32	1,853.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	15/11/2016	15/02/2017	440,000.00	483.573.69	485,422.63	1,848.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	30/06/2017	420,000.00	446.221.42	448,011.52	1,790.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	07/04/2017	1,210,000.00	1,301.211.43	1,302,903.05	1,691.62	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	30/11/2016	11/01/2017	1,460,000.00	1,446.715.31	1,448,348.25	1,632.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	01/03/2017	180,000.00	193.577.81	195,198.72	1,620.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	09/02/2017	1,160,000.00	1,260.358.63	1,261,965.71	1,607.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/07/2016	05/01/2017	740,000.00	731.576.71	733,118.13	1,541.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	26/01/2017	90,000.00	96.614.73	98,129.37	1,514.64	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	13/02/2017	890,000.00	966.105.62	967,615.70	1,510.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	16/02/2017	410,000.00	444.041.08	445,542.50	1,501.42	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	20/12/2016	16/02/2017	270,000.00	297.490.35	298,988.41	1,498.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	14/11/2016	13/01/2017	1,150,000.00	1,278.623.28	1,280,114.95	1,491.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	09/03/2017	1,000,000.00	1,081.561.86	1,083,051.66	1,489.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	24/10/2016	24/01/2017	1,023,315.07	1,023.315.07	1,024,723.89	1,408.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	25/01/2017	90,000.00	96.773.82	97,833.19	1,371.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	90,000.00	96.500.27	97,833.19	1,332.92	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/01/2017	170,000.00	184.083.87	185,414.38	1,330.51	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/09/2016	02/02/2017	340,000.00	368.989.18	370,298.74	1,309.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	27/10/2016	17/01/2017	830,000.00	823.167.38	824,470.97	1,303.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	17/11/2016	16/01/2017	220,000.00	242.515.62	243,818.39	1,302.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	20/01/2017	90,000.00	96.925.61	98,222.91	1,297.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	27/10/2016	25/01/2017	410,000.00	454.269.93	455,552.56	1,282.63	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	05/12/2016	02/01/2017	4,220,000.00	4,173.908.91	4,175,187.82	1,278.91	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/08/2016	20/02/2017	200,000.00	215.961.77	217,199.24	1,237.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/01/2017	180,000.00	195.223.83	196,445.81	1,221.98	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018							DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	15/12/2016	13/02/2017	290,000.00	314,091.82	315,290.51	1,198.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	03/10/2016	03/01/2017	570,000.00	616,344.75	617,504.94	1,160.19	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/09/2016	03/01/2017	170,000.00	185,012.67	186,150.51	1,137.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/08/2016	30/01/2017	180,000.00	195,003.00	196,134.04	1,131.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2016	18/01/2017	740,000.00	806,801.14	807,866.92	1,065.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	20/03/2017	2,670,000.00	2,885,632.38	2,886,860.81	1,028.43	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	31/08/2016	17/01/2017	470,000.00	465,851.71	466,869.11	1,017.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/12/2016	03/01/2017	1,530,000.00	1,512,815.75	1,513,752.93	937.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	90,000.00	97,129.87	98,051.43	921.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	4,900,000.00	5,354,470.11	5,355,330.08	859.97	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/03/2017	240,000.00	258,324.58	259,184.14	859.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/02/2016	15/02/2017	320,000.00	346,952.58	347,795.91	843.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	310,000.00	334,598.92	335,423.85	824.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	14/03/2017	450,000.00	486,164.42	486,983.53	819.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	16/01/2017	10,150,000.00	10,079,342.47	10,080,154.42	811.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	920,000.00	994,668.98	995,451.42	782.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	23/05/2017	450,000.00	479,863.01	480,611.75	748.74	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	09/02/2017	180,000.00	195,075.90	195,822.27	746.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	26/09/2016	24/01/2017	1,140,000.00	1,133,452.05	1,134,160.42	708.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	18/01/2017	490,000.00	486,188.50	486,843.61	655.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2016	02/02/2017	270,000.00	293,416.44	294,060.76	644.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/10/2016	02/01/2017	490,000.00	484,164.45	484,796.69	632.24	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/09/2016	28/03/2017	100,000.00	107,345.34	107,976.07	630.73	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2016	20/01/2017	470,000.00	512,347.01	512,941.85	594.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	3,890,000.00	4,250,908.23	4,251,476.33	568.10	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/03/2017	250,000.00	280,891.30	281,413.29	521.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	250,000.00	272,484.01	272,971.31	487.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	14/12/2016	13/01/2017	2,040,000.00	2,024,225.48	2,024,616.51	391.03	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	28/03/2017	170,000.00	183,209.62	183,559.32	349.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2016	27/01/2017	270,000.00	294,045.43	294,341.36	295.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/12/2016	05/01/2017	1,170,000.00	1,158,862.88	1,159,119.20	256.32	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	19/01/2017	270,000.00	294,496.90	294,715.49	218.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	16/05/2017	90,000.00	96,038.76	96,242.23	203.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	20/01/2017	8,250,000.00	9,014,480.92	9,014,680.15	199.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	16/12/2016	16/01/2017	5,480,000.00	5,442,193.97	5,442,290.27	96.30	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	30/11/2016	31/01/2017	2,040,000.00	2,032,613.70	2,032,689.86	76.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	28/12/2016	27/01/2017	640,000.00	686,210.96	686,277.95	66.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	03/02/2017	90,000.00	97,949.68	98,004.67	54.99	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	23/01/2017	90,000.00	98,138.36	98,176.14	37.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	21/03/2017	120,000.00	129,688.44	129,716.78	28.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	17/05/2017	180,000.00	192,444.93	192,450.21	5.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	24/10/2016	24/01/2017	270.000.00	294.494.38	294.481.66	(12.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	40.000.00	43.319.32	43.280.50	(38.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	16/05/2017	360.000.00	385.060.82	384.968.93	(91.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	01/05/2017	340.000.00	364.656.63	364.552.24	(104.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	28/02/2017	310.000.00	336.336.85	336.229.26	(107.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	28/07/2016	04/01/2017	530.000.00	525.077.08	524.954.57	(122.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	17/02/2017	90.000.00	97.983.91	97.786.42	(197.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	13/10/2016	11/01/2017	1.340.000.00	1.329.520.79	1.329.305.93	(214.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	13/01/2017	310.000.00	338.918.36	338.699.21	(219.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	05/12/2016	03/02/2017	470.000.00	503.625.81	503.388.97	(236.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	22/12/2016	20/01/2017	900.000.00	894.850.49	894.598.30	(252.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2016	18/01/2017	450.000.00	491.523.97	491.270.42	(253.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	28/02/2017	1.600.000.00	1.735.657.46	1.735.376.85	(280.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	08/11/2016	06/02/2017	410.000.00	409.369.87	409.071.67	(298.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	07/02/2017	70.000.00	76.544.66	76.177.35	(367.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/11/2016	09/05/2017	180.000.00	193.109.59	192.724.23	(385.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BA0118	16/12/2016	16/01/2017	540.000.00	539.614.24	539.215.65	(398.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	14/10/2016	03/02/2017	120.000.00	126.336.52	125.922.89	(413.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	02/02/2017	890.000.00	969.742.47	969.311.40	(431.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	20/03/2017	180.000.00	195.054.04	194.606.35	(447.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	01/03/2017	1.040.000.00	1.128.287.80	1.127.814.81	(472.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	25/01/2017	360.000.00	393.059.58	392.579.85	(479.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	15/05/2017	510.000.00	556.824.98	556.243.13	(581.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	15/05/2017	90.000.00	96.884.73	96.259.36	(625.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	13/04/2017	90.000.00	97.468.77	96.807.39	(661.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	11/05/2017	630.000.00	674.961.09	674.295.03	(666.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/01/2017	1.180.000.00	1.288.498.22	1.287.811.45	(686.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	06/12/2016	05/01/2017	1.890.000.00	2.046.330.69	2.045.612.71	(717.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2016	09/05/2017	270.000.00	289.823.83	289.086.34	(737.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/09/2016	16/03/2017	340.000.00	368.596.28	367.825.33	(770.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	27/01/2017	1.150.000.00	1.254.478.08	1.253.676.16	(801.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	14/12/2016	14/03/2017	170.000.00	181.725.10	180.897.07	(828.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	27/10/2016	25/01/2017	500.000.00	498.394.50	497.548.71	(845.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2016	18/04/2017	90.000.00	97.577.40	96.721.76	(855.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	06/01/2017	2.200.000.00	2.407.236.99	2.406.339.20	(897.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	09/03/2017	430.000.00	466.612.52	465.712.21	(900.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2016	17/04/2017	660.000.00	710.325.98	709.418.49	(907.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	05/01/2017	4.150.000.00	4.540.875.82	4.539.949.57	(926.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	16/12/2016	17/01/2017	710.000.00	706.233.46	705.270.35	(963.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	13/02/2017	180.000.00	196.707.57	195.697.56	(1.010.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	20/09/2016	13/01/2017	310.000.00	308.695.89	307.662.31	(1.033.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE0518	05/12/2016	06/03/2017	590.000.00	629.716.02	628.598.29	(1.117.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/01/2017	140.000.00	153.880.89	152.718.44	(1.162.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20/12/2016	16/02/2017	110.000.00	121.412.29	120.195.59	(1.216.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	50.000.00	55.590.40	54.351.77	(1.238.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	01/03/2017	1.070.000.00	1.161.611.09	1.160.347.93	(1.263.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/08/2016	17/08/2017	230.000.00	243.157.33	241.882.10	(1.275.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/10/2016	04/01/2017	540.000.00	536.140.04	534.859.37	(1.280.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	10/01/2017	3.070.000.00	3.357.087.43	3.355.809.98	(1.287.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2016	03/04/2017	190.000.00	206.287.87	204.951.08	(1.330.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	16/01/2017	190.000.00	208.868.90	207.491.11	(1.377.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	06/02/2017	70.000.00	77.584.10	76.189.48	(1.394.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	10/02/2017	150.000.00	164.594.53	163.159.24	(1.435.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/09/2016	15/03/2017	510.000.00	553.272.12	551.826.33	(1.445.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/01/2017	1.100.000.00	1.201.967.99	1.200.502.20	(1.465.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	09/12/2016	11/01/2017	12.000.000.00	12.104.153.41	12.102.636.06	(1.517.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	31/01/2017	930.000.00	1.014.781.14	1.013.198.12	(1.583.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	28/09/2016	06/01/2017	340.000.00	338.498.63	336.912.81	(1.585.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	02/01/2017	4.640.000.00	4.592.357.26	4.590.727.84	(1.629.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2016	03/04/2017	180.000.00	195.808.22	194.165.86	(1.638.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	01/02/2017	890.000.00	971.161.50	969.465.56	(1.695.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	03/10/2016	04/01/2017	520.000.00	516.788.16	515.049.76	(1.738.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	15/11/2016	12/01/2017	1.020.000.00	1.104.568.15	1.102.782.85	(1.785.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/01/2017	340.000.00	358.774.33	356.932.16	(1.842.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/01/2017	3.640.000.00	3.978.853.67	3.976.984.25	(1.869.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	950.000.00	1.039.174.21	1.037.291.00	(1.883.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	01/12/2016	02/01/2017	1.740.000.00	1.935.240.26	1.933.343.58	(1.896.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	30/11/2016	08/02/2017	4.810.000.00	5.037.677.38	5.035.772.89	(1.904.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2016	09/02/2017	1.270.000.00	1.383.599.68	1.381.634.88	(1.964.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/02/2017	990.000.00	1.080.262.46	1.078.222.79	(2.039.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	28/03/2017	280.000.00	304.409.30	302.333.00	(2.076.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	18/07/2016	16/01/2017	420.000.00	419.209.02	417.109.84	(2.099.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	05/01/2017	710.000.00	778.818.09	776.714.26	(2.103.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/10/2016	02/01/2017	370.000.00	368.260.37	366.070.97	(2.189.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	03/10/2016	03/01/2017	360.000.00	358.380.82	356.177.16	(2.203.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	08/12/2016	06/01/2017	1.780.000.00	1.766.070.92	1.763.837.67	(2.233.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	23/01/2017	290.000.00	318.622.58	316.345.34	(2.277.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	03/01/2017	440.000.00	484.084.93	481.801.32	(2.283.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/11/2016	12/01/2017	4.100.000.00	4.070.520.55	4.068.180.77	(2.339.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	18/12/2017	100.000.00	104.640.92	102.215.97	(2.424.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/02/2016	14/02/2017	230.000.00	252.444.91	250.018.15	(2.426.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	13/01/2017	810.000.00	806.324.38	803.891.85	(2.432.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	01/11/2016	04/01/2017	380.000.00	418,320.98	415,772.05	(2,548.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/09/2016	03/03/2017	450.000.00	490,390.86	487,840.91	(2,549.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	13/06/2017	220.000.00	236,644.80	234,086.61	(2,558.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	10/01/2017	90.000.00	100,939.19	98,378.79	(2,560.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	4,180.000.00	4,579,721.94	4,577,112.54	(2,609.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	11/01/2017	2,980.000.00	3,225,045.60	3,222,356.05	(2,689.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	24/04/2017	820.000.00	883,012.88	880,306.47	(2,706.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	13/01/2017	1,520.000.00	1,511,262.33	1,508,537.79	(2,724.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/09/2016	10/03/2017	220.000.00	240,966.33	238,233.26	(2,733.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/09/2016	20/03/2017	630.000.00	683,869.62	681,122.21	(2,747.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	10/02/2017	220.000.00	242,048.49	239,300.22	(2,748.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	05/12/2016	03/02/2017	470.000.00	506,220.47	503,471.58	(2,748.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	07/02/2017	280.000.00	307,461.44	304,709.41	(2,752.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	03/02/2017	70.000.00	79,007.44	76,225.85	(2,781.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	07/02/2017	220.000.00	242,201.27	239,414.54	(2,786.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	06/02/2017	140.000.00	155,168.22	152,378.95	(2,789.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	16/12/2016	16/01/2017	1,520.000.00	1,512,421.23	1,509,540.37	(2,880.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	04/08/2016	31/01/2017	130.000.00	142,277.05	139,305.95	(2,971.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/04/2017	540.000.00	582,756.97	579,714.02	(3,042.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	20/01/2017	280.000.00	308,636.99	305,582.38	(3,054.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/10/2016	03/04/2017	70.000.00	78,628.72	75,510.50	(3,118.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/10/2016	18/04/2017	450.000.00	486,793.19	483,608.79	(3,186.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/01/2017	890.000.00	974,042.46	970,852.95	(3,189.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/01/2017	260.000.00	286,804.23	283,574.93	(3,229.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	27/03/2017	500.000.00	543,211.18	539,966.96	(3,244.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	25/07/2016	19/01/2017	2,100.000.00	2,090,219.18	2,086,934.32	(3,284.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	12/01/2017	6,520.000.00	7,052,501.33	7,049,160.99	(3,340.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	05/12/2016	04/01/2017	990.000.00	983,949.27	980,575.51	(3,373.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	01/12/2016	03/01/2017	1,740.000.00	1,888,417.59	1,885,015.08	(3,402.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/07/2016	07/07/2017	510.000.00	543,792.56	540,326.19	(3,466.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	31/01/2017	2,210.000.00	2,411,182.46	2,407,707.37	(3,475.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/01/2017	4,430.000.00	4,839,013.95	4,835,517.07	(3,496.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2016	03/05/2017	480.000.00	517,977.27	514,479.30	(3,497.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	26/06/2017	370.000.00	396,317.44	392,775.83	(3,541.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	24/01/2017	760.000.00	832,467.51	828,911.33	(3,556.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	06/12/2016	05/01/2017	1,260.000.00	1,251,853.18	1,248,282.22	(3,570.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	19/06/2017	220.000.00	237,455.61	233,835.43	(3,620.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	09/12/2016	07/02/2017	210.000.00	223,528.07	219,888.66	(3,639.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2016	11/04/2017	450.000.00	487,868.48	484,208.20	(3,660.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	02/12/2016	28/02/2017	410.000.00	441,004.65	437,328.46	(3,676.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	07/03/2017	300.000.00	328,742.12	325,019.42	(3,722.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

S.- Contratos de compra forward (continuación)
a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	28/12/2016	26/06/2017	90.000.00	99,296.27	95,540.07	(3,756.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	07/03/2017	630.000.00	686,324.04	682,540.79	(3,783.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	25/10/2016	23/01/2017	8,060.000.00	8,020,749.58	8,016,941.05	(3,808.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	14/03/2017	360.000.00	393,415.47	389,586.82	(3,828.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	01/02/2017	2,220.000.00	2,422,081.45	2,418,217.45	(3,864.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/08/2016	23/08/2017	170.000.00	182,479.24	178,888.33	(3,590.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	15/11/2016	08/02/2017	4,110.000.00	4,306,819.53	4,302,916.13	(3,903.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	29/06/2017	90.000.00	99,429.88	95,488.69	(3,940.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	20/02/2017	90.000.00	101,728.79	97,739.66	(3,989.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/08/2016	04/08/2017	170.000.00	183,197.46	179,202.96	(3,994.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	12/12/2016	11/01/2017	2,230.000.00	2,216,273.97	2,212,203.15	(4,070.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/08/2016	17/08/2017	170.000.00	182,853.25	178,782.42	(4,070.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	270.000.00	296,253.42	292,096.58	(4,156.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	28/11/2016	27/01/2017	390.000.00	422,382.95	418,200.63	(4,182.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	20/12/2016	19/01/2017	6,080.000.00	6,046,356.16	6,042,171.75	(4,184.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/09/2016	15/03/2017	610.000.00	664,218.28	660,027.57	(4,190.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	17/11/2016	17/01/2017	450.000.00	475,700.34	471,490.97	(4,209.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	05/12/2016	02/01/2017	4,100.000.00	4,060,777.77	4,056,462.10	(4,309.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	25/01/2017	120.000.00	135,170.63	130,859.95	(4,310.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	23/01/2017	1,120.000.00	1,226,110.25	1,221,747.53	(4,362.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	28/03/2017	440.000.00	479,460.81	475,094.71	(4,366.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	20/02/2017	510.000.00	558,227.33	553,858.06	(4,369.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	10/01/2017	11,550.000.00	12,629,659.59	12,625,278.59	(4,381.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	13/02/2017	230.000.00	254,482.73	250,057.99	(4,424.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2016	24/01/2017	130.000.00	146,226.88	141,787.46	(4,439.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	230.000.00	255,840.12	251,372.64	(4,467.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2016	31/01/2017	2,650.000.00	2,891,538.37	2,887,069.92	(4,468.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/01/2017	120.000.00	135,446.81	130,818.38	(4,628.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	10/02/2017	1,980.000.00	2,158,339.89	2,153,701.97	(4,638.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	10,640.000.00	11,633,369.31	11,628,716.74	(4,652.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	02/05/2017	250.000.00	272,673.49	268,005.54	(4,667.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	22/11/2016	24/01/2017	1,870.000.00	2,053,728.52	2,049,049.68	(4,678.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	27/03/2017	460.000.00	501,538.94	496,769.60	(4,769.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/03/2017	130.000.00	145,160.91	140,391.41	(4,769.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/07/2016	11/01/2017	1,260.000.00	1,254,739.73	1,249,944.38	(4,795.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	13/03/2017	360.000.00	394,455.45	389,649.18	(4,806.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	13/01/2017	130.000.00	146,846.57	142,035.15	(4,811.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2016	20/01/2017	2,220.000.00	2,427,757.00	2,422,831.71	(4,925.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	29/03/2017	1,460.000.00	1,581,164.77	1,576,197.75	(4,967.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	27/09/2016	27/03/2017	490.000.00	534.204.72	529.167.62	(5.037.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/11/2016	08/05/2017	1.260.000.00	1.354.419.44	1.349.309.35	(5.110.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/08/2016	20/02/2017	260.000.00	287.483.41	282.359.01	(5.124.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	15/05/2017	140.000.00	154.889.31	149.736.78	(5.152.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	16/01/2017	550.000.00	605.791.10	600.632.16	(5.158.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	21/12/2016	20/01/2017	10.130.000.00	10.074.383.55	10.069.200.87	(5.182.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	14/11/2016	13/01/2017	1.530.000.00	1.523.671.23	1.518.462.38	(5.208.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	21/03/2017	190.000.00	210.705.85	205.384.90	(5.320.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	04/10/2016	03/01/2017	420.000.00	460.456.95	455.003.64	(5.453.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	13/03/2017	440.000.00	481.759.44	476.237.88	(5.521.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	28/11/2016	01/03/2017	720.000.00	773.359.46	767.755.59	(5.603.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	12/01/2017	2.670.000.00	2.923.257.12	2.917.645.97	(5.611.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/08/2016	01/03/2017	850.000.00	927.436.64	921.771.72	(5.664.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	12/12/2016	11/01/2017	6.090.000.00	6.047.095.89	6.041.397.84	(5.698.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/07/2016	05/01/2017	4.220.000.00	4.186.487.67	4.180.754.74	(5.732.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	14/02/2017	790.000.00	864.520.72	858.758.00	(5.762.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	26/01/2017	1.330.000.00	1.456.059.20	1.450.134.10	(5.925.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/08/2016	15/02/2017	850.000.00	929.761.30	923.832.90	(5.928.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	10/11/2016	08/02/2017	580.000.00	640.327.81	634.376.15	(5.951.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	1.430.000.00	1.568.856.98	1.562.882.04	(5.974.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	14/02/2017	1.030.000.00	1.125.625.68	1.119.646.50	(5.979.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2016	31/01/2017	3.980.000.00	4.342.067.88	4.336.052.19	(6.015.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/08/2016	17/02/2017	1.000.000.00	1.092.568.04	1.086.515.82	(6.052.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	02/12/2016	10/03/2017	1.340.000.00	1.432.954.93	1.426.872.52	(6.082.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	13/01/2017	3.140.000.00	3.122.413.42	3.116.321.49	(6.091.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/08/2016	22/02/2017	850.000.00	928.960.61	922.802.31	(6.158.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2016	24/01/2017	3.480.000.00	3.801.720.87	3.795.541.36	(6.179.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/12/2016	03/01/2017	1.930.000.00	1.915.717.95	1.909.505.33	(6.212.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/09/2016	16/03/2017	80.000.00	92.831.78	86.547.14	(6.284.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/08/2016	03/08/2017	280.000.00	301.521.37	295.211.09	(6.310.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/09/2016	27/03/2017	250.000.00	276.319.93	269.983.48	(6.336.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	21/10/2016	19/01/2017	2.570.000.00	2.560.410.96	2.554.010.10	(6.400.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	07/07/2016	05/01/2017	4.760.000.00	4.722.324.47	4.715.732.83	(6.591.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	23/05/2017	1.400.000.00	1.501.864.15	1.495.236.55	(6.627.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	15/02/2017	4.570.000.00	4.973.602.76	4.966.960.39	(6.642.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	03/10/2016	04/01/2017	260.000.00	288.107.17	281.450.69	(6.656.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	13/01/2017	2.750.000.00	3.011.289.63	3.004.589.75	(6.699.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	2.670.000.00	2.915.658.09	2.908.859.13	(6.798.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	21/02/2017	6.340.000.00	6.891.035.93	6.884.117.72	(6.918.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12/12/2016	09/06/2017	110.000.00	1.25.259.40	118.310.12	(6.949.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/06/2017	1.090.000.00	1.165.550.92	1.158.548.27	(7.002.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	1,950,000.00	2,131,518.88	2,124,447.68	(7,071.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	09/02/2017	1,070,000.00	1,171,142.60	1,164,054.58	(7,088.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/12/2016	03/01/2017	4,580,000.00	4,538,650.68	4,531,364.98	(7,285.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	01/12/2016	01/02/2017	1,880,000.00	1,977,610.07	1,970,226.35	(7,383.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/09/2016	29/03/2017	130,000.00	147,804.57	140,346.38	(7,458.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	07/02/2017	1,070,000.00	1,171,888.13	1,164,425.25	(7,462.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/09/2016	17/03/2017	760,000.00	829,530.96	822,066.16	(7,464.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	11/04/2017	660,000.00	717,685.15	710,172.03	(7,513.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	26/10/2017	200,000.00	214,266.56	206,632.06	(7,634.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	18/09/2017	490,000.00	520,046.39	512,330.31	(7,716.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	10/10/2016	09/01/2017	3,090,000.00	3,071,802.74	3,063,981.04	(7,821.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	14/10/2016	12/01/2017	4,120,000.00	4,096,164.38	4,089,025.55	(8,138.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2016	12/10/2017	620,000.00	650,647.46	642,360.97	(8,286.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	30/06/2016	09/03/2017	1,200,000.00	1,215,667.20	1,207,005.25	(8,661.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	24/04/2017	630,000.00	685,137.09	676,333.02	(8,804.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/08/2016	10/02/2017	1,020,000.00	1,118,765.34	1,109,482.84	(9,282.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	28/02/2017	1,520,000.00	1,658,116.90	1,648,608.00	(9,508.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/10/2016	05/04/2017	520,000.00	569,634.57	560,123.18	(9,511.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	07/12/2016	06/01/2017	1,300,000.00	1,438,977.46	1,429,433.75	(9,543.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/04/2017	1,330,000.00	1,440,667.96	1,431,104.24	(9,563.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/01/2017	10,650,000.00	11,645,580.81	11,635,956.66	(9,624.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	08/03/2017	3,110,000.00	3,378,600.79	3,368,829.33	(9,771.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/10/2016	04/04/2017	490,000.00	538,646.71	528,488.64	(10,158.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2016	20/04/2017	1,800,000.00	1,944,024.66	1,933,750.14	(10,274.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/09/2016	04/09/2017	240,000.00	261,961.22	251,576.66	(10,384.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/08/2016	28/02/2017	1,030,000.00	1,127,542.75	1,117,148.84	(10,393.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	13/03/2017	1,790,000.00	1,948,097.65	1,937,422.30	(10,675.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	6,440,000.00	7,026,848.65	7,016,124.64	(10,724.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/09/2016	21/03/2017	320,000.00	356,831.81	345,911.41	(10,920.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2016	03/04/2017	480,000.00	529,140.82	517,786.30	(11,354.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/10/2016	05/04/2017	580,000.00	636,266.30	624,752.78	(11,513.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/09/2016	28/03/2017	390,000.00	433,035.91	421,106.68	(11,929.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/08/2016	07/02/2017	1,360,000.00	1,492,238.36	1,480,017.14	(12,221.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2016	02/11/2017	550,000.00	579,694.05	567,439.05	(12,255.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	31/12/2016	04/01/2017	200,000.00	211,164.38	198,893.00	(12,271.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	22/05/2017	1,140,000.00	1,230,091.45	1,217,766.69	(12,324.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/09/2016	20/03/2017	840,000.00	920,563.83	908,162.95	(12,400.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BA0118	29/09/2016	28/03/2017	190.000.00	201.829.99	189.300.31	(12.529.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	11/01/2017	17.680.000.00	19.335.563.75	19.322.905.26	(12.658.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	22/11/2016	22/05/2017	180.000.00	207.074.51	194.079.61	(12.994.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/12/2016	03/01/2017	7.630.000.00	7.562.044.53	7.548.977.03	(13.067.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/01/2017	6.940.000.00	7.583.621.45	7.570.471.32	(13.150.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/09/2016	27/03/2017	840.000.00	920.586.21	907.144.49	(13.441.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	15/02/2017	8.010.000.00	8.719.521.01	8.705.766.47	(13.754.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	14/02/2017	1.240.000.00	1.362.250.95	1.347.923.94	(14.327.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/09/2016	28/03/2017	850.000.00	932.284.63	917.796.60	(14.488.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	24/01/2017	11.390.000.00	12.437.280.86	12.422.763.23	(14.517.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/09/2016	01/03/2017	840.000.00	925.523.55	910.927.35	(14.596.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/09/2016	01/03/2017	1.380.000.00	1.511.748.53	1.496.523.50	(15.225.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	19/09/2016	17/01/2017	5.050.000.00	5.031.811.48	5.016.359.55	(15.457.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	04/08/2016	01/05/2017	210.000.00	244.634.03	228.691.07	(15.942.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/09/2016	10/03/2017	1.180.000.00	1.293.827.97	1.277.796.57	(16.031.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	21/02/2017	1.760.000.00	1.927.363.83	1.911.048.45	(16.315.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/08/2016	28/02/2017	1.010.000.00	1.112.059.52	1.095.456.63	(16.602.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/09/2016	07/03/2017	1.380.000.00	1.512.492.56	1.495.089.34	(17.403.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	31/03/2017	5.340.000.00	5.780.983.31	5.763.147.39	(17.835.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2016	17/10/2017	570.000.00	607.835.10	589.966.13	(17.868.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	06/03/2017	5.860.000.00	6.367.828.74	6.349.727.71	(18.101.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/10/2016	01/02/2017	1.100.000.00	1.216.697.44	1.198.215.85	(18.481.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2016	28/07/2017	1.090.000.00	1.169.434.10	1.150.459.10	(18.975.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	11/10/2016	11/04/2017	330.000.00	370.693.28	351.411.13	(19.282.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/09/2016	16/03/2017	1.770.000.00	1.934.192.56	1.914.855.39	(19.337.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/01/2017	15.890.000.00	17.380.664.62	17.361.065.85	(19.598.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	20/09/2016	20/03/2017	270.000.00	307.594.90	286.978.41	(20.616.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	27/07/2017	1.020.000.00	1.097.604.08	1.076.770.50	(20.833.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0119	19/12/2016	13/01/2017	330.000.00	384.706.88	363.818.20	(20.888.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	28/12/2017	800.000.00	837.487.22	816.067.30	(21.419.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	10/01/2017	11.550.000.00	12.646.755.49	12.625.278.59	(21.476.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/02/2016	09/02/2017	2.230.000.00	2.447.757.71	2.426.020.30	(21.737.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0219	14/09/2016	13/03/2017	310.000.00	343.567.40	321.270.39	(22.297.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	22/12/2016	22/03/2017	350.000.00	408.230.82	383.737.95	(24.492.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	08/12/2016	10/03/2017	5.920.000.00	6.364.507.10	6.339.175.91	(25.331.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/06/2016	09/06/2017	1.290.000.00	1.399.346.51	1.373.580.65	(25.765.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	14/03/2017	8.880.000.00	9.636.098.65	9.609.808.29	(26.290.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/07/2016	28/07/2017	1.020.000.00	1.103.137.40	1.076.576.41	(26.560.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/09/2016	01/03/2017	2.540.000.00	2.782.200.96	2.754.470.79	(27.730.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	14/09/2016	12/01/2017	10.820.000.00	10.764.000.33	10.736.028.27	(27.972.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE011	27/10/2016	25/04/2017	680.000.00	713.406.17	685.152.31	(28.253.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN **31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016** *(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)*

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE0118	28/12/2016	28/03/2017	450.000.00	494.734.12	466.325.46	(28.408.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	09/01/2017	2.730.000.00	3.013.063.41	2.984.629.62	(28.433.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	04/04/2017	6.660.000.00	7.212.055.67	7.183.131.37	(28.924.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/11/2016	17/05/2017	500.000.00	521.767.00	492.423.14	(29.343.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	29/11/2016	28/02/2017	360.000.00	414.445.72	383.995.72	(30.450.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	08/03/2017	7.340.000.00	7.982.045.26	7.950.870.51	(31.174.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	15/02/2017	16.740.000.00	18.225.304.55	18.194.073.74	(31.230.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	09/12/2016	11/01/2017	37.400.000.00	37.134.453.64	37.101.523.66	(32.929.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	09/12/2016	11/01/2017	37.400.000.00	37.134.453.64	37.101.523.66	(32.929.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	29/05/2017	4.280.000.00	4.600.758.37	4.566.265.14	(34.493.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	15/02/2017	21.460.000.00	23.363.816.73	23.324.063.47	(39.753.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	13/12/2016	12/01/2017	32.480.000.00	35.157.545.32	35.116.065.78	(41.479.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	01/02/2016	31/01/2017	500.000.00	525.607.86	482.591.60	(43.016.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	18/07/2017	3.270.000.00	3.508.622.17	3.457.599.74	(51.022.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	07/04/2017	3.790.000.00	4.132.092.13	4.080.993.86	(51.098.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	05/04/2017	570.000.00	658.441.06	606.513.08	(51.927.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/10/2016	19/10/2017	2.520.000.00	2.662.297.53	2.607.225.22	(55.072.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	28/09/2016	27/03/2017	750.000.00	860.990.01	800.744.50	(60.245.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	30/11/2016	24/11/2017	360.000.00	441.516.41	376.366.34	(65.150.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	20/12/2016	19/01/2017	870.000.00	1.005.344.93	939.655.53	(65.689.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	19/12/2016	16/06/2017	1.000.000.00	1.285.430.71	1.217.797.24	(67.633.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2016	10/03/2017	1.060.000.00	1.205.322.46	1.132.977.43	(72.345.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BA0118	28/12/2016	27/01/2017	1.740.000.00	1.810.119.89	1.736.986.51	(73.133.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	06/09/2016	06/03/2017	920.000.00	1.035.741.09	959.964.30	(75.776.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	01/02/2016	31/01/2017	400.000.00	466.060.10	386.073.28	(79.986.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	18/07/2016	13/01/2017	1.600.000.00	1.840.129.31	1.757.527.76	(82.601.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	14/03/2017	1.270.000.00	1.452.143.17	1.358.984.04	(93.159.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	15/12/2016	13/01/2017	1.310.000.00	1.510.726.02	1.416.338.82	(94.387.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/07/2016	20/01/2017	1.110.000.00	1.311.085.48	1.211.415.85	(99.669.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16/12/2016	16/01/2017	3.800.000.00	3.888.384.92	3.776.422.39	(111.962.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	13/01/2017	1.590.000.00	1.832.571.24	1.719.067.73	(113.503.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/08/2016	20/02/2017	1.360.000.00	1.604.214.88	1.476.954.82	(127.260.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/10/2016	01/02/2017	8.530.000.00	9.419.832.87	9.291.619.31	(128.213.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	15/12/2016	13/01/2017	2.010.000.00	2.317.177.54	2.173.161.10	(144.016.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	26/12/2016	25/01/2017	2.040.000.00	2.345.245.44	2.201.064.07	(144.181.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	02/11/2016	01/05/2017	1.880.000.00	2.201.185.50	2.053.219.07	(147.966.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CIE618	02/12/2016	31/05/2017	1,740,000.00	1,981,632.58	1,833,514.80	(148,117.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	26/12/2016	26/01/2017	6,600,000.00	6,707,184.00	6,555,866.49	(151,817.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/12/2016	15/03/2017	3,400,000.00	3,527,700.60	3,369,443.16	(158,257.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE011	11/11/2016	09/02/2017	3,320,000.00	3,528,944.13	3,364,056.74	(164,887.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	31/08/2016	28/02/2017	2,050,000.00	2,366,590.48	2,186,642.29	(179,948.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/08/2016	28/02/2017	2,120,000.00	2,483,868.19	2,299,374.32	(184,493.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	15/12/2016	13/01/2017	7,600,000.00	9,668,441.08	9,476,548.00	(191,893.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	28/12/2016	27/01/2017	2,610,000.00	3,008,277.55	2,815,100.82	(193,176.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE011	27/12/2016	26/01/2017	3,950,000.00	4,208,486.37	4,006,614.67	(201,871.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	09/12/2016	10/01/2017	7,500,000.00	7,667,256.53	7,461,234.44	(206,022.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/09/2016	27/03/2017	2,580,000.00	3,015,496.83	2,786,229.50	(229,267.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	26/12/2016	27/01/2017	9,300,000.00	9,579,902.10	9,333,324.76	(246,577.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/09/2016	10/03/2017	14,770,000.00	16,241,209.69	15,994,114.71	(247,094.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	27/12/2016	06/01/2017	19,800,000.00	19,974,300.87	19,688,197.05	(286,103.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	14/03/2017	3,700,000.00	4,247,978.18	3,959,244.85	(288,733.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	08/11/2016	06/02/2017	26,700,000.00	26,815,844.93	26,510,421.65	(305,423.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	19/09/2016	17/03/2017	2,800,000.00	3,088,043.81	2,771,641.01	(316,402.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20/01/2016	19/01/2017	2,300,000.00	2,603,928.35	2,285,344.31	(318,584.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	08/12/2016	06/02/2017	5,100,000.00	5,389,852.23	5,063,788.40	(326,063.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0720	26/12/2016	27/01/2017	4,000,000.00	5,010,958.88	4,666,212.53	(344,746.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	30/11/2016	29/05/2017	4,350,000.00	5,096,167.78	4,714,672.56	(383,495.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE618	02/12/2016	31/05/2017	4,340,000.00	4,958,429.87	4,573,249.56	(385,180.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	10/10/2016	09/01/2017	52,570,000.00	55,683,609.89	55,275,123.81	(408,486.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	13/12/2016	27/01/2017	13,200,000.00	13,503,165.44	13,090,024.25	(413,141.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	12/12/2016	11/01/2017	13,100,000.00	13,476,087.90	13,045,201.53	(430,886.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0729	12/12/2016	11/01/2017	4,900,000.00	5,335,398.27	4,902,783.92	(432,614.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	09/12/2016	07/02/2017	6,600,000.00	7,028,991.82	6,552,625.52	(476,366.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	09/01/2017	57,050,000.00	62,882,042.36	62,371,106.07	(510,936.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	29/12/2016	29/03/2017	14,500,000.00	14,861,781.06	14,309,523.25	(552,257.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0729	31/08/2016	28/02/2017	5,100,000.00	5,692,028.40	5,080,977.83	(611,050.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0222	15/12/2016	30/03/2017	7,400,000.00	9,751,587.69	9,121,581.10	(630,006.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	08/12/2016	10/03/2017	20,200,000.00	20,675,023.20	20,026,158.40	(648,864.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	01/12/2016	30/05/2017	7,580,000.00	8,673,838.19	8,003,041.83	(670,796.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	03/11/2016	01/02/2017	81,850,000.00	81,237,571.89	80,483,362.78	(754,209.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	14/03/2017	12,720,000.00	14,458,567.06	13,611,241.75	(847,325.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0126	07/12/2016	10/01/2017	47,200,000.00	47,906,395.20	46,956,035.42	(950,359.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE011	13/12/2016	27/01/2017	19,820,000.00	21,085,677.35	20,102,572.14	(983,105.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH1226	08/12/2016	10/03/2017	26,500,000.00	27,176,100.33	26,191,546.87	(984,553.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	21/12/2016	20/01/2017	14,860,000.00	17,097,343.59	16,046,997.23	(1,050,346.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/12/2016	30/03/2017	56,000,000.00	56,618,909.20	55,259,954.66	(1,358,954.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	10/10/2016	09/01/2017	61,800,000.00	62,987,927.49	61,484,621.05	(1,513,306.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/12/2016	15/03/2017	18,100,000.00	19,623,880.99	18,008,179.46	(1,615,701.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0223	03/11/2016	01/02/2017	34,900,000.00	41,049,077.42	39,405,108.54	(1,643,968.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	08/11/2016	06/02/2017	22,000,000.00	23,873,234.00	22,058,708.10	(1,814,525.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	21/12/2016	20/01/2017	20,200,000.00	22,010,338.87	20,195,197.96	(1,815,140.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	15/12/2016	30/03/2017	22,900,000.00	24,661,557.08	22,753,071.80	(1,908,485.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	25/10/2016	24/04/2017	24,200,000.00	26,442,560.76	23,990,558.38	(2,452,002.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	26/12/2016	27/01/2017	55,600,000.00	60,629,405.31	55,551,933.00	(5,077,472.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	148,463,387.50	148,833,560.98	370,173.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	148,463,387.50	148,833,560.98	370,173.48	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	26/06/2017	6,300,000.00	6,583,675.74	6,687,804.69	104,128.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	4,170,000.00	4,453,326.23	4,511,991.75	58,665.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	09/01/2017	4,950,000.00	4,857,027.35	4,908,319.14	51,291.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	22/03/2017	2,750,000.00	2,938,269.72	2,972,199.88	33,930.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/03/2017	2,510,000.00	2,680,733.95	2,710,634.13	29,900.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	27/01/2017	2,300,000.00	2,490,538.20	2,507,352.31	16,814.11	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2016	01/02/2017	1,150,000.00	1,242,611.41	1,252,680.21	10,068.80	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	24/02/2017	1,310,000.00	1,413,353.53	1,421,747.40	8,393.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	06/02/2017	880,000.00	951,379.85	957,810.57	6,430.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	24/01/2017	310,000.00	332,719.20	338,108.57	5,389.37	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/09/2016	28/03/2017	90,000.00	93,103.18	97,178.46	4,075.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2016	04/01/2017	6,330,000.00	6,926,502.55	6,925,886.96	(615.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	10/10/2016	09/01/2017	4,560,000.00	4,523,781.46	4,521,603.09	(2,178.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	22/02/2017	1,380,000.00	1,500,519.52	1,498,196.69	(2,322.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	28/12/2016	27/01/2017	150,000.00	161,433.06	157,562.69	(3,870.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	22/02/2017	510,000.00	557,639.94	553,681.39	(3,958.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	16/05/2017	2,450,000.00	2,625,103.96	2,619,927.42	(5,176.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	22/02/2017	1,420,000.00	1,547,587.90	1,541,622.68	(5,965.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/09/2016	14/09/2017	340,000.00	361,782.05	355,753.29	(6,028.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	22/02/2017	1,930,000.00	2,101,505.77	2,095,304.07	(6,201.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	12/04/2017	1,970,000.00	2,128,536.20	2,119,381.04	(9,155.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	2,950,000.00	3,203,188.47	3,191,936.61	(11,251.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2016	07/02/2017	9,300,000.00	10,134,795.27	10,120,705.41	(14,089.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	22/05/2017	13,060,000.00	13,965,669.86	13,950,906.16	(14,763.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
LC0217	15/09/2016	13/01/2017	5,260,000.00	5,238,864.69	5,220,334.73	(18,529.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2016	15/02/2017	9,830,000.00	10,704,355.34	10,683,855.73	(20,499.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/12/2016	06/03/2017	7,350,000.00	7,985,133.59	7,964,248.92	(20,884.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	25/11/2016	24/01/2017	22,550,000.00	22,458,688.40	22,434,489.00	(24,199.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2016	13/10/2017	1,010,000.00	1,073,794.18	1,046,217.12	(27,577.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/10/2016	05/01/2017	7,000,000.00	6,993,882.00	6,966,112.08	(27,769.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	03/10/2016	03/01/2017	15,260,000.00	15,128,638.56	15,097,954.06	(30,684.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16/12/2016	16/01/2017	4,100,000.00	4,107,592.59	4,074,561.00	(33,031.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	14/09/2016	12/01/2017	15,590,000.00	15,513,075.51	15,469,009.31	(44,066.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	22/11/2016	20/02/2017	13,050,000.00	14,431,198.77	14,386,248.76	(44,950.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	28/09/2016	27/03/2017	1,000,000.00	1,141,583.67	1,086,883.56	(54,700.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/09/2016	17/03/2017	4,510,000.00	4,943,056.09	4,878,313.64	(64,742.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2016	06/02/2017	4,400,000.00	4,437,751.05	4,368,758.62	(68,992.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	07/11/2016	01/02/2017	9,500,000.00	9,603,835.00	9,530,494.72	(73,340.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	27/06/2017	15,290,000.00	16,306,060.32	16,228,286.31	(77,774.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	09/12/2016	07/02/2017	3,100,000.00	3,164,758.59	3,076,959.95	(87,798.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/12/2016	24/02/2017	4,900,000.00	4,947,149.17	4,858,360.76	(88,788.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	12/04/2017	15,750,000.00	17,039,764.62	16,944,290.04	(95,474.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20/12/2016	19/01/2017	4,900,000.00	4,974,412.52	4,868,777.01	(105,635.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	06/12/2016	03/02/2017	4,300,000.00	4,373,833.41	4,261,803.66	(112,029.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	04/11/2016	02/02/2017	4,600,000.00	5,851,714.19	5,720,028.75	(131,685.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/10/2016	06/10/2017	2,300,000.00	2,379,048.06	2,232,738.06	(146,310.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	07/12/2016	03/03/2017	7,000,000.00	7,100,604.98	6,938,599.34	(162,005.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2016	05/01/2017	11,600,000.00	11,805,559.54	11,610,089.60	(195,469.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2016	14/03/2017	16,500,000.00	16,546,627.19	16,336,727.65	(209,899.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	25/11/2016	26/01/2017	2,900,000.00	3,120,333.30	2,881,885.76	(238,447.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	02/12/2016	04/01/2017	8,800,000.00	9,052,559.69	8,808,330.62	(244,229.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	04/11/2016	09/01/2017	11,500,000.00	11,360,458.43	11,115,307.05	(245,151.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	26/12/2016	25/01/2017	13,300,000.00	13,469,639.01	13,210,798.89	(258,840.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0923	27/10/2016	25/01/2017	19,750,000.00	19,700,968.80	19,430,634.65	(270,334.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	06/12/2016	05/01/2017	12,300,000.00	12,163,771.05	11,891,598.96	(272,172.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	11/10/2016	10/04/2017	11,500,000.00	12,115,974.96	11,832,004.30	(283,970.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/07/2016	18/01/2017	4,000,000.00	4,269,930.36	3,977,499.26	(292,431.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	23/12/2016	23/03/2017	18,700,000.00	18,795,214.79	18,501,891.46	(293,323.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	02/12/2016	04/01/2017	9,000,000.00	9,304,653.06	9,008,519.95	(296,133.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20/12/2016	17/02/2017	20,300,000.00	20,463,730.97	20,137,797.01	(325,933.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	27/12/2016	27/03/2017	4,200,000.00	5,207,482.90	4,855,147.28	(352,335.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/11/2016	13/01/2017	12,000,000.00	12,339,708.00	11,947,972.75	(391,735.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/12/2016	20/02/2017	23,800,000.00	24,003,145.38	23,605,143.45	(398,001.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/10/2016	21/04/2017	3,900,000.00	4,267,495.01	3,867,294.64	(400,200.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	28/12/2016	28/03/2017	14,200,000.00	14,455,302.23	14,044,052.32	(411,249.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00126	25/10/2016	23/01/2017	4,800,000.00	5,221,683.12	4,771,135.80	(450,547.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	03/11/2016	01/02/2017	5,300,000.00	5,748,844.81	5,293,045.23	(455,799.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00720	07/12/2016	07/02/2017	5,200,000.00	6,514,941.16	6,055,832.95	(459,108.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	16/11/2016	13/01/2017	6,200,000.00	6,760,863.48	6,202,412.20	(558,451.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00720	01/12/2016	01/02/2017	6,800,000.00	8,508,086.63	7,926,472.60	(581,614.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	31/05/2016	27/03/2017	20,500,000.00	20,917,974.50	20,297,000.88	(620,973.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	31/05/2016	27/03/2017	20,500,000.00	20,917,974.50	20,297,000.88	(620,973.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	31/05/2016	27/03/2017	20,500,000.00	20,917,974.50	20,297,000.88	(620,973.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	31/05/2016	27/03/2017	20,500,000.00	20,917,974.50	20,297,000.88	(620,973.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/10/2016	05/04/2017	13,300,000.00	13,888,283.21	13,145,675.60	(742,607.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	28/11/2016	28/02/2017	9,600,000.00	10,300,819.76	9,515,439.77	(785,379.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/12/2016	06/02/2017	25,300,000.00	25,867,420.30	25,069,284.91	(798,135.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	02/11/2016	10/04/2017	11,500,000.00	12,780,840.10	11,832,004.30	(948,835.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/12/2016	07/02/2017	13,200,000.00	14,058,743.42	13,105,251.04	(953,492.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/11/2016	13/02/2017	10,200,000.00	11,060,607.66	10,101,360.41	(959,247.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	21/10/2016	19/04/2017	11,600,000.00	12,471,755.98	11,504,799.89	(966,956.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	23/11/2016	24/01/2017	10,400,000.00	11,308,347.54	10,315,809.99	(992,537.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	02/12/2016	10/01/2017	47,300,000.00	48,185,897.31	47,055,518.54	(1,130,378.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	12/12/2016	11/01/2017	13,200,000.00	14,440,784.95	13,207,499.55	(1,233,285.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	09/12/2016	09/03/2017	17,600,000.00	18,671,108.37	17,432,675.00	(1,238,433.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/10/2016	27/03/2017	48,000,000.00	48,769,714.83	47,476,579.55	(1,293,135.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/10/2016	27/03/2017	48,000,000.00	48,769,714.83	47,476,579.55	(1,293,135.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	07/10/2016	27/03/2017	48,000,000.00	48,769,714.83	47,476,579.55	(1,293,135.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	30/12/2016	30/03/2017	18,080,000.00	21,192,855.73	19,796,087.18	(1,396,768.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	20/12/2016	19/01/2017	21,500,000.00	22,976,710.95	21,377,389.32	(1,599,321.63)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29/11/2016	28/02/2017	24,300,000.00	25,788,924.40	24,085,956.93	(1,702,967.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	11/11/2016	10/01/2017	19,000,000.00	20,576,214.16	18,867,143.55	(1,709,070.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	22/12/2016	22/03/2017	21,600,000.00	23,364,056.23	21,476,885.45	(1,887,170.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	01/09/2016	02/02/2017	76,040,000.00	77,618,366.84	75,507,214.26	(2,111,152.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	27/12/2016	13/03/2017	29,400,000.00	31,632,120.91	29,256,120.06	(2,376,000.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	04/03/2016	28/02/2017	30,900,000.00	33,356,024.08	30,627,821.77	(2,728,202.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	18/11/2016	19/01/2017	43,800,000.00	47,014,164.45	43,793,509.57	(3,220,654.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0623	11/10/2016	09/01/2017	47,760,000.00	50,958,035.87	47,301,009.55	(3,657,026.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	28/11/2016	27/01/2017	114,800,000.00	117,528,987.72	113,843,544.22	(3,685,443.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	25/11/2016	24/01/2017	43,300,000.00	47,153,625.56	43,274,197.95	(3,879,427.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	29/03/2016	29/03/2017	28,600,000.00	32,234,429.08	28,283,687.73	(3,950,741.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	29/11/2016	28/02/2017	86,800,000.00	93,353,838.17	86,476,250.08	(6,877,588.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	18/04/2016	18/04/2017	88.200.000.00	101,423,775.73	87,087,565.43	(14,336,210.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0122	29/12/2016	28/02/2017	161.820.000.00	158,560,243.21	161,048,315.15	2,488,071.94	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0923	21/10/2016	19/01/2017	46,330.000.00	45,138,829.09	45,601,731.69	462,902.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	18/11/2016	05/01/2017	30,900.000.00	32,276,599.63	32,508,658.16	232,058.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	20/12/2016	03/01/2017	500.000.00	590,203.00	585,564.50	(4,638.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	17/11/2016	17/03/2017	8,540.000.00	9,397,430.17	8,886,021.16	(511,409.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2016	26/01/2017	53,300.000.00	53,705,285.77	52,967,072.71	(738,213.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2016	26/01/2017	44,400.000.00	44,918,901.02	44,122,664.69	(796,236.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/11/2016	05/01/2017	27,500.000.00	28,208,447.50	27,397,547.53	(808,899.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	28/12/2016	24/03/2017	30,200.000.00	30,909,022.61	30,022,459.32	(886,563.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	15/11/2016	15/03/2017	38,510.000.00	42,317,888.32	40,083,183.54	(2,234,704.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	18/11/2016	05/01/2017	48,100.000.00	51,473,403.07	47,782,607.03	(3,690,796.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	22/09/2016	21/03/2017	74,000.000.00	81,244,614.04	73,584,844.73	(7,659,769.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	21/12/2016	20/01/2017	87,090.000.00	93,824,324.82	94,046,634.49	222,309.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	03/02/2017	4,160.000.00	4,503,738.17	4,529,993.42	26,255.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	27/01/2017	4,220.000.00	4,574,993.75	4,600,446.42	25,452.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/01/2017	4,550.000.00	4,970,114.89	4,963,349.35	(6,765.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	19/12/2016	20/03/2017	27,240.000.00	28,963,427.87	28,956,275.29	(7,152.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2016	27/01/2017	8,840.000.00	9,646,074.46	9,636,954.11	(9,120.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	07/02/2017	4,480.000.00	4,885,056.41	4,875,350.56	(9,705.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	29/12/2016	20/02/2017	1,600.000.00	1,625,809.60	1,602,316.36	(23,493.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	18/07/2016	15/05/2017	1,000.000.00	1,070,748.00	985,291.13	(85,456.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/12/2016	11/01/2017	4,700.000.00	4,772,162.07	4,675,398.96	(96,763.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0218	29/12/2016	20/02/2017	12,100.000.00	12,408,066.83	12,293,558.48	(114,508.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	05/12/2016	19/01/2017	7,700.000.00	9,763,731.90	9,593,316.82	(170,415.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	26/12/2016	02/01/2017	9,400.000.00	9,543,296.51	9,358,188.80	(185,107.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	15/11/2016	10/01/2017	6,900.000.00	7,078,641.00	6,871,662.86	(206,978.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	21/11/2016	31/01/2017	6,000.000.00	7,670,641.26	7,462,964.89	(207,676.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	03/10/2016	03/01/2017	10,000.000.00	12,217,917.10	11,965,680.00	(252,237.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16/12/2016	12/01/2017	28,900.000.00	29,145,127.20	28,727,136.81	(417,990.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0111	22/11/2016	20/01/2017	9,460.000.00	10,118,071.20	9,599,897.15	(518,174.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	03/10/2016	03/01/2017	42,100.000.00	46,894,218.33	46,338,375.40	(555,842.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	27/12/2016	13/03/2017	19,500.000.00	24,700,200.72	24,099,706.46	(600,494.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/12/2016	29/03/2017	18,400.000.00	18,965,364.58	18,283,591.71	(681,772.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	23/11/2016	23/01/2017	22,500.000.00	28,708,608.80	28,016,985.63	(691,623.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	16/12/2016	16/01/2017	48,200.000.00	48,595,820.81	47,900,936.69	(694,884.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0223	29/12/2016	01/02/2017	33,200.000.00	38,215,158.80	37,485,662.00	(729,496.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	03/10/2016	16/01/2017	29,200.000.00	29,750,813.75	29,018,824.72	(731,989.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	14/10/2016	12/01/2017	7,900.000.00	10,193,354.20	9,435,576.35	(757,777.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2016	14/03/2017	28,200.000.00	28,717,412.57	27,920,952.71	(796,459.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	06/12/2016	06/03/2017	49,800.000.00	59,855,775.86	59,035,071.64	(820,704.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0729	24/11/2016	22/02/2017	23,200,000.00	23,955,617.05	23,125,931.92	(829,685.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/12/2016	20/02/2017	13,700,000.00	14,512,475.87	13,658,714.96	(853,760.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	10/10/2016	09/01/2017	24,700,000.00	24,733,210.79	23,873,746.46	(859,464.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	27/12/2016	13/03/2017	23,300,000.00	24,087,258.54	23,185,972.70	(901,285.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/11/2016	10/01/2017	48,700,000.00	49,433,733.19	48,448,282.30	(985,450.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/11/2016	13/02/2017	32,300,000.00	33,197,752.01	31,987,641.31	(1,210,110.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	15/11/2016	13/02/2017	38,500,000.00	39,418,387.09	38,200,967.14	(1,217,419.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/12/2016	04/01/2017	43,100,000.00	44,525,978.00	43,140,801.08	(1,385,176.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	19/12/2016	20/03/2017	32,100,000.00	33,323,187.30	31,922,786.65	(1,400,400.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/12/2016	21/02/2017	18,000,000.00	19,278,358.20	17,851,232.01	(1,427,126.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	21/12/2016	10/03/2017	16,000,000.00	20,019,068.32	18,544,508.77	(1,474,559.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	15/11/2016	10/01/2017	78,300,000.00	80,498,507.40	78,679,963.02	(1,818,544.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2016	20/01/2017	21,000,000.00	26,515,572.30	24,523,940.46	(1,991,631.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	30/11/2016	31/01/2017	26,300,000.00	28,553,368.75	26,267,843.52	(2,285,525.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	09/11/2016	10/01/2017	94,300,000.00	97,106,368.00	94,757,605.53	(2,348,762.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	08/11/2016	23/01/2017	94,100,000.00	97,112,141.00	94,465,294.15	(2,646,846.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	11/10/2016	09/01/2017	27,200,000.00	35,356,357.38	32,500,801.96	(2,855,555.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	11/11/2016	25/01/2017	108,400,000.00	111,900,344.40	108,804,618.51	(3,095,725.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	11/07/2016	05/01/2017	42,900,000.00	46,580,292.17	42,616,919.79	(3,963,372.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2016	19/01/2017	46,500,000.00	50,640,697.13	46,493,109.47	(4,147,587.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	15/11/2016	13/02/2017	135,200,000.00	140,040,530.45	134,877,315.81	(5,163,214.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			6,116,870,000.00	6,505,510,826.25	6,322,511,067.15	(182,999,759.10)		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

5.- Contratos de compra forward
a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00427	19/12/2016	18/01/2017	1,556,000.00	1,743,889.91	1,756,736.54	12,846.63	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	19/12/2016	21/03/2017	537,000.00	599,403.43	601,887.87	2,484.44	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	01/02/2016	31/01/2017	3,000.00	2,902.52	3,444.00	541.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00424	20/12/2016	20/03/2017	15,000.00	14,779.56	14,990.23	210.67	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00424	20/12/2016	20/03/2017	5,000.00	4,926.51	4,996.74	70.23	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	06/07/2016	04/01/2017	5,000.00	5,818.60	5,654.00	(164.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00145	30/11/2016	25/04/2017	16,000.00	15,293.60	15,027.10	(266.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00145	09/08/2016	07/02/2017	5,000.00	6,283.23	4,734.79	(1,548.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	05/12/2016	02/06/2017	44,000.00	50,489.03	48,898.31	(1,590.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	06/05/2016	01/05/2017	18,000.00	20,442.67	18,614.32	(1,828.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	29/12/2016	15/03/2017	1,476,000.00	1,658,027.17	1,655,484.36	(2,542.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	05/08/2016	30/01/2017	892,000.00	1,007,134.90	1,024,011.35	16,876.45	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	16/12/2016	16/03/2017	443,000.00	492,740.41	496,812.94	4,072.53	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	27/12/2016	26/06/2017	762,000.00	848,107.85	844,412.82	(3,695.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	27/12/2016	26/06/2017	762,000.00	848,107.85	844,412.82	(3,695.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	12/07/2016	09/01/2017	229,000.00	267,709.67	258,806.60	(8,903.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR2126	19/07/2016	16/01/2017	214,000.00	247,638.02	222,649.63	(24,988.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR2126	19/07/2016	16/01/2017	799,000.00	929,388.81	831,294.63	(98,094.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	30/11/2016	13/01/2017	280,000.00	292,496.30	291,390.26	(1,106.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	12/12/2016	10/02/2017	773,000.00	882,959.72	870,633.16	(12,326.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
DR0126	05/12/2016	16/01/2017	286,000.00	292,086.98	297,559.78	5,472.80	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	19/12/2016	18/01/2017	176,000.00	196,979.74	196,705.42	1,725.68	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00145	27/12/2016	13/01/2017	308,000.00	290,900.25	292,376.59	1,476.34	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	09/12/2016	10/01/2017	98,000.00	110,844.42	110,743.12	(101.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	27/12/2016	26/01/2017	174,000.00	196,696.63	196,269.26	(427.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	19/10/2016	17/01/2017	81,000.00	95,639.83	91,460.02	(4,179.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	07/11/2016	07/02/2017	167,000.00	197,407.65	188,156.92	(9,250.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	27/12/2016	13/01/2017	1,472,000.00	1,674,291.71	1,662,841.76	(11,449.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
			11,596,000.00	12,993,386.97	12,853,005.34	(140,381.63)		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de DOP 46,7111 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

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
MH0326	09/12/2016	31/01/2017	400,000.00	482.773.80	486.768.24	3,994.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	16/11/2016	15/03/2017	38,510,000.00	42,838.037.01	42,983.870.19	145,833.18	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	27/07/2017	120,000.00	127,309.71	130,305.56	2,995.85	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	24/11/2016	26/01/2017	44,400,000.00	45,077.646.23	44,891.999.17	(185,647.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	29/11/2016	26/01/2017	98,400,000.00	101,953.703.87	102,097.896.13	144,192.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00126	01/12/2016	26/01/2017	53,300,000.00	53,895.851.52	53,845.515.99	(50,335.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	05/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	151,795.408.05	151,640.210.13	(155,197.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	05/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	151,795.408.05	151,640.210.13	(155,197.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	15/12/2016	11/01/2017	3,460,000.00	3,992.048.85	3,986.095.07	(5,953.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	22/12/2016	26/01/2017	59,500,000.00	61,846.337.04	61,788.576.23	(57,760.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	28/12/2016	13/01/2017	110,780,000.00	105,775.708.96	105,329.142.66	(446,566.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	28/12/2016	13/01/2017	110,780,000.00	105,785.257.23	105,338.650.62	(446,606.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	29/12/2016	28/02/2017	161,820,000.00	165,241.414.14	165,998.679.60	757,265.46	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			931,480,000.00	990,606,904.46	990,157,919.72	(446,984.74)		

e) Oro

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

6. Contratos de venta forward:

a) Títulos Valores de Deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

6.- Contratos de venta forward

a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0729	15/12/2016	11/01/2017	4,900,000.00	5,335,398.27	4,902,783.92	432,614.35	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/08/2016	31/01/2017	400,000.00	466,060.10	386,073.28	79,986.82	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	30/08/2016	31/01/2017	500,000.00	525,607.86	482,591.60	43,016.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	02/12/2016	28/02/2017	360,000.00	414,445.72	383,995.72	30,450.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	07/02/2017	1,360,000.00	1,492,238.35	1,480,017.14	12,221.21	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	05/04/2017	580,000.00	636,266.30	624,752.78	11,513.52	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	31/01/2017	6,440,000.00	7,026,848.65	7,016,124.64	10,724.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	14/02/2017	790,000.00	864,520.72	858,758.00	5,762.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	09/09/2016	05/01/2017	4,220,000.00	4,186,487.67	4,180,754.74	5,732.93	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/11/2016	15/05/2017	140,000.00	154,889.31	149,736.78	5,152.53	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/08/2016	04/08/2017	170,000.00	183,197.46	179,202.96	3,994.50	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	14/02/2017	230,000.00	252,444.91	250,018.15	2,426.76	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	06/03/2017	120,000.00	127,383.01	130,028.55	(2,645.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2016	03/02/2017	120,000.00	127,860.40	130,672.89	(2,812.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2016	26/06/2017	90,000.00	91,044.72	95,540.07	(4,495.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2016	27/07/2017	120,000.00	121,551.35	126,678.88	(5,127.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	27/10/2016	17/01/2017	1,780,000.00	1,762,874.07	1,768,142.57	(5,268.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	14/02/2017	2,670,000.00	2,896,196.71	2,902,384.62	(6,187.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	15/12/2016	11/01/2017	3,460,000.00	3,725,364.16	3,741,393.26	(16,029.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	02/11/2016	10/04/2017	11,500,000.00	12,115,974.96	11,832,004.30	283,970.66	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	05/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	148,463,387.50	148,833,560.98	(370,173.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	05/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	148,463,387.50	148,833,560.98	(370,173.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	28/12/2016	13/01/2017	110,780,000.00	102,737,605.40	110,629,130.57	(7,891,525.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	28/12/2016	13/01/2017	110,790,000.00	102,746,879.42	110,639,116.95	(7,892,237.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/11/2016	26/01/2017	98,400,000.00	101,340,388.80	98,323,742.67	3,016,646.13	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	27/12/2016	26/01/2017	71,200,000.00	73,688,289.77	71,144,821.93	2,543,467.84	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	16/11/2016	15/03/2017	38,510,000.00	42,317,888.24	40,083,183.54	2,234,704.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	22/12/2016	26/01/2017	59,500,000.00	61,475,480.88	59,453,889.11	2,021,591.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	21/12/2016	10/01/2017	46,600,000.00	47,920,597.40	46,274,152.06	1,646,445.34	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	21/12/2016	10/01/2017	33,900,000.00	35,273,763.60	33,922,295.65	1,351,467.95	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	16/12/2016	19/01/2017	50,000,000.00	50,399,520.10	49,214,042.41	1,185,477.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	22/12/2016	01/02/2017	40,000,000.00	40,141,855.58	39,332,125.98	809,729.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	24/11/2016	26/01/2017	44,400,000.00	44,918,901.02	44,122,664.69	796,236.33	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2016	26/01/2017	53,300,000.00	53,705,285.77	52,967,072.71	738,213.06	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	27/12/2016	10/01/2017	14,400,000.00	14,738,083.20	14,299,308.79	438,774.41	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

6.- Contratos de venta forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC0419	20/12/2016	03/01/2017	500,000.00	551,174.00	550,337.00	837.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	29/12/2016	28/02/2017	161,820,000.00	158,560,243.18	161,048,315.15	(2,488,071.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	29/12/2016	10/01/2017	6,900,000.00	7,078,641.00	6,871,662.86	206,978.14	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	29/12/2016	01/02/2017	40,000,000.00	38,723,513.88	39,332,125.98	(608,612.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,270,950,000.00	1,315,751,540.94	1,317,496,764.86	(1,745,223.92)		

a) Títulos Valores de deuda en USD
(*)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
EG1625	11/11/2016	10/01/2017	10,000.00	8,943.94	10,219.80	(1,275.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	20/12/2016	16/01/2017	550,000.00	556,035.32	552,863.01	3,172.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	20/12/2016	17/02/2017	436,000.00	436,656.83	436,973.48	(316.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0723	27/12/2016	10/01/2017	250,000.00	278,950.50	287,384.21	(8,433.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0427	23/09/2016	22/03/2017	1,520,000.00	1,838,518.07	1,703,473.19	135,044.88	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			2,766,000.00	3,119,104.66	2,990,913.69	128,190.97		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2016 fue de DOP 46.7111 por USD1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
LC0217	07/07/2016	05/01/2017	990,000.00	967.395.11	975,442.13	(8,047.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/07/2016	14/07/2017	390,000.00	423.985.63	434,890.14	(10,904.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	18/07/2016	13/01/2017	1,600,000.00	1,905.882.74	1,921,554.28	(15,671.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/07/2016	02/03/2017	880,000.00	998.088.44	1,011,979.15	(13,890.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	25/07/2016	19/01/2017	490,000.00	482.913.52	486,718.39	(3,804.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	27/07/2017	120,000.00	127.309.71	130,305.56	(2,995.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2016	27/07/2017	590,000.00	638.085.49	660,298.02	(22,212.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	01/08/2016	27/01/2017	3,980,000.00	3,894.646.40	3,924,952.58	(30,306.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/08/2016	04/08/2017	2,460,000.00	2,663.906.24	2,726,199.12	(62,292.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/08/2016	11/08/2017	1,230,000.00	1,341.776.32	1,362,335.13	(20,558.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/08/2016	17/08/2017	230,000.00	256.245.28	261,124.68	(4,879.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/08/2016	21/02/2017	1,310,000.00	1,489.064.92	1,501,996.51	(12,931.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/08/2016	20/02/2017	200,000.00	227.682.32	231,369.13	(3,686.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/08/2016	24/02/2017	250,000.00	282.800.85	285,483.03	(2,682.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/09/2016	05/09/2017	200,000.00	212.259.16	218,021.64	(5,762.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	21/09/2016	19/01/2017	240,000.00	234.943.04	236,285.57	(1,342.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	22/09/2016	21/03/2017	74,000,000.00	82,951.175.68	84,081,150.90	(1,129,975.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/10/2016	02/01/2017	490,000.00	484.164.45	484,044.00	120.45	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2016	16/02/2017	1,230,000.00	1,399.326.33	1,403,396.20	(4,069.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/10/2016	05/12/2017	830,000.00	891.265.26	897,894.40	(6,629.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/10/2016	05/01/2017	7,000,000.00	7,357.867.66	7,368,213.05	(10,345.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/10/2016	05/12/2017	13,300,000.00	14,209.259.58	14,308,846.05	(99,586.47)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/10/2016	06/10/2017	2,300,000.00	2,436.611.07	2,491,909.93	(55,298.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/10/2016	07/02/2017	4,200,000.00	4,744.738.12	4,748,264.85	(3,526.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	11/10/2016	11/12/2017	330,000.00	383.025.33	384,756.74	(1,731.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	09/01/2017	4,950,000.00	4,857.027.35	4,852,735.18	4,292.17	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	10/01/2017	1,010,000.00	995.356.36	994,598.97	757.39	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	11/10/2016	10/01/2017	1,080,000.00	1,061.542.48	1,060,281.71	260.77	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	17/01/2017	1,920,000.00	2,163.484.43	2,172,514.34	(9,029.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/10/2016	18/12/2017	560,000.00	590.861.62	597,582.38	(6,720.76)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	17/10/2016	17/01/2017	3,590,000.00	3,531.800.28	3,545,020.42	(13,220.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	19/10/2016	17/01/2017	1,870,000.00	1,844.394.46	1,852,092.56	(7,698.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0923	21/10/2016	19/01/2017	46,330,000.00	46,912.679.36	47,241,630.65	(328,951.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	21/10/2016	19/12/2017	11,600,000.00	12,844.108.03	12,961,286.80	(117,178.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/10/2016	30/03/2017	1,130,000.00	1,285.728.16	1,294,636.87	(8,908.71)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	21/10/2016	19/01/2017	1,930,000.00	1,900.309.90	1,903,808.75	(3,498.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	23/01/2017	220,000.00	244.499.89	244,025.87	474.02	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/10/2016	25/12/2017	2,850,000.00	3,038.192.45	3,057,022.00	(18,829.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	25/10/2016	23/01/2017	2,820,000.00	3,102.557.58	3,094,564.80	7,992.78	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	26/10/2016	24/01/2017	170,000.00	192,097.16	192,568.68	(471.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/01/2017	1,060,000.00	1,183,304.74	1,181,910.51	1,394.23	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	23/03/2017	510,000.00	574,359.15	579,459.42	(5,100.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/12/2017	240,000.00	252,436.06	253,378.35	(942.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2016	24/12/2017	140,000.00	147,147.99	148,105.27	(957.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	27/10/2016	25/01/2017	410,000.00	471,332.67	472,244.29	(911.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0111	27/10/2016	25/12/2017	680,000.00	735,948.64	742,243.98	(6,295.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/10/2016	05/01/2017	11,600,000.00	12,465,309.54	12,400,485.04	64,824.50	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	30/01/2017	2,110,000.00	2,382,677.23	2,374,528.87	8,148.36	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/10/2016	31/01/2017	220,000.00	245,087.37	244,434.89	652.48	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2016	01/02/2017	630,000.00	714,363.69	713,763.23	600.46	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	04/11/2016	10/01/2017	2,440,000.00	2,399,051.06	2,388,042.75	11,008.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	07/11/2016	06/02/2017	4,400,000.00	4,467,903.10	4,493,674.82	(25,771.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0227	07/11/2016	01/02/2017	9,500,000.00	10,130,889.79	10,098,708.73	32,181.06	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/11/2016	06/02/2017	26,700,000.00	26,998,813.08	26,969,586.66	29,226.42	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/11/2016	03/11/2017	130,000.00	132,788.00	135,313.45	(2,525.45)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	09/02/2017	1,700,000.00	1,910,371.54	1,906,565.84	3,805.70	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	10/03/2017	10,640,000.00	12,088,409.95	12,086,238.38	2,171.57	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2016	10/05/2017	1,080,000.00	1,147,711.57	1,153,451.52	(5,739.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/11/2016	12/01/2017	850,000.00	952,511.06	949,788.17	2,722.89	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	15/11/2016	15/03/2017	38,510,000.00	42,838,037.09	42,983,870.27	(145,833.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/01/2017	860,000.00	975,148.73	973,787.97	1,360.76	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	13/02/2017	480,000.00	542,096.00	541,855.32	240.68	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	13/02/2017	1,830,000.00	2,065,790.20	2,064,873.02	917.18	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/11/2016	17/05/2017	870,000.00	932,597.82	939,829.25	(7,231.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/11/2016	13/02/2017	10,200,000.00	11,278,859.71	11,190,500.82	88,358.89	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2016	15/05/2017	1,790,000.00	1,921,353.16	1,939,497.71	(18,144.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	17/11/2016	17/03/2017	8,540,000.00	9,519,563.87	9,554,271.45	(34,707.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC0223	18/11/2016	17/01/2017	300,000.00	308,590.26	307,831.32	758.94	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	18/11/2016	19/01/2017	43,800,000.00	47,191,614.45	47,157,431.84	34,182.61	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	18/11/2016	05/01/2017	30,900,000.00	34,100,628.32	34,024,663.29	75,965.03	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1126	18/11/2016	05/01/2017	27,500,000.00	28,703,707.77	28,639,765.31	63,942.46	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	18/11/2016	05/01/2017	48,100,000.00	51,937,271.57	51,821,572.34	115,699.23	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/11/2016	22/05/2017	13,060,000.00	14,226,333.15	14,114,507.47	111,825.68	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2016	05/01/2017	4,180,000.00	4,710,793.68	4,693,287.19	17,506.49	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2016	23/05/2017	90,000.00	92,372.13	93,075.32	(703.19)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2016	23/02/2017	4,350,000.00	4,938,651.44	4,938,250.08	401.36	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	27/01/2017	2,300,000.00	2,601,883.40	2,600,325.46	1,557.94	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/11/2016	27/01/2017	4,220,000.00	4,779,288.00	4,771,339.57	7,948.43	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	28/11/2016	28/02/2017	5,640,000.00	6,422,888.70	6,433,095.53	(10,206.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	29/11/2016	28/02/2017	24,300,000.00	26,114,727.48	26,189,675.15	(74,947.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/11/2016	28/02/2017	86,800,000.00	94,787,524.47	95,059,558.87	(272,034.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	760,000.00	858,672.19	858,211.40	460.79	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	1,080,000.00	1,218,766.03	1,219,151.34	(385.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	31/01/2017	1,460,000.00	1,651,837.25	1,650,950.82	886.43	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	01/03/2017	670,000.00	765,535.96	766,355.89	(819.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/11/2016	29/11/2017	4,350,000.00	4,479,891.99	4,582,232.52	(102,340.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	01/12/2016	26/01/2017	53,300,000.00	53,895,851.52	53,845,515.99	50,335.53	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	01/12/2016	01/02/2017	6,800,000.00	8,573,664.71	8,570,109.58	3,555.13	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	2,250,000.00	2,542,980.14	2,538,003.45	4,976.69	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/01/2017	4,280,000.00	4,834,447.69	4,827,048.48	7,399.21	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	02/02/2017	4,560,000.00	5,173,554.21	5,172,039.90	1,514.31	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	01/03/2017	1,040,000.00	1,193,209.44	1,186,662.17	6,547.27	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2016	30/05/2017	420,000.00	456,031.01	453,251.40	2,779.61	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	02/12/2016	04/01/2017	8,800,000.00	9,550,324.72	9,525,843.75	24,480.97	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	02/12/2016	04/01/2017	9,000,000.00	9,813,730.93	9,790,664.10	23,066.83	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	05/12/2016	04/01/2017	43,100,000.00	46,963,895.35	46,893,545.54	70,349.81	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	03/02/2017	4,160,000.00	4,717,493.78	4,724,743.99	(7,250.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/12/2016	03/02/2017	1,660,000.00	1,886,997.52	1,889,897.61	(2,900.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	07/12/2016	06/01/2017	1,300,000.00	1,488,662.39	1,487,116.00	1,546.39	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	08/12/2016	06/02/2017	5,100,000.00	5,424,801.20	5,427,015.04	(2,213.84)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	06/01/2017	420,000.00	469,524.53	469,036.80	487.73	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2016	08/12/2017	1,090,000.00	1,125,485.46	1,152,348.84	(26,863.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/12/2016	07/02/2017	6,600,000.00	7,076,186.34	7,098,994.00	(21,907.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/12/2016	07/02/2017	13,200,000.00	14,153,132.47	14,193,916.60	(40,784.13)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	09/12/2016	09/03/2017	17,600,000.00	18,954,275.49	19,069,997.95	(115,722.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0322	09/12/2016	07/02/2017	3,100,000.00	3,302,220.24	3,312,443.81	(10,223.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	12/12/2016	11/01/2017	2,010,000.00	2,169,419.22	2,168,034.77	1,384.45	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	12/12/2016	11/01/2017	13,200,000.00	14,461,353.45	14,455,212.75	6,140.70	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	11/01/2017	3,460,000.00	3,992,069.24	3,986,115.42	5,953.82	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/12/2016	09/06/2017	430,000.00	467,643.38	473,048.76	(5,405.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	12/12/2016	09/06/2017	110,000.00	127,453.37	128,789.80	(1,336.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	10/02/2017	2,300,000.00	2,358,729.84	2,366,996.61	(8,166.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	12/01/2017	4,150,000.00	4,696,086.72	4,691,661.64	4,425.08	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/01/2017	19,280,000.00	21,825,487.11	21,821,577.43	3,909.68	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	10/02/2017	8,370,000.00	9,511,674.83	9,534,419.12	(22,744.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	14/02/2017	3,910,000.00	4,444,090.44	4,453,081.59	(8,991.15)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/12/2016	13/03/2017	260,000.00	298,446.64	299,518.01	(1,071.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	13/12/2016	12/06/2017	2,980,000.00	3,215,024.26	3,263,033.01	(48,008.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE011	13/12/2016	27/01/2017	19,820,000.00	21,217,086.67	21,213,428.67	3,658.00	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	14/12/2016	14/03/2017	16,500,000.00	16,836,676.84	16,927,991.44	(91,314.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	14/12/2016	14/03/2017	12,720,000.00	14,782,665.69	14,881,887.03	(99,221.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	14/02/2017	16,980,000.00	19,230,713.55	19,298,436.45	(67,722.90)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2016	12/12/2017	13,140,000.00	13,987,503.82	14,094,321.90	(106,818.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	15/12/2016	26/01/2017	44,400,000.00	45,077,646.23	44,891,999.17	185,647.06	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	15/12/2016	30/03/2017	7,400,000.00	9,937,155.36	10,001,744.01	(64,588.65)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	15/12/2016	30/03/2017	22,900,000.00	25,253,898.52	25,418,041.60	(164,143.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	15/12/2016	16/03/2017	210,000.00	236,947.54	238,137.63	(1,190.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	13/02/2017	290,000.00	330,224.56	331,134.98	(910.42)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	15/03/2017	4,170,000.00	4,738,428.56	4,765,718.11	(27,289.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2016	16/03/2017	3,780,000.00	4,300,913.33	4,324,358.77	(23,445.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
LC0217	15/12/2016	13/01/2017	520,000.00	513,764.13	516,098.20	(2,334.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH1226	15/12/2016	30/03/2017	56,000,000.00	58,576,607.83	58,957,338.94	(380,731.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	830,000.00	943,383.00	944,284.49	(901.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	470,000.00	528,664.07	530,186.02	(1,521.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	14/02/2017	50,000.00	58,393.14	58,561.25	(168.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	4,150,000.00	4,738,716.27	4,764,548.29	(25,832.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2016	16/03/2017	170,000.00	190,602.12	191,314.74	(712.62)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	20/03/2017	2,500,000.00	2,843,237.94	2,862,555.26	(19,317.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	16/06/2017	5,510,000.00	5,925,436.12	6,001,393.61	(75,957.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/12/2016	18/12/2017	100,000.00	107,783.39	110,478.39	(2,695.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	20/12/2016	19/01/2017	21,500,000.00	23,008,740.05	23,011,716.93	(2,976.88)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	19/01/2017	1,660,000.00	1,878,291.61	1,879,739.07	(1,447.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	17/02/2017	1,060,000.00	1,202,667.88	1,205,540.29	(2,872.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/12/2016	17/02/2017	860,000.00	970,964.68	974,114.85	(3,150.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	20/12/2016	16/02/2017	110,000.00	126,517.50	126,885.47	(367.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	20/12/2016	19/01/2017	4,900,000.00	5,165,227.24	5,165,995.52	(668.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	21/12/2016	20/01/2017	14,860,000.00	17,141,516.47	17,156,827.67	(15,311.20)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2016	19/06/2017	420,000.00	448,994.35	454,812.92	(5,818.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	22/12/2016	20/02/2017	23,800,000.00	24,265,515.92	24,311,583.75	(46,067.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	22/12/2016	22/03/2017	21,600,000.00	23,868,919.25	23,975,455.76	(106,536.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	21/02/2017	640,000.00	723,951.07	726,652.42	(2,701.35)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	22/03/2017	2,750,000.00	3,134,461.50	3,155,169.27	(20,707.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	22/03/2017	430,000.00	492,600.87	495,955.23	(3,254.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2016	20/06/2017	1,790,000.00	1,924,057.88	1,942,616.48	(18,558.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0126	23/12/2016	23/03/2017	18,700,000.00	19,174,081.91	19,319,562.01	(145,480.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	26/12/2016	25/01/2017	2,040,000.00	2,355,641.06	2,352,651.78	2,989.28	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	11/01/2017	1,720,000.00	1,941,785.34	1,935,584.18	6,201.16	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/12/2016	25/01/2017	120,000.00	140,878.03	140,939.56	(61.53)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	27/12/2016	13/03/2017	29,400,000.00	32,236,834.61	32,373,240.15	(136,405.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/01/2017	120,000.00	141,256.12	141,111.36	144.76	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/01/2017	420,000.00	474,001.33	473,515.58	485.75	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	24/02/2017	1,310,000.00	1,492,348.32	1,498,461.60	(6,113.28)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/03/2017	2,510,000.00	2,865,132.99	2,885,793.45	(20,660.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/12/2016	27/03/2017	240,000.00	275,956.46	276,883.04	(926.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	28/12/2016	24/03/2017	30,200,000.00	31,633,719.19	31,762,261.45	(128,542.26)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	28/12/2016	28/03/2017	450,000.00	506,890.28	508,869.59	(1,979.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	16/02/2017	160,000.00	177,089.05	177,188.08	(99.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	28/03/2017	130,000.00	147,262.79	147,932.19	(669.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2016	26/06/2017	6,300,000.00	6,803,053.83	6,892,458.62	(89,404.79)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BC1022	29/12/2016	28/02/2017	161,820,000.00	165,241,414.17	165,998,679.63	(757,265.46)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	151,795,408.05	151,640,210.13	155,197.92	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	29/12/2016	03/02/2017	125,000,000.00	151,795,408.05	151,640,210.13	155,197.92	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	29/12/2016	15/03/2017	18,100,000.00	20,007,452.22	20,067,020.63	(59,568.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	29/03/2017	1,460,000.00	1,689,664.77	1,681,449.87	8,214.90	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2016	27/06/2017	15,280,000.00	16,844,980.46	16,793,797.47	51,182.99	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/12/2016	04/01/2017	3,120,000.00	3,362,297.96	3,427,555.19	(65,257.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/01/2016	05/01/2017	390,000.00	419,763.00	428,429.86	(8,666.86)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/01/2016	06/01/2017	3,150,000.00	3,394,287.70	3,464,039.55	(69,751.85)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	01/02/2016	31/01/2017	400,000.00	482,773.80	486,768.24	(3,994.44)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/02/2016	16/02/2017	780,000.00	865,456.79	874,131.09	(8,674.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/03/2016	02/03/2017	5,020,000.00	5,553,715.34	5,628,583.08	(74,867.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0126	04/03/2016	28/02/2017	30,900,000.00	33,770,316.89	34,567,124.12	(796,807.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,804,330,000.00	1,974,395,592.31	1,979,763,451.97	(5,367,859.66)		

e) Oro

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

7.- Contratos de compra de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

Contratos de Compra de Reportar	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Compra de Reportar	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Compra de Reportar	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Compra de Reportar	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

8.- Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016

9. Inversiones en otras obligaciones DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
N/A	Pagares Ministerio de Hacienda MH1218	2,000,000,000.00	799,999,999.72	800,004,000.00	4,000.28	DOP	94.25%
Total		2,000,000,000.00	799,999,999.72	800,004,000.00	4,000.28	DOP	94.25%

10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
D01002212822	BCRD 30.07.2021 (R)	396,500,000.00	404,870,511.50	403,371,345.00	(1,499,166.50)	DOP	OTC	19.83%
D01002215825	BCRD 14.10.2022 (R)	491,600,000.00	492,475,929.60	491,440,230.00	(1,035,699.60)	DOP	OTC	24.99%
USP3579VAP08	GDN 13.07.2018 (R)	537,800,000.00	583,847,827.70	582,621,327.60	(1,226,500.10)	DOP	OTC	26.90%
USP3579VAM11	GDN 05.10.2018 (R)	48,000,000.00	52,281,409.76	52,560,144.00	278,734.24	DOP	OTC	2.40%
USP3579VAE94	GDN 11.01.2019 (R)	13,260,000.00	14,620,479.85	14,646,704.28	26,224.43	DOP	OTC	0.66%
USP3579VAG43	GDN 15.03.2019 (R)	28,800,000.00	31,878,644.72	32,000,169.60	121,524.88	DOP	OTC	1.44%
USP3579VAP42	GDN 30.07.2021 (R)	262,000,000.00	263,710,819.42	266,540,460.00	2,829,640.58	DOP	OTC	13.10%
USP3579VAJ81	GDN 07.01.2022 (R)	50,000,000.00	52,758,071.15	52,566,800.00	(191,271.15)	DOP	OTC	2.50%
USP3579VAK54	GDN 15.07.2022 (R)	46,910,000.00	46,647,102.74	47,273,787.05	626,684.31	DOP	OTC	2.35%
USP3579WAH09	GDN 09.02.2018 (R)	6,000,000.00	6,128,749.98	6,130,878.00	2,128.02	DOP	OTC	0.30%
USP3579WAJ64	GDN 08.06.2018 (R)	12,100,000.00	12,768,411.60	12,754,985.10	(13,426.50)	DOP	OTC	0.61%
XSO900687681	GDN 10.02.2023 (R)	93,500,000.00	105,803,749.46	105,979,445.00	175,695.54	DOP	OTC	4.68%
USP3579WAF43	GDN 04.02.2028 (R)	12,800,000.00	17,838,133.40	17,873,497.60	35,364.20	DOP	OTC	0.64%
Total		1,999,270,000.00	2,085,629,840.88	2,085,759,773.23	129,932.35			100.00%

En USD (*)

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00			
Total		0.00	0.00	0.00	0.00			

b) Acciones

Código ISIN	Acciones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00			
Total		0.00	0.00	0.00	0.00			0.00

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

31 de diciembre de 2016
10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida
c) Inversiones en otras obligaciones

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00			0.00
Total		0.00	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

1- Acciones

Acciones GS

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
N/A	Banco Continental S.A.E.C.A.	65.357	22.939.250.000.00	23.201.735.000.00	262.485.000.00	GS	BVPASA	100%
Total			22.939.250.000.00	23.201.735.000.00	262.485.000.00			-

(*) El tipo de cambio al cierre del 1ro. de enero de 2016 fue de GS127.472 por DOP1.00

Acciones DOP

Código ISIN	Acciones	No. de Acciones	Valor de adquisición	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de participación
D08013300124	GAM - Fondo Cerrado Renta Fija	150.000	150.000.000.00	157.174.200.00	7.174.200.00	DOP	BVRD	89%
D08013400122	PIONEER - Fondo Cerrado Inversión Inmobiliaria	18.880	18.891.328.00	19.248.348.80	357.020.80	DOP	BVRD	11%
Total		168.880	168.891.328.00	176.422.548.80	7.531.220.80			

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

2. Títulos valores de deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
DO1002213424	BCRD 10.01.2020	6,130,000.00	6,128,703.12	6,047,986.73	(80,716.39)	DOP	OTC	0.56%
DO1002213820	BCRD 20.01.2022	39,340,000.00	41,026,851.58	40,260,201.94	(766,649.64)	DOP	OTC	3.58%
DO1002213523	BCRD 12.01.2018	20,000.00	18,957.58	19,614.58	657.00	DOP	OTC	0.00%
DO1002213325	BCRD 07.01.2022	124,180,000.00	127,106,123.73	127,161,065.08	54,941.35	DOP	OTC	11.31%
DO1002212822	BCRD 30.07.2021	44,160,000.00	43,752,188.14	43,691,020.80	(61,167.34)	DOP	OTC	4.02%
DO1002230121	BCRD 09.02.2018	5,570,000.00	5,973,310.91	5,997,837.27	24,526.36	DOP	OTC	0.51%
DO1002247224	BCRD 21.07.2017 B00717	660,000.00	696,044.74	694,871.76	(1,172.98)	DOP	OTC	0.06%
DO1002260524	BCRD 22.02.2019	90,000.00	93,659.75	93,194.10	(465.65)	DOP	OTC	0.01%
DO1002232523	BCRD 18.05.2018	6,350,000.00	6,995,077.79	7,013,987.75	18,909.96	DOP	OTC	0.58%
DO1002232622	BCRD 01.06.2018	740,000.00	815,351.60	818,569.50	3,217.90	DOP	OTC	0.07%
DO1002251523	BCRD 20.03.2020	50,000.00	53,442.65	53,317.35	(125.30)	DOP	OTC	0.00%
DO1002253727	BCRD 07.08.2020	20,000.00	21,964.24	21,331.72	(632.52)	DOP	OTC	0.00%
DO1002249824	BCRD 05.01.2018	1,470,000.00	1,482,425.34	1,487,781.12	5,355.78	DOP	OTC	0.13%
DO1002231822	BCRD 30.03.2018	50,000.00	54,403.27	54,010.45	(392.82)	DOP	OTC	0.00%
DO1002235823	BCRD 13.07.2018	1,830,000.00	2,010,969.71	2,030,692.44	19,722.73	DOP	OTC	0.17%
DO1002232721	BCRD 29.06.2018	10,000.00	11,395.41	11,088.24	(307.17)	DOP	OTC	0.00%
DO1002237027	BCRD 05.10.2018	31,640,000.00	35,617,632.61	35,325,427.20	(292,205.41)	DOP	OTC	2.88%
DO1002240229	BCRD 11.01.2019	370,000.00	419,354.05	415,939.94	(3,414.11)	DOP	OTC	0.03%
DO1002248925	BCRD 13.10.2017	360,000.00	375,453.62	369,857.88	(5,595.74)	DOP	OTC	0.03%
DO1002243124	BCRD 15.03.2019	1,670,000.00	1,862,439.24	1,883,846.84	21,407.60	DOP	OTC	0.15%
DO1002229321	BCRD 19.01.2018	1,990,000.00	2,133,159.48	2,139,821.13	6,661.65	DOP	OTC	0.18%
DO1002249022	BCRD 18.10.2019	50,000.00	54,567.14	54,787.45	220.31	DOP	OTC	0.00%
DO1002243926	BCRD 05.07.2019	1,840,000.00	2,074,212.26	2,062,938.08	(11,274.18)	DOP	OTC	0.17%
DO1002213622	BCRD 19.01.2018 (2)	3,980,000.00	3,922,302.22	3,902,222.84	(20,079.38)	DOP	OTC	0.36%
DO1002246820	BCRD 12.05.2017	180,000.00	188,127.51	188,520.12	392.61	DOP	OTC	0.02%
DO1002213929	BCRD Nota 11.03.2022	150,000.00	153,843.68	153,136.80	(706.88)	DOP	OTC	0.01%
DO1002230527	BCRD 23.02.2018	3,660,000.00	3,930,921.33	3,944,890.74	13,969.41	DOP	OTC	0.33%
DO2006301124	BMC221 29.04.2021	10,000,000.00	10,000,000.00	10,001,550.00	1,550.00	DOP	OTC	0.91%

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

2. Títulos valores de deuda en DOP (continuación)

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
D02006301025	BMC321 29.04.2021	10,000,000.00	10,000,000.00	10,001,550.00	1,550.00	DOP	OTC	0.91%
D02006301223	BMC421 29.04.2021	10,000,000.00	10,000,000.00	10,001,550.00	1,550.00	DOP	OTC	0.91%
D02006301421	BM1421 29.04.2021	2,000,000.00	2,000,000.00	2,000,310.00	310.00	DOP	OTC	0.18%
D02006301520	BM1521 29.04.2021	2,000,000.00	2,000,000.00	2,000,310.00	310.00	DOP	OTC	0.18%
D02006300928	BMC921 29.04.2021	1,500,000.00	1,500,000.00	1,500,232.50	232.50	DOP	OTC	0.14%
D02006851912	Parval 08.11.2016	200,000.00	199,381.84	199,998.20	416.36	DOP	OTC	0.02%
D02006802220	Paralinx 22.09.2020 PV4915	30,500,000.00	30,499,859.85	30,499,664.50	(195.35)	DOP	OTC	2.78%
D02012700327	BUC 03.12.2017 3ERA	360,067.00	360,067.00	360,016.59	(50.41)	DOP	OTC	0.03%
D02012700723	BUC 03.12.2017 7MA	5,421.00	5,421.00	5,420.24	(0.76)	DOP	OTC	0.00%
D02012700426	BUC 03.12.2017	13,539,933.00	13,539,933.00	13,538,037.41	(1,895.59)	DOP	OTC	1.23%
D01006239624	AND1 2016	3,299,000.00	3,183,229.00	3,183,980.36	751.36	DOP	OTC	0.30%
D01005241224	ADM1 2017	3,387,000.00	3,405,114.75	(542.99)	(542.99)	DOP	OTC	0.31%
D01005241026	MH1 2019	12,900,000.00	14,695,884.88	14,694,570.60	(1,314.28)	DOP	OTC	1.17%
D01005204115	MH5 2019	300,000.00	304,166.57	304,169.10	2.53	DOP	OTC	0.03%
D01005224329	MH1 2020	21,200,000.00	25,748,478.65	25,745,810.00	(2,668.65)	DOP	OTC	1.93%
D01005234625	MH1 2021	71,700,000.00	89,627,073.22	88,920,834.30	(706,238.92)	DOP	OTC	6.53%
D01005241125	MH2 2022	44,100,000.00	57,394,396.28	57,389,535.00	(4,861.28)	DOP	OTC	4.02%
D01005204719	MH2 2022	4,100,000.00	4,133,273.81	4,133,324.80	50.99	DOP	OTC	0.37%
D01005204214	MH5 2024	359,400,000.00	382,902,179.38	379,220,550.60	(3,681,628.78)	DOP	OTC	32.73%
D01005205013	MH1 2026	171,900,000.00	170,979,601.66	168,415,930.80	(2,563,670.86)	DOP	OTC	15.66%
D01005204412	MH1 2029	49,000,000.00	49,975,224.49	49,969,171.00	(6,053.49)	DOP	OTC	4.46%
Total		1,097,951,421	1,159,426,368.08	1,151,389,047.61	(8,037,320.36)			100%

En USD (*):

Código ISIN	Títulos Valores de deuda	Valor nominal	Costo amortizado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación	Porcentaje de participación
USP3579EAT49	BSRD 28.01.2024	3,000.00	3,123.80	3,111.58	(12.22)	USD	OTC	0.00%
USP3579EBE60	BSRD 27.01.2045	2,803,000.00	2,913,658.37	2,661,801.68	(251,856.69)	USD	OTC	10.43%
D01005244525	MH CDEEE 2023	110,000.00	128,508.71	123,768.59	(4,740.12)	USD	OTC	0.20%
D02009358519	EGE HAINA 13.02.2020 EG0320	1,000.00	1,041.68	1,009.26	(32.41)	USD	OTC	0.00%
D02009304018	EGE HAINA 27.05.2020 EG1020	2,980.00	2,980.01	2,979.93	(0.07)	USD	OTC	0.00%
D02009358014	EGE HAINA 23.01.2020 EG0120	6,700.00	6,693.74	6,700.52	6.76	USD	OTC	0.00%
USP10475AA22	RESERVAS 01.02.2023	3,243,000.00	3,218,741.89	3,213,106.03	(5,635.86)	USD	OTC	0.23%
USC71058AD08	PRO119 26.01.2019	8,800,000.00	2,350,772.40	1,966,140.00	(384,632.40)	USD	OTC	15.93%
USC71058AB42	PRO1221 12.12.2021	60,000.00	1,529,793.36	10,785.90	(1,519,007.46)	USD	OTC	62.90%
USG6711KAA37	BOD 01.10.2022	5,449,000.00	1,431,879.98	1,262,490.70	(169,389.28)	USD	OTC	7.01%
XSO096338322	BNG 15.11.2018	500,000.00	189,544.64	109,851.00	(79,693.64)	USD	OTC	3.30%
Total		20,978,680.00	11,776,738.58	9,361,745.19	(2,414,993.39)			100%

(*) El tipo de cambio al cierre del 1ro. de enero de 2016 fue de DOP45.5544 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

3. Contratos de compra spot

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Bolsa de Valores
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Divisas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

e) Divisas Implícitas

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

f) 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
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

4. 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
MH0322	31/12/2015	05/01/2016	200,000.00	193,026.64	201,625.60	(8,598.96)	DOP	OTC
CE1018	31/12/2015	05/01/2016	3,120,000.00	3,524,039.31	3,483,417.60	40,621.71	DOP	OTC
Total			3,320,000.00	3,717,065.95	3,685,043.2	32,022.75		

4. Contratos de venta spot:

a) Títulos Valores de Deuda USD

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0145	30/12/2015	05/01/2016	2,559,000.00	2,675,661.84	2,430,092.93	245,568.91	USD	OTC
Total			2,559,000.00	2,675,661.84	2,430,092.93	245,568.91		

(*) El tipo de cambio al cierre del 1ro. de enero de 2016, fue de DOP45,5544 por USD1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio ejecutado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

e) Oro

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

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

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	18/12/2015	16/12/2016	3,920,000.00	4,078,924.98	4,097,455.45	18,530.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/04/2015	15/04/2016	1,140,000.00	1,233,607.10	1,250,358.06	16,750.96	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2015	14/12/2016	1,380,000.00	1,432,652.95	1,443,031.51	10,378.56	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/12/2015	04/01/2017	3,120,000.00	3,241,729.19	3,249,213.35	7,484.16	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	27/11/2015	25/02/2016	1,533,000.00	1,483,133.04	1,486,353.12	3,220.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/02/2015	17/02/2016	60,000.00	64,129.67	66,503.98	2,374.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	25/11/2015	26/01/2016	4,693,000.00	4,537,447.84	4,539,045.22	1,597.38	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	22/12/2015	03/03/2016	235,000.00	226,506.16	227,979.63	1,473.47	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/02/2015	18/02/2016	80,000.00	87,302.35	88,658.50	1,356.15	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	07/04/2016	267,000.00	258,518.75	259,764.00	1,245.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	18/12/2015	15/03/2016	468,000.00	453,270.17	454,463.92	1,193.75	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	02/12/2015	01/03/2016	454,000.00	439,492.04	440,365.30	873.26	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/11/2015	03/05/2016	211,000.00	204,878.68	205,716.28	837.60	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2015	20/06/2016	4,980,000.00	5,400,320.33	5,401,084.10	763.77	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	19/10/2015	17/03/2016	217,000.00	210,126.96	210,758.04	631.08	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	22/12/2015	19/02/2016	180,000.00	196,972.87	197,527.41	554.54	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2015	14/01/2016	140,000.00	155,428.25	155,977.25	549.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/03/2016	253,000.00	245,201.78	245,522.07	320.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	11/12/2015	11/01/2016	63,000.00	60,722.55	60,858.41	135.86	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	30/11/2015	29/02/2016	53,000.00	51,299.07	51,404.09	105.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	06/01/2016	67,000.00	64,601.87	64,695.89	94.02	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	21/03/2016	53,000.00	51,494.64	51,492.26	(2.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	27/11/2015	25/02/2016	117,000.00	113,456.77	113,439.87	(16.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/03/2016	58,000.00	56,315.91	56,285.69	(30.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	10/11/2015	09/03/2016	144,000.00	139,868.50	139,766.60	(101.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	14/03/2016	240,000.00	265,095.59	264,965.47	(130.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	08/12/2015	08/03/2016	62,000.00	60,302.50	60,172.38	(130.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	10/12/2015	09/03/2016	140,000.00	136,063.76	135,884.20	(179.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	18/12/2015	18/01/2016	144,000.00	139,380.48	139,184.79	(195.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	21/03/2016	103,000.00	100,326.94	100,069.87	(257.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	08/01/2016	930,000.00	898,473.00	898,164.97	(308.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2015	29/11/2016	3,920,000.00	4,111,374.88	4,110,975.35	(399.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	29/02/2016	130,000.00	144,251.07	143,829.34	(421.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	12/08/2015	04/08/2016	41,000.00	40,707.26	40,226.09	(481.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/03/2016	360,000.00	397,445.36	396,963.38	(481.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	11/12/2015	10/03/2016	103,000.00	100,469.14	99,980.11	(489.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Estados Financieros

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS

31 de diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos - DOP)

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

Riesgo de liquidez (continuación)

	A la demanda	Menos de 3 meses	1ro. de enero de 2016			Total
			De 3 a 12 Meses	De 1 a 5 años	Más de 5 años	
Pasivos financieros a su valor razonable	-	777,531,670	246,661,044	5,678,342	-	1,029,871,056
Instrumentos financieros a su valor razonable derivados	-	-	99,073,481	24,586,563	-	123,660,044
Obligaciones con bancos	-	930,172,914	911,308,217	-	-	1,841,481,131
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	22,191,781	1,014,498,630	-	-	1,036,690,411
Otras cuentas por pagar	-	13,432,269	-	-	-	13,432,269
Cuentas por pagar a relacionadas	37,108	-	-	-	-	37,108
Acumulaciones y otras obligaciones	-	28,534,873	-	-	-	28,534,873
	37,108	1,771,863,507	2,271,541,372	30,264,905	-	4,073,706,892

Riesgo de tasa de interés

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

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

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

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

Variación de la Tasa de Interés en Puntos Básicos	Efecto en la Utilidad antes de Impuesto Sobre la Renta		
	2017	2016	1ro. enero de 2016
+500	(9,424,184)	(5,041,936)	(3,540,215)
-500	9,424,184	5,041,936	3,540,215

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
ADM116	12/08/2015	04/08/2016	102,000.00	101,800.90	100,074.67	(1,726.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	27/06/2016	390,000.00	424,263.17	422,469.75	(1,793.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	17/12/2015	23/02/2016	411,000.00	400,399.90	398,428.77	(1,971.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	01/12/2015	29/02/2016	309,000.00	301,829.66	299,695.52	(2,134.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	30/06/2016	20,000.00	23,849.66	21,653.98	(2,195.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	15/12/2015	14/01/2016	878,000.00	884,241.24	882,040.14	(2,201.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	01/06/2016	154,000.00	152,572.42	150,366.91	(2,205.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	27/01/2016	220,000.00	246,835.35	244,625.66	(2,209.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	02/12/2015	01/03/2016	344,000.00	336,356.33	333,668.86	(2,687.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/12/2015	14/06/2016	390,000.00	426,129.88	423,410.79	(2,719.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	01/06/2016	257,000.00	253,722.99	250,936.98	(2,786.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	17/12/2015	18/01/2016	514,000.00	499,758.60	496,812.36	(2,946.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2015	29/11/2016	680,000.00	716,221.60	713,128.38	(3,093.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/03/2016	452,000.00	441,835.24	438,640.22	(3,195.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2015	11/01/2016	180,000.00	203,860.82	200,633.09	(3,227.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	28/03/2016	470,000.00	521,029.55	517,783.02	(3,246.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	11/01/2016	340,000.00	382,283.90	378,973.61	(3,310.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/01/2015	22/01/2016	80,000.00	92,438.61	89,022.12	(3,416.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2015	17/03/2016	200,000.00	224,249.86	220,703.55	(3,546.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	21/03/2016	463,000.00	453,404.79	449,828.62	(3,576.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	05/08/2015	02/02/2016	92,000.00	92,617.78	89,032.94	(3,584.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	08/03/2016	514,000.00	502,503.36	498,848.40	(3,654.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	19/10/2015	18/01/2016	103,000.00	103,288.11	99,555.79	(3,712.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	21/12/2015	10/02/2016	670,000.00	719,866.87	716,047.50	(3,819.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	06/05/2015	29/04/2016	155,000.00	154,938.00	151,069.48	(3,868.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	28/10/2015	29/01/2016	113,000.00	113,200.35	109,319.87	(3,880.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	28/01/2016	40,000.00	48,434.09	44,470.66	(3,963.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/12/2015	06/01/2016	260,000.00	294,336.05	290,022.19	(4,313.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	11/01/2016	270,000.00	305,327.40	300,949.63	(4,377.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2015	08/03/2016	260,000.00	291,711.56	287,308.53	(4,403.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/01/2016	170,000.00	193,792.47	189,229.24	(4,563.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	28/01/2016	430,000.00	482,752.58	478,059.58	(4,693.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	23/12/2015	22/02/2016	630,000.00	702,712.52	697,761.50	(4,951.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	05/01/2016	170,000.00	194,997.32	189,801.60	(5,195.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	03/03/2016	260,000.00	292,759.99	287,527.38	(5,232.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/01/2016	1,029,000.00	998,943.94	993,694.56	(5,249.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	10/12/2015	08/01/2016	2,122,490.66	2,122,490.66	2,117,225.00	(5,265.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/08/2015	01/02/2016	157,000.00	157,207.40	151,924.21	(5,283.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/08/2015	18/08/2016	80,000.00	91,359.25	85,888.32	(5,470.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	11/01/2016	640,000.00	718,839.70	713,362.08	(5,477.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	26/01/2016	170,000.00	194,708.45	189,057.53	(5,650.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	23/12/2015	22/01/2016	1,072,000.00	1,082,679.45	1,076,573.57	(6,105.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	03/07/2015	27/06/2016	307,000.00	306,479.64	300,345.55	(6,134.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	23/02/2016	220,000.00	249,793.35	243,625.71	(6,167.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2015	29/02/2016	520,000.00	581,489.92	575,317.37	(6,172.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	23/02/2016	350,000.00	393,992.19	387,586.36	(6,405.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/11/2015	24/02/2016	520,000.00	582,191.96	575,755.05	(6,436.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0318	20/10/2015	18/01/2016	450,000.00	491,361.94	484,886.40	(6,475.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/05/2015	13/05/2016	210,000.00	235,900.90	229,237.73	(6,663.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	24/11/2015	22/02/2016	1,032,000.00	1,007,053.46	1,000,352.52	(6,700.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	22/02/2016	510,000.00	571,780.09	564,854.55	(6,925.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/03/2016	1,050,000.00	1,025,958.06	1,018,965.11	(6,992.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/01/2016	370,000.00	418,812.34	411,727.31	(7,085.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/10/2015	20/01/2016	170,000.00	196,365.08	189,229.24	(7,135.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/08/2015	19/08/2016	220,000.00	243,295.77	236,152.05	(7,143.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/07/2015	04/01/2016	409,000.00	402,110.80	394,740.22	(7,370.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/12/2015	09/03/2016	430,000.00	482,810.98	475,091.73	(7,719.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	680,000.00	752,453.47	744,565.47	(7,888.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/12/2015	02/03/2016	190,000.00	218,170.37	210,148.15	(8,022.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	03/11/2015	01/02/2016	751,000.00	761,915.49	753,889.46	(8,026.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/09/2015	11/03/2016	160,000.00	184,853.72	176,724.45	(8,129.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2015	08/01/2016	560,000.00	632,631.66	624,474.63	(8,157.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	29/12/2015	28/01/2016	1,557,000.00	1,571,441.18	1,563,251.43	(8,189.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2015	20/01/2016	910,000.00	1,021,204.02	1,012,933.00	(8,271.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	18/01/2016	1,544,000.00	1,500,823.58	1,492,370.21	(8,453.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/04/2015	15/04/2016	510,000.00	568,481.86	559,370.71	(9,111.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/09/2015	01/03/2016	220,000.00	252,689.97	243,366.47	(9,323.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	20/05/2016	1,610,000.00	1,764,764.49	1,755,397.42	(9,367.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/03/2016	1,280,000.00	1,420,938.74	1,411,425.35	(9,513.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
E1018	27/11/2015	25/05/2016	470,000.00	521,635.08	512,009.03	(9,626.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	18/12/2015	18/01/2016	1,020,000.00	1,145,364.10	1,135,718.86	(9,645.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2015	22/01/2016	600,000.00	677,416.16	667,665.90	(9,750.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	28/01/2016	1,120,000.00	1,254,948.89	1,245,178.43	(9,770.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/01/2016	430,000.00	488,785.97	479,000.60	(9,785.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	11/04/2016	310,000.00	350,066.52	340,239.80	(9,826.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2015	08/02/2016	350,000.00	398,392.06	388,470.15	(9,921.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0363	23/12/2015	22/01/2016	8,550,000.00	8,539,163.80	8,529,127.06	(10,036.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	06/01/2016	400,000.00	456,532.71	446,187.98	(10,344.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2015	05/01/2016	450,000.00	512,838.55	502,416.00	(10,422.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/10/2015	04/01/2016	300,000.00	345,375.71	334,944.00	(10,431.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	01/03/2016	400,000.00	453,111.68	442,484.48	(10,627.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/01/2016	430,000.00	489,312.09	478,638.67	(10,673.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	27/06/2016	3970,000.00	4,311,210.48	4,300,525.40	(10,685.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	13/01/2016	340,000.00	389,612.04	378,859.13	(10,752.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	28/03/2016	910,000.00	1,013,338.95	1,002,516.07	(10,822.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	03/12/2015	10/02/2016	820,000.00	889,806.14	878,910.58	(10,895.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/01/2016	670,000.00	756,806.90	745,765.83	(11,021.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	29/03/2016	440,000.00	495,720.88	484,658.97	(11,061.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	22/02/2016	790,000.00	886,235.45	874,970.77	(11,264.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	01/03/2016	810,000.00	907,516.17	896,031.08	(11,485.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	01/02/2016	410,000.00	467,040.65	455,548.17	(11,492.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2015	29/01/2016	430,000.00	489,544.46	477,957.19	(11,587.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/09/2015	28/03/2016	470,000.00	529,615.05	517,783.02	(11,832.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2015	03/05/2016	290,000.00	329,001.95	317,104.66	(11,897.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	29/12/2015	10/02/2016	1,170,000.00	1,297,745.37	1,285,781.56	(11,963.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	23/12/2015	22/01/2016	1,250,000.00	1,355,587.05	1,343,276.49	(12,310.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/07/2014	21/07/2016	800,000.00	875,360.80	863,040.90	(12,319.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	12/10/2015	11/01/2016	810,000.00	883,345.12	870,922.67	(12,422.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	05/01/2016	710,000.00	805,196.22	792,700.80	(12,495.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/01/2016	1,660,000.00	1,861,692.78	1,849,165.11	(12,527.67)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	27/06/2016	8,640,000.00	9,371,925.14	9,359,329.85	(12,595.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0320	22/10/2015	18/01/2016	450,000.00	491,729.25	478,956.03	(12,773.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	23/12/2015	22/01/2016	1,320,000.00	1,431,389.58	1,418,499.97	(12,889.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2015	04/02/2016	940,000.00	1,057,062.03	1,043,952.79	(13,109.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	29/03/2016	510,000.00	575,375.93	561,763.81	(13,612.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	01/02/2016	340,000.00	391,446.12	377,711.65	(13,674.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/11/2015	04/05/2016	660,000.00	735,278.88	721,563.96	(13,714.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/01/2016	1,570,000.00	1,762,657.76	1,748,909.17	(13,748.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	05/02/2016	670,000.00	757,789.17	743,981.22	(13,807.95)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE517	14/12/2015	10/02/2016	1,990,000.00	2,086,268.25	2,072,228.96	(14,038.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	02/11/2015	29/02/2016	340,000.00	390,244.55	376,169.05	(14,075.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	970,000.00	1,094,960.72	1,080,862.82	(14,097.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	1,120,000.00	1,262,515.42	1,248,383.64	(14,131.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	13/01/2016	370,000.00	426,597.70	412,287.88	(14,309.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	23/02/2016	880,000.00	988,837.35	974,502.84	(14,334.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	07/03/2016	360,000.00	412,239.01	397,872.42	(14,366.59)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	23/02/2016	650,000.00	734,273.53	719,803.24	(14,470.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/01/2016	770,000.00	871,580.65	857,097.15	(14,483.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/10/2015	19/04/2016	350,000.00	398,202.52	383,622.01	(14,580.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/07/2015	15/07/2016	200,000.00	230,622.07	215,982.96	(14,639.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2015	22/04/2016	500,000.00	562,465.46	547,753.02	(14,712.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	14/12/2015	13/01/2016	2,679,000.00	2,706,557.80	2,691,439.71	(15,118.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	07/01/2016	860,000.00	974,287.75	959,159.39	(15,128.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	31/12/2015	04/01/2017	200,000.00	211,164.38	196,010.24	(15,154.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2015	03/03/2016	780,000.00	877,934.93	862,582.13	(15,352.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2015	22/02/2016	500,000.00	569,202.85	553,778.97	(15,423.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	02/03/2016	660,000.00	745,508.54	729,988.29	(15,520.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	22/02/2016	760,000.00	857,750.12	841,744.03	(16,006.09)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	06/01/2016	990,000.00	1,120,470.12	1,104,315.26	(16,154.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	30/11/2015	10/02/2016	1,200,000.00	1,333,468.19	1,316,861.07	(16,607.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/12/2015	16/03/2016	920,000.00	1,032,005.53	1,015,391.21	(16,614.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	02/11/2015	01/02/2016	1,000,000.00	995,132.00	977,837.56	(17,294.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	10/11/2015	08/02/2016	1,110,000.00	1,206,482.31	1,188,972.05	(17,510.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/12/2015	11/01/2016	780,000.00	886,960.36	869,410.04	(17,550.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	29/03/2016	1,980,000.00	2,198,664.45	2,180,965.38	(17,699.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	01/02/2016	400,000.00	462,139.88	444,437.24	(17,702.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	01/02/2016	1,050,000.00	1,184,428.56	1,166,647.75	(17,780.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/01/2016	860,000.00	974,842.73	956,987.79	(17,854.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	11/01/2016	390,000.00	452,601.62	434,705.02	(17,896.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	11/01/2016	430,000.00	497,208.76	479,290.15	(17,918.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/11/2015	23/05/2016	900,000.00	999,083.96	980,776.91	(18,307.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	03/03/2016	1,000,000.00	1,124,441.80	1,105,874.53	(18,567.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	27/01/2016	1,720,000.00	1,931,179.85	1,912,527.85	(18,652.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	16/12/2015	15/01/2016	2,020,000.00	2,189,421.65	2,170,756.94	(18,664.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	13/10/2015	11/04/2016	240,000.00	273,342.05	254,481.12	(18,860.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2015	18/04/2016	450,000.00	512,550.17	493,311.82	(19,238.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	1,140,000.00	1,290,201.79	1,270,676.21	(19,525.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	1,320,000.00	1,490,542.05	1,470,864.87	(19,677.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/12/2015	18/01/2016	1,140,000.00	1,289,247.89	1,269,332.85	(19,915.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	08/01/2016	1,740,000.00	1,960,491.82	1,940,331.90	(20,159.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2015	16/05/2016	1,040,000.00	1,154,898.25	1,134,693.45	(20,204.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BO0222	29/12/2015	28/01/2016	1,300,000.00	1,706,756.30	1,685,937.61	(20,818.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/11/2015	08/02/2016	1,420,000.00	1,539,702.58	1,518,047.57	(21,655.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2015	12/01/2016	600,000.00	690,378.50	668,675.95	(21,702.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	25/02/2016	830,000.00	940,675.22	918,853.92	(21,821.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/01/2016	1,610,000.00	1,813,391.53	1,791,570.17	(21,821.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	06/01/2016	1,170,000.00	1,327,097.50	1,305,099.85	(21,997.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/01/2016	05/01/2016	1,290,000.00	1,462,314.69	1,440,259.20	(22,055.49)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/09/2015	26/01/2016	450,000.00	522,518.46	500,446.41	(22,072.05)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2015	04/08/2016	2,422,050.95	2,422,050.95	2,399,931.75	(22,119.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/10/2015	04/04/2016	470,000.00	539,361.42	517,229.18	(22,132.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	26/10/2015	26/01/2016	500,000.00	511,514.50	489,096.39	(22,418.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	26/10/2015	26/01/2016	1,100,000.00	1,098,709.70	1,076,012.05	(22,697.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/01/2016	1,720,000.00	1,937,265.05	1,914,554.68	(22,710.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	23/03/2016	830,000.00	937,883.98	915,081.40	(22,802.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	01/03/2016	2,090,000.00	2,334,786.71	2,311,981.43	(22,805.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/11/2015	24/02/2016	880,000.00	997,319.82	974,354.70	(22,965.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2015	03/03/2016	860,000.00	974,135.97	951,052.09	(23,083.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	17/11/2015	10/02/2016	1,270,000.00	1,418,787.60	1,395,677.42	(23,110.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0319	17/11/2015	15/02/2016	900,000.00	1,031,783.93	1,008,462.09	(23,321.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0718	21/07/2015	18/01/2016	260,000.00	311,202.05	287,674.60	(23,527.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	16/12/2015	15/01/2016	5,082,000.00	4,934,591.51	4,910,855.26	(23,736.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	03/12/2015	02/03/2016	1,700,000.00	1,944,517.31	1,920,696.74	(23,820.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	21/03/2016	3,355,000.00	3,283,394.24	3,259,557.25	(23,836.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	21/03/2016	1,370,000.00	1,535,106.21	1,510,896.82	(24,209.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	09/12/2015	06/06/2016	230,000.00	276,436.78	251,970.43	(24,466.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/09/2015	21/03/2016	480,000.00	553,856.30	529,365.31	(24,490.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BAG018	30/11/2015	15/01/2016	2,100,000.00	2,084,228.31	2,058,134.83	(26,093.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	22/12/2015	20/04/2016	1,550,000.00	1,724,768.41	1,698,609.76	(26,158.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/11/2015	27/01/2016	1,310,000.00	1,482,838.79	1,456,634.59	(26,204.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/09/2015	04/09/2017	240,000.00	261,961.22	235,696.56	(26,264.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	20/01/2016	1,890,000.00	2,130,421.53	2,103,783.92	(26,637.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2015	16/05/2016	720,000.00	866,899.18	840,109.58	(26,789.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	1,930,000.00	2,178,107.46	2,151,232.52	(26,874.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	29/01/2016	1,810,000.00	2,039,282.94	2,011,992.59	(27,290.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/10/2015	19/01/2016	1,490,000.00	1,686,512.65	1,658,789.47	(27,723.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	17/11/2015	15/02/2016	3,442,000.00	3,362,455.38	3,334,538.25	(27,917.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	02/12/2015	30/05/2016	480,000.00	532,803.42	504,542.05	(28,261.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	15/12/2015	14/01/2016	4,783,000.00	4,833,307.59	4,805,009.08	(28,298.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	14/12/2015	13/01/2016	5,650,000.00	5,487,782.85	5,458,831.70	(28,951.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/10/2015	19/01/2016	900,000.00	1,031,212.89	(29,259.52)	(29,259.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	11/11/2015	09/02/2016	1,230,000.00	1,379,301.36	1,349,998.02	(29,303.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Puesto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	10/11/2015	10/01/2016	1,220,000.00	1,350,641.43	1,359,846.47	(30,794.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	1,950,000.00	2,203,867.84	2,172,868.56	(30,999.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0717	28/12/2015	28/01/2016	330,000.00	377,340.41	346,037.05	(31,303.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	10/12/2015	08/01/2016	5,746,000.00	5,905,192.84	5,773,884.59	(31,308.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0363	23/12/2015	22/01/2016	21,450,000.00	21,429,381.62	21,397,634.56	(31,747.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/09/2015	14/03/2016	1,310,000.00	1,478,583.86	1,446,269.84	(32,314.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2015	16/05/2016	1,150,000.00	1,287,493.32	1,254,709.11	(32,784.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	04/03/2016	1,720,000.00	1,934,853.11	1,901,814.64	(33,038.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	20/10/2015	18/01/2016	926,000.00	928,529.81	895,035.50	(33,494.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	30/05/2016	1,410,000.00	1,568,375.23	1,534,718.53	(33,656.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	21/10/2015	19/01/2016	1,550,000.00	1,698,671.38	1,664,779.24	(33,892.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/12/2015	08/01/2016	1,950,000.00	2,208,410.42	2,174,509.88	(33,900.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2015	18/01/2016	1,730,000.00	1,960,341.39	1,926,268.27	(34,073.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	01/03/2016	1,720,000.00	1,936,824.69	1,902,683.28	(34,141.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2015	18/01/2016	870,000.00	1,003,495.07	968,701.38	(34,793.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	03/06/2016	1,340,000.00	1,492,811.51	1,457,531.96	(35,279.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	06/10/2015	04/01/2016	1,000,000.00	1,165,920.21	1,130,451.00	(35,469.21)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	29/01/2016	4,050,000.00	4,537,565.83	4,501,972.37	(35,593.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	30/09/2015	29/09/2016	300,000.00	323,688.60	287,177.61	(36,510.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BA0118	29/10/2015	15/01/2016	1,600,000.00	1,604,700.21	1,568,102.73	(36,597.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	27/10/2015	26/01/2016	1,700,000.00	1,967,144.80	1,929,869.23	(37,275.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0219	30/12/2015	29/01/2016	2,750,000.00	2,877,760.86	2,840,492.78	(37,268.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2015	26/01/2016	1,070,000.00	1,227,282.13	1,189,950.36	(37,331.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	29/01/2016	2,610,000.00	2,839,044.11	2,901,271.08	(37,773.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/12/2015	11/01/2016	2,360,000.00	2,668,457.80	2,630,522.67	(37,935.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/09/2015	13/01/2016	1,050,000.00	1,208,554.01	1,170,006.15	(38,547.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	04/11/2015	02/02/2016	1,410,000.00	1,590,589.89	1,551,517.01	(39,072.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	18/12/2015	18/01/2016	7,697,000.00	7,478,762.35	7,439,620.17	(39,162.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/06/2015	09/06/2016	820,000.00	931,653.50	891,009.34	(40,644.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	20/01/2016	8,204,000.00	7,974,525.92	7,930,966.50	(43,559.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	09/09/2015	27/01/2016	1,320,000.00	1,460,672.87	1,416,213.57	(44,459.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	27/11/2015	25/02/2016	440,000.00	527,086.62	482,380.12	(44,706.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/10/2015	25/04/2016	2,540,000.00	2,826,190.58	2,781,171.00	(45,019.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	28/01/2016	4,020,000.00	4,514,631.82	4,469,301.16	(45,330.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	14/12/2015	13/01/2016	9,568,000.00	9,660,518.80	9,612,428.18	(48,090.62)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2015	12/01/2016	1,310,000.00	1,508,339.55	1,459,942.48	(48,397.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/11/2015	03/02/2016	3,130,000.00	3,525,112.74	3,476,667.57	(48,445.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0419	20/10/2015	18/04/2016	1,280,000.00	1,473,122.20	1,423,739.20	(49,383.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/11/2015	15/02/2016	1,940,000.00	2,200,893.89	2,150,948.47	(49,945.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2015	07/01/2016	2,300,000.00	2,841,716.70	2,790,737.80	(50,978.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/12/2015	14/03/2016	9,650,000.00	10,705,988.07	10,653,819.82	(52,168.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Supervit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	06/11/2015	04/01/2016	1,870,000.00	2,129,096.57	2,076,799.69	(52,296.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	11/12/2015	01/02/2016	8,516,000.00	8,606,688.14	8,556,256.80	(50,431.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	07/10/2015	04/04/2016	500,000.00	607,151.91	552,873.25	(54,278.66)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1019	25/05/2015	24/05/2016	250,000.00	323,557.39	268,523.22	(55,034.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/11/2015	05/01/2016	1,740,000.00	1,998,098.88	1,942,675.20	(55,423.68)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	09/10/2015	04/04/2016	500,000.00	610,091.33	552,873.25	(57,218.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	05/01/2016	4,110,000.00	4,647,021.50	4,588,732.80	(58,288.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	10/12/2015	08/01/2016	6,800,000.00	7,797,220.00	7,737,821.88	(59,398.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	27/01/2016	4,320,000.00	4,864,532.86	4,803,558.33	(60,974.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	06/10/2015	04/01/2016	2,110,000.00	2,391,917.90	2,330,632.15	(61,285.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	2,930,000.00	3,291,413.54	3,226,894.93	(64,518.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	02/12/2015	05/01/2016	5,100,000.00	6,704,567.10	6,636,885.00	(67,682.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	4,300,000.00	4,776,166.70	4,708,281.62	(67,885.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	04/11/2015	02/02/2016	1,840,000.00	1,898,318.01	1,829,923.71	(68,394.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	23/11/2015	10/02/2016	6,270,000.00	6,772,260.29	6,700,922.16	(71,338.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2015	17/03/2016	2,610,000.00	2,952,037.82	2,880,181.34	(71,856.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2015	07/03/2016	1,100,000.00	1,396,041.90	1,323,378.44	(72,663.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2015	11/04/2016	1,920,000.00	2,181,650.60	2,107,291.69	(74,358.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	20/10/2015	18/01/2016	2,747,000.00	2,730,910.82	2,655,143.12	(75,767.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2015	18/01/2016	2,330,000.00	2,670,233.26	2,594,338.19	(75,895.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	06/01/2016	4,090,000.00	4,638,591.46	4,562,272.12	(76,319.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	21/10/2015	19/01/2016	3,160,000.00	3,558,133.83	3,475,909.95	(82,223.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2015	18/01/2016	2,800,000.00	3,196,985.55	3,117,659.62	(79,325.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/10/2015	07/01/2016	3,110,000.00	3,548,313.03	3,468,588.02	(80,725.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/09/2015	18/03/2016	4,100,000.00	4,605,909.89	4,523,732.61	(82,177.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2015	13/01/2016	1,400,000.00	1,509,667.60	1,426,135.56	(83,532.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	28/07/2015	25/01/2016	2,570,000.00	2,589,211.01	2,485,487.05	(83,723.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/07/2015	08/01/2016	2,130,000.00	2,460,610.23	2,375,233.87	(85,376.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	22/12/2015	20/01/2016	950,000.00	1,148,031.92	1,062,020.80	(86,011.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	04/12/2015	06/01/2016	9,700,000.00	9,920,643.28	9,831,518.90	(89,124.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0618	26/08/2015	22/02/2016	840,000.00	1,010,912.12	921,351.04	(89,561.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2015	28/07/2017	1,090,000.00	1,169,434.10	1,079,565.96	(89,868.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	11/09/2015	08/02/2016	2,200,000.00	2,240,213.80	2,150,330.94	(89,882.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	06/10/2015	03/02/2016	4,900,000.00	5,022,377.50	4,931,036.63	(91,340.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	10/02/2016	3,760,000.00	4,192,953.81	4,099,396.66	(93,557.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	26/01/2016	5,050,000.00	5,710,359.27	5,616,120.85	(94,238.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2015	16/02/2016	3,430,000.00	3,898,557.70	3,802,388.18	(96,169.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	02/12/2015	06/01/2016	4,800,000.00	4,961,812.80	4,865,081.52	(96,731.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/12/2015	07/01/2016	5,280,000.00	5,985,816.25	5,888,792.52	(97,023.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BA0118	30/11/2015	15/01/2016	9,970,000.00	9,872,196.68	9,771,240.14	(100,956.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/10/2015	11/01/2016	2,910,000.00	3,348,810.64	3,243,568.21	(105,242.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

S.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pcto.	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE0218	29/12/2015	10/02/2016	10,340,000.00	11,172,333.33	11,065,759.37	(106,573.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2015	11/01/2016	3,660,000.00	4,189,230.26	4,079,539.40	(109,690.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/10/2015	26/04/2016	3,040,000.00	3,437,791.80	3,328,081.35	(109,710.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	03/06/2016	4,300,000.00	4,787,349.80	4,677,154.78	(110,195.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	31/08/2015	26/02/2016	900,000.00	1,026,929.10	913,417.94	(113,511.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	21/10/2015	19/01/2016	2,200,000.00	2,267,135.20	2,152,935.79	(114,199.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	27/06/2016	4,580,000.00	5,077,402.18	4,961,311.42	(116,090.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/08/2015	19/02/2016	2,970,000.00	3,408,980.82	3,290,946.99	(118,033.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2015	15/02/2016	7,950,000.00	8,935,414.77	8,814,453.76	(120,961.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/10/2015	06/01/2016	4,800,000.00	5,477,012.80	5,354,255.78	(122,757.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2015	11/05/2016	11,720,000.00	12,923,393.26	12,797,999.15	(125,394.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	05/02/2016	6,870,000.00	7,757,209.00	7,628,583.55	(128,625.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
NO0218	19/10/2015	18/01/2016	6,190,000.00	6,794,002.98	6,655,526.67	(138,476.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	29/01/2016	9,780,000.00	11,013,249.42	10,871,429.58	(141,819.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	23/12/2015	22/01/2016	9,600,000.00	9,871,142.40	9,721,501.24	(149,641.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/11/2015	09/02/2016	5,860,000.00	6,653,217.22	6,503,113.71	(150,103.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/11/2015	05/01/2016	3,730,000.00	4,315,428.88	4,164,470.40	(150,958.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	15/09/2015	13/01/2016	4,380,000.00	5,035,594.15	4,880,597.07	(154,997.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/10/2015	23/03/2016	4,150,000.00	4,731,493.46	4,575,407.00	(156,086.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	09/12/2015	06/06/2016	1,700,000.00	2,049,021.90	1,891,747.84	(157,274.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	15/10/2015	13/01/2016	1,500,000.00	1,692,694.50	1,528,002.38	(164,692.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	20/04/2015	22/01/2016	1,000,000.00	1,375,837.00	1,210,696.92	(165,140.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/11/2015	05/01/2016	8,030,000.00	9,145,249.65	8,965,334.40	(179,915.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	03/05/2016	5,220,000.00	5,894,172.04	5,707,883.81	(186,288.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	14/03/2016	1,930,000.00	2,304,357.04	2,114,599.30	(189,757.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/11/2015	19/01/2016	9,990,000.00	11,313,258.71	11,121,682.43	(191,576.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0721	28/12/2015	15/01/2016	8,140,000.00	8,245,657.80	8,044,860.40	(200,797.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2015	15/01/2016	8,990,000.00	9,770,378.63	9,568,872.49	(201,506.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/12/2015	20/12/2016	5,160,000.00	5,594,666.35	5,389,401.89	(205,264.46)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	27/10/2015	25/04/2016	2,100,000.00	2,334,277.18	2,120,722.28	(213,554.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/11/2015	10/02/2016	8,320,000.00	9,446,231.49	9,231,689.18	(214,542.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1011	30/12/2015	10/02/2016	24,290,000.00	24,728,862.61	24,507,332.97	(221,529.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	13/10/2015	11/01/2016	5,200,000.00	6,661,574.40	6,439,849.21	(221,725.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	10/07/2015	20/01/2016	1,980,000.00	2,404,211.08	2,180,103.12	(224,107.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	16/11/2015	15/01/2016	2,400,000.00	3,139,852.80	2,908,519.51	(231,333.29)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	12/11/2015	10/02/2016	13,080,000.00	14,233,839.61	13,998,078.58	(235,761.03)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/01/2016	18,330,000.00	20,657,348.41	20,418,793.09	(238,555.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	10,230,000.00	11,659,967.69	11,399,202.75	(260,764.94)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/07/2015	18/07/2017	3,270,000.00	3,508,622.17	3,245,890.57	(262,731.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/03/2016	1,410,000.00	15,906,238.72	15,608,501.76	(297,736.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	21/10/2015	19/01/2016	12,930,000.00	14,196,144.76	13,867,481.04	(308,663.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	24/08/2015	19/02/2016	8,640,000.00	9,905,406.20	9,573,663.96	(331,742.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0119	21/12/2015	20/01/2016	3,790,000.00	4,589,866.03	4,247,242.14	(342,623.89)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/10/2015	07/01/2016	8,500,000.00	8,674,258.50	8,324,198.53	(350,058.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	28/12/2015	28/03/2016	4,900,000.00	5,282,337.41	4,912,117.97	(350,219.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	09/09/2015	07/03/2016	3,700,000.00	5,151,058.60	4,770,668.86	(380,389.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	11,150,000.00	12,827,381.02	12,424,351.00	(403,030.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0721	16/12/2015	15/01/2016	19,040,000.00	19,241,394.98	18,811,462.17	(429,932.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2015	26/01/2016	11,670,000.00	13,480,282.33	12,978,243.63	(502,038.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	26/11/2015	24/05/2016	10,800,000.00	11,393,244.00	10,843,731.56	(549,512.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	31,580,000.00	35,766,223.32	35,199,960.17	(566,263.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	31,580,000.00	35,766,223.32	35,199,960.17	(566,263.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	11/01/2016	31,580,000.00	35,766,223.32	35,199,960.17	(566,263.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	29/10/2015	27/01/2016	5,200,000.00	6,883,971.95	6,291,218.09	(572,753.86)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/12/2015	13/01/2016	31,300,000.00	35,486,953.66	34,877,326.12	(589,627.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/10/2015	07/01/2016	15,700,000.00	16,006,008.70	15,375,286.20	(630,722.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	13/10/2015	11/01/2016	5,200,000.00	7,079,581.60	6,439,849.21	(639,732.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	30/10/2015	27/04/2016	10,000,000.00	11,126,050.00	10,460,606.21	(665,443.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	28/12/2015	28/03/2016	5,300,000.00	7,480,933.83	6,813,759.63	(667,174.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	30/12/2015	29/03/2016	8,400,000.00	11,622,937.20	10,797,664.23	(825,272.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	02/11/2015	01/02/2016	40,330,000.00	44,283,154.97	43,240,325.26	(1,042,829.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	26/10/2015	26/01/2016	30,250,000.00	34,327,564.88	33,275,343.00	(1,052,221.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	23/12/2015	22/01/2016	51,800,000.00	53,380,543.87	52,160,899.91	(1,219,643.96)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	08/07/2015	05/02/2016	18,600,000.00	22,679,017.20	21,087,162.59	(1,591,854.61)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	30/12/2015	25/04/2016	17,800,000.00	22,921,487.20	21,266,867.98	(1,654,619.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/10/2015	06/10/2016	9,600,000.00	10,882,819.20	9,184,151.50	(1,698,667.70)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	26/10/2015	26/01/2016	61,560,000.00	67,883,432.34	66,055,993.24	(1,827,439.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2015	26/01/2016	59,770,000.00	69,013,841.02	68,470,404.59	(2,543,436.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	30/12/2015	22/02/2016	36,300,000.00	46,628,779.96	43,757,607.13	(2,871,172.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2015	05/02/2016	35,200,000.00	45,596,284.80	42,533,022.74	(3,063,262.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	06/05/2015	04/05/2016	119,200,000.00	165,093,549.60	145,463,677.95	(19,629,871.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	07/12/2015	07/03/2016	9,200,000.00	9,254,565.20	9,293,092.47	38,527.27	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	16/11/2015	15/01/2016	7,900,000.00	10,254,887.30	10,261,726.52	6,839.22	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	13/10/2015	11/01/2016	3,500,000.00	3,982,335.00	3,981,128.73	(1,206.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	24/11/2015	22/01/2016	300,000.00	391,019.84	380,350.20	(1,669.64)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	29/03/2016	270,000.00	301,305.80	297,404.37	(3,901.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	05/10/2015	04/01/2016	665,000.00	673,552.57	668,450.02	(5,102.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/03/2016	2,090,000.00	2,310,332.31	2,304,592.95	(5,739.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	22/12/2015	21/03/2016	975,000.00	982,773.68	975,865.23	(6,908.45)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	03/03/2016	450,000.00	508,323.52	497,643.54	(10,679.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	07/01/2016	2,179,000.00	2,115,037.63	2,104,237.56	(10,800.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2015	11/02/2016	690,000.00	780,980.20	765,492.68	(15,487.52)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no denominación	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	17/12/2015	14/06/2016	880.000.00	970.981.63	955.388.46	(15,593.17)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	14/12/2015	13/01/2016	2.870.000.00	2.900.023.02	2.883.326.60	(16,696.42)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	06/01/2016	1.190.000.00	1.349.076.58	1.327.409.25	(21,667.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	07/03/2016	1.000.000.00	1.127.918.76	1.105.201.16	(22,717.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/10/2015	05/01/2016	860.000.00	984.942.21	960.172.80	(24,769.41)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2015	11/02/2016	860.000.00	982.113.10	954.092.33	(28,020.77)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	26/11/2015	27/01/2016	3.900.000.00	3.976.408.80	3.948.260.24	(28,148.56)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/10/2015	22/04/2016	960.000.00	970.559.85	942.135.20	(28,424.65)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2015	18/04/2016	860.000.00	972.744.06	942.773.70	(29,970.36)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	30/12/2015	29/03/2016	900.000.00	1.043.991.24	1.013.197.43	(30,793.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	24/11/2015	22/01/2016	700.000.00	939.447.60	908.483.80	(30,963.80)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/03/2016	1.770.000.00	1.984.527.30	1.951.736.61	(32,790.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	16/12/2015	15/01/2016	6.674.000.00	6.482.436.18	6.449.242.03	(33,194.15)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/07/2015	01/07/2016	5.330.000.00	5.808.812.29	5.769.796.04	(39,016.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/11/2015	01/11/2016	860.000.00	946.339.43	906.783.00	(39,556.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	26/11/2015	24/05/2016	1.740.000.00	1.937.190.66	1.895.845.74	(41,344.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/11/2015	03/02/2016	1.280.000.00	1.466.771.74	1.421.768.21	(45,003.53)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	14/10/2015	13/10/2016	880.000.00	981.665.26	931.263.12	(50,402.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/12/2015	15/01/2016	4.370.000.00	4.926.266.71	4.867.982.86	(58,283.85)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	20/04/2016	1.720.000.00	1.944.047.73	1.884.908.90	(59,138.83)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	22/03/2016	4.300.000.00	4.802.482.76	4.741.507.03	(60,975.73)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30/12/2015	29/02/2016	7.100.000.00	8.802.037.56	8.737.635.28	(64,402.28)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2015	08/03/2016	6.510.000.00	7.263.042.44	7.193.763.68	(69,278.76)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	28/12/2015	27/01/2016	3.600.000.00	4.742.136.40	4.669.325.65	(72,810.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	19/02/2016	2.580.000.00	2.936.381.86	2.858.802.43	(77,579.43)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	13/10/2015	11/01/2016	1.800.000.00	1.842.391.80	1.762.345.42	(80,046.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30/12/2015	29/01/2016	7.300.000.00	9.103.027.00	9.019.695.29	(83,331.71)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	12/10/2015	06/01/2016	1.800.000.00	2.424.628.80	2.340.703.96	(83,924.84)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/10/2015	05/01/2016	3.070.000.00	3.517.502.73	3.427.593.60	(89,909.13)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	15/12/2015	14/03/2016	10.269.000.00	10.062.798.48	9.971.173.58	(91,624.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	06/01/2016	19.048.000.00	18.489.950.74	18.392.945.75	(97,004.99)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	22/12/2015	21/03/2016	18.998.000.00	18.575.197.04	18.457.546.56	(117,650.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	11/12/2015	08/04/2016	6.500.000.00	7.264.973.15	7.137.679.82	(127,293.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	28/10/2015	29/01/2016	11.300.000.00	13.800.622.20	13.667.471.09	(133,151.11)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	30/09/2015	28/01/2016	7.500.000.00	9.863.670.00	9.726.563.13	(137,106.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/12/2015	06/06/2016	5.800.000.00	6.446.351.12	6.305.490.79	(140,860.33)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	10.060.000.00	11.178.373.02	11.015.189.09	(163,183.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	21/10/2015	19/01/2016	12.300.000.00	14.140.178.40	13.976.075.89	(164,102.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	21/10/2015	19/01/2016	12.600.000.00	14.489.785.80	14.316.955.79	(172,830.01)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
BC00720	14/10/2015	08/01/2016	11,800,000.00	14,496,872.40	14,315,910.17	(182,962.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	27/06/2016	11,280,000.00	12,407,391.87	12,219,125.08	(188,266.79)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00720	03/11/2015	01/02/2016	7,600,000.00	9,380,292.40	9,188,417.80	(191,874.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	25/05/2016	11,800,000.00	13,052,641.86	12,854,694.70	(197,947.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00419	23/12/2015	22/01/2016	16,900,000.00	19,403,650.50	19,195,302.24	(208,348.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/11/2015	10/05/2016	7,250,000.00	8,133,587.71	7,918,196.69	(215,391.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/10/2015	13/04/2016	10,060,000.00	11,254,032.84	11,037,595.96	(216,436.88)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	08/01/2016	19,540,000.00	22,029,471.13	21,789,704.16	(239,766.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	29/12/2015	08/01/2016	19,540,000.00	22,029,471.13	21,789,704.16	(239,766.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	13/10/2015	07/10/2016	2,200,000.00	2,368,678.40	2,104,520.28	(264,158.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	04/04/2016	13,640,000.00	15,288,720.63	15,010,651.16	(278,069.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00618	28/10/2015	26/04/2016	3,300,000.00	3,632,029.30	3,540,240.12	(291,789.18)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	09/12/2015	08/03/2016	5,000,000.00	5,324,663.60	5,018,791.35	(305,872.25)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	20,350,000.00	22,726,683.65	22,412,051.78	(314,631.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	20,350,000.00	22,726,683.65	22,412,051.78	(314,631.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	20,350,000.00	22,726,683.65	22,412,051.78	(314,631.87)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	20/04/2016	14,560,000.00	16,278,627.45	15,955,972.97	(322,654.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	14/12/2015	14/03/2016	41,122,000.00	40,261,316.54	39,929,360.20	(331,956.34)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00621	21/10/2015	19/01/2016	19,200,000.00	24,172,147.20	23,753,517.85	(418,629.35)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	30/11/2015	29/03/2016	12,400,000.00	12,493,768.80	12,070,655.26	(423,113.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	20/04/2016	20,680,000.00	23,118,924.52	22,662,741.83	(456,182.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00729	20/11/2015	18/02/2016	5,600,000.00	6,158,047.56	5,687,317.17	(470,730.39)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00720	11/11/2015	09/02/2016	5,300,000.00	6,896,534.90	6,400,527.39	(496,007.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00720	07/10/2015	05/01/2016	39,100,000.00	48,084,749.90	47,484,017.50	(600,732.40)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00720	09/10/2015	07/01/2016	39,100,000.00	48,050,450.62	47,442,542.60	(607,908.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00419	09/07/2015	05/01/2016	7,800,000.00	9,556,006.20	8,895,089.20	(670,917.00)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00621	03/11/2015	01/02/2016	8,700,000.00	11,505,654.30	10,745,356.00	(760,298.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00222	16/11/2015	15/02/2016	8,300,000.00	11,518,266.90	10,732,936.66	(785,330.24)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00621	14/10/2015	11/04/2016	9,800,000.00	12,790,598.20	11,995,048.66	(795,509.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00729	21/10/2015	19/01/2016	10,100,000.00	11,289,214.40	10,283,371.62	(1,005,842.78)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00721	14/12/2015	29/01/2016	67,500,000.00	67,694,227.10	66,643,787.56	(1,050,439.54)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00419	30/12/2015	29/03/2016	96,100,000.00	109,384,671.80	108,186,970.23	(1,197,701.57)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00222	08/12/2015	07/03/2016	15,000,000.00	20,735,176.80	19,340,549.42	(1,394,627.38)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	31/07/2015	27/01/2016	23,909,000.00	25,500,239.59	24,005,997.29	(1,494,242.30)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00222	21/09/2015	18/03/2016	21,700,000.00	29,844,359.51	27,936,647.04	(1,907,712.47)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	26/08/2015	22/02/2016	26,800,000.00	30,440,940.80	28,168,593.76	(2,272,347.04)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00419	14/08/2015	10/02/2016	44,300,000.00	54,019,464.30	50,190,528.14	(3,828,936.16)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00222	18/11/2015	18/01/2016	11,200,000.00	14,516,241.60	14,542,900.61	26,659.01	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00222	16/11/2015	15/01/2016	3,700,000.00	4,795,473.80	4,806,125.08	10,651.28	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC00720	07/08/2015	07/01/2016	800,000.00	965,350.71	970,691.41	5,340.70	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
ADM116	17/12/2015	05/01/2016	9,254,000.00	8,963,313.35	8,931,359.29	(31,954.06)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	11/12/2015	09/02/2016	8,237,000.00	8,009,204.69	7,975,919.49	(33,265.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/12/2015	27/01/2016	3,930,000.00	4,405,890.34	4,369,903.76	(35,986.58)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	18/11/2015	18/01/2016	7,000,000.00	9,131,633.00	9,089,312.88	(42,320.12)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/12/2015	20/01/2016	3,950,000.00	4,441,475.27	4,396,797.08	(44,678.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	21/10/2015	19/01/2016	300,000.00	398,258.40	340,879.90	(57,378.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	18/12/2015	18/01/2016	19,626,000.00	19,037,494.76	18,969,726.57	(67,768.19)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	28/12/2015	26/02/2016	4,200,000.00	4,826,103.74	4,748,398.19	(77,705.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	08/12/2015	05/02/2016	10,000,000.00	11,415,590.00	11,337,184.19	(78,405.81)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	16/12/2015	15/02/2016	15,426,000.00	15,029,860.32	14,944,389.05	(85,471.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	07/01/2016	5,890,000.00	6,658,182.77	6,569,126.51	(89,056.26)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0618	21/10/2015	19/01/2016	6,600,000.00	7,280,163.00	7,170,755.63	(109,407.37)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/12/2015	13/01/2016	11,780,000.00	13,244,506.44	13,126,354.69	(118,151.75)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2015	05/02/2016	8,100,000.00	9,927,991.80	9,787,428.53	(140,563.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	18/02/2016	26,617,000.00	25,937,840.63	25,792,323.94	(145,516.69)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	23/12/2015	22/03/2016	26,729,000.00	26,123,961.29	25,970,733.31	(153,227.98)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	01/12/2015	29/01/2016	19,500,000.00	19,903,143.00	19,739,101.92	(164,041.08)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	12/11/2015	22/01/2016	18,900,000.00	23,558,245.20	23,373,366.93	(184,878.27)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	26/11/2015	26/01/2016	11,600,000.00	14,234,223.47	14,036,221.45	(198,002.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	08/12/2015	05/02/2016	23,300,000.00	26,628,894.30	26,415,639.16	(213,255.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	23/12/2015	05/02/2016	11,700,000.00	14,358,906.90	14,137,396.76	(221,510.14)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	18/12/2015	18/01/2016	21,400,000.00	25,030,997.55	27,787,327.95	(243,669.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	03/12/2015	01/02/2016	35,652,000.00	34,753,783.51	34,499,376.03	(254,407.48)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	20/01/2016	59,599,000.00	57,872,059.38	57,615,513.46	(256,545.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	06/10/2015	04/01/2016	28,100,000.00	28,749,194.30	28,490,505.70	(258,688.60)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	30/11/2015	29/01/2016	23,300,000.00	29,096,747.35	28,788,890.45	(307,856.90)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0122	22/12/2015	06/01/2016	41,430,000.00	42,814,301.27	42,402,624.25	(411,677.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0322	28/12/2015	28/03/2016	28,500,000.00	29,057,069.55	28,570,482.04	(486,587.51)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	28/12/2015	26/02/2016	5,700,000.00	7,912,620.30	7,359,600.75	(553,019.55)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	20/11/2015	19/01/2016	23,000,000.00	23,995,532.00	23,417,578.93	(577,953.07)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	18/12/2015	28/01/2016	22,900,000.00	24,698,337.00	24,113,526.77	(584,810.23)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	10/11/2015	08/01/2016	41,400,000.00	50,935,951.80	50,227,006.88	(708,944.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	28/12/2015	27/06/2016	6,000,000.00	8,328,970.70	7,616,061.77	(712,908.93)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	02/11/2015	05/01/2016	26,300,000.00	28,474,852.20	27,750,418.70	(724,433.50)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	04/09/2015	02/03/2016	11,800,000.00	15,604,131.20	14,517,956.76	(1,086,174.44)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CIE011	21/07/2015	18/01/2016	14,820,000.00	16,091,625.76	14,978,777.02	(1,112,848.74)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0518	21/07/2015	18/01/2016	17,780,000.00	21,456,834.56	19,583,113.64	(1,873,720.92)	DOP	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en DOP (continuación)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00222	25/09/2015	23/03/2016	19,500,000.00	27,121,790.33	25,086,926.61	(2,034,863.72)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	28/10/2015	25/04/2016	19,200,000.00	21,801,430.78	19,389,460.81	(2,411,969.97)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00419	17/07/2015	13/01/2016	33,900,000.00	41,539,161.60	38,549,913.69	(2,989,247.91)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			3,208,715,000.00	3,630,777,774.73	3,520,040,992.87	(110,736,781.86)		

1ro. de enero de 2016

5.- Contratos de compra forward

a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00145	08/12/2015	26/01/2016	2,000.00	1,943.18	1,894.31	(48.87)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	03/12/2015	29/01/2016	64,000.00	74,605.63	73,810.90	(794.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	08/12/2015	16/02/2016	73,000.00	85,039.89	84,043.17	(996.72)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00145	08/12/2015	16/02/2016	61,000.00	59,177.44	57,656.53	(1,520.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00145	21/12/2015	20/12/2016	9,000.00	10,230.11	8,230.00	(2,000.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	11/12/2015	11/01/2016	89,000.00	97,680.10	92,232.07	(5,448.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	23/12/2015	22/01/2016	192,000.00	223,409.83	215,696.49	(7,713.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	21/12/2015	20/01/2016	210,000.00	247,380.42	235,951.44	(11,428.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	16/12/2015	15/01/2016	214,000.00	253,393.33	240,530.85	(12,862.48)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00223	22/12/2015	19/02/2016	243,000.00	261,763.97	239,608.02	(22,155.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	10/11/2015	08/01/2016	68,000.00	74,074.67	70,485.72	(3,588.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	19/10/2015	28/01/2016	104,000.00	120,838.74	116,785.97	(4,052.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	16/10/2015	14/01/2016	91,000.00	98,613.61	94,282.92	(4,330.69)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	30/10/2015	28/01/2016	91,000.00	98,515.60	94,173.09	(4,342.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00124	23/11/2015	12/01/2016	137,000.00	147,832.86	141,964.27	(5,868.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	27/11/2015	12/01/2016	78,000.00	96,273.84	90,123.41	(6,150.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00723	30/10/2015	28/01/2016	167,000.00	196,888.99	187,531.31	(9,357.68)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00427	30/10/2015	28/01/2016	100,000.00	125,118.64	115,342.08	(9,776.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,993,000.00	2,272,780.85	2,160,342.55	(112,438.32)		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2015 fue de DOP 45.5544 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)
1ro. de enero de 2016

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

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 Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

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
BO0621	07/05/2015	04/05/2016	119,200,000.00	173.011,042.20	174,703,837.49	1,692,795.29	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0419	09/07/2015	05/02/2016	18,600,000.00	23,619,208.98	23,736,392.57	117,183.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2015	13/01/2016	1,500,000.00	1,695,957.82	1,698,483.82	2,506.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	12/01/2016	58,000,000.00	56,524,864.51	56,526,993.29	2,128.78	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	95,345,411.37	95,349,002.16	3,590.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	95,345,411.37	95,349,002.16	3,590.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	95,345,411.37	95,349,002.16	3,590.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	95,345,411.37	95,349,002.16	3,590.79	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	08/01/2016	50,000,000.00	48,648,157.57	48,690,117.06	41,959.49	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	09/12/2015	08/01/2016	30,000,000.00	31,324,405.89	31,351,423.48	27,017.59	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	09/12/2015	08/01/2016	37,000,000.00	38,088,171.01	38,121,022.41	32,851.40	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	20/01/2016	51,865,000.00	50,487,836.46	50,517,163.33	29,326.87	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0122	22/12/2015	06/01/2016	127,000,000.00	139,985,100.32	139,979,200.00	(5,900.32)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BO0122	22/12/2015	06/01/2016	39,070,000.00	42,899,496.99	42,897,688.79	(1,808.20)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	31/12/2015	05/01/2016	3,120,000.00	3,645,599.97	3,646,597.41	997.44	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			835,355,000.00	991,311,487.20	993,264,908.29	1,953,421.09		

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
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

6. Contratos de venta forward:

a) Títulos Valores de Deuda en DOP

Contratos de venta NADA QUE REPORTAR	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superavit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		
Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superavit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
B00621	07/05/2015	04/05/2016	119,200,000.00	165,093,549.60	145,463,677.95	19,629,871.65	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00419	09/07/2015	05/02/2016	18,600,000.00	22,679,017.20	21,087,162.59	1,591,854.61	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	13/10/2015	11/01/2016	5,200,000.00	7,079,581.60	6,439,849.21	639,732.39	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0721	28/12/2015	15/01/2016	19,040,000.00	19,241,395.21	18,817,462.17	423,933.04	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	18/11/2015	10/02/2016	8,320,000.00	9,446,231.49	9,231,689.18	214,542.31	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2015	03/05/2016	5,220,000.00	5,894,172.04	5,707,883.81	186,288.23	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00729	24/11/2015	13/01/2016	1,500,000.00	1,692,894.50	1,528,002.38	164,892.12	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	09/10/2015	04/04/2016	500,000.00	607,151.92	552,873.25	54,278.67	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	19/08/2016	220,000.00	243,295.77	236,152.05	7,143.72	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	01/12/2015	27/01/2016	220,000.00	246,835.35	244,625.66	2,209.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	24/04/2015	17/02/2016	60,000.00	64,129.67	66,503.98	(2,374.31)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	94,070,718.75	92,870,532.86	1,200,185.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	94,070,718.75	92,870,532.86	1,200,185.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00621	04/12/2015	12/01/2016	75,000,000.00	94,070,718.75	92,870,532.86	1,200,185.90	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	12/01/2016	58,000,000.00	55,978,143.20	56,032,969.42	(54,826.22)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	09/12/2015	08/01/2016	37,000,000.00	37,467,865.00	37,497,497.02	(29,632.02)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	09/12/2015	08/01/2016	30,000,000.00	30,083,310.00	30,145,586.10	(62,276.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	08/01/2016	50,000,000.00	48,204,168.50	48,288,439.32	(84,270.82)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	21/12/2015	20/01/2016	51,865,000.00	49,942,262.01	50,138,905.11	(196,643.10)	DOP	Alpha Sociedad de Valores
MH0524	28/12/2015	05/01/2016	210,300,000.00	224,460,999.39	221,897,834.70	2,563,164.69	DOP	Alpha Sociedad de Valores
BC0122	22/12/2015	06/01/2016	127,000,000.00	132,344,223.61	129,981,493.61	2,362,730.00	DOP	Alpha Sociedad de Valores
B00122	22/12/2015	06/01/2016	39,070,000.00	40,715,858.64	39,962,937.39	752,921.25	DOP	Alpha Sociedad de Valores
Total			1,081,315,000.00	1,227,767,759.70	1,194,803,676.34	32,964,083.40		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

6.- Contratos de venta forward (continuación)

a) Títulos Valores de deuda en USD (*)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
PR0119	07/12/2015	18/01/2016	4,322,000.00	1,308,403.17	955,891.26	352,511.91	USD	Alpha Sociedad de Valores
PR0119	18/12/2015	18/01/2016	4,478,000.00	1,174,690.23	990,393.58	184,296.65	USD	Alpha Sociedad de Valores
OD1022	07/12/2015	18/01/2016	5,449,000.00	1,392,659.54	1,248,331.09	144,328.45	USD	Alpha Sociedad de Valores
PR1221	07/12/2015	18/01/2016	60,000.00	16,476.88	10,587.66	5,889.22	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	18/12/2015	18/01/2016	244,000.00	243,224.27	241,332.24	1,892.03	USD	Alpha Sociedad de Valores
BR0223	29/12/2015	13/01/2016	1,000,000.00	972,613.00	989,543.08	(16,930.08)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			15,553,000.00	5,108,067.09	4,436,078.91	671,988.18		

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2015 fue de DOP 44.5544 por USD1.00

b) Acciones

Contratos de compra	Fecha de Pacto	Fecha de Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

c) Divisas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

d) Divisas Implícitas

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE1018	15/04/2015	15/04/2016	1,140,000.00	1,238,448.20	1,252,940.76	(14,492.56)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00621	06/05/2015	04/05/2016	119,200,000.00	173,011,042.20	174,703,837.49	(1,692,795.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/07/2015	01/07/2016	5,330,000.00	6,005,730.24	6,082,069.85	(76,339.61)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00419	08/07/2015	05/02/2016	18,600,000.00	23,619,208.98	23,736,392.57	(117,183.59)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00419	09/07/2015	05/01/2016	7,800,000.00	9,850,910.31	9,877,448.40	(26,538.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2015	04/02/2016	940,000.00	1,105,761.76	1,107,463.80	(1,702.04)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	10/08/2015	04/08/2016	2,230,000.00	2,536,636.29	2,571,750.54	(35,114.25)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/09/2015	01/03/2016	220,000.00	266,479.04	268,085.40	(1,606.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/09/2015	14/03/2016	1,310,000.00	1,567,903.67	1,574,654.79	(6,751.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00222	21/09/2015	18/03/2016	21,700,000.00	30,276,491.88	30,521,530.29	(245,038.41)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/09/2015	18/03/2016	4,100,000.00	4,892,405.80	4,920,138.23	(27,732.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	20,350,000.00	24,252,099.63	24,467,548.43	(215,448.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	20,350,000.00	24,252,099.63	24,467,548.43	(215,448.80)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/10/2015	30/03/2016	2,930,000.00	3,511,043.46	3,529,092.29	(18,048.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	05/10/2015	04/01/2016	665,000.00	700,334.76	700,440.13	(105.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	08/10/2015	06/01/2016	4,800,000.00	5,666,061.98	5,674,535.98	(8,474.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/10/2015	07/01/2016	3,110,000.00	3,673,118.22	3,683,920.04	(10,801.82)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/10/2015	07/01/2016	8,500,000.00	8,970,626.33	8,993,050.47	(22,424.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	09/10/2015	07/01/2016	15,700,000.00	16,553,417.51	16,594,796.58	(41,379.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	12/10/2015	11/01/2016	810,000.00	933,221.15	935,602.69	(2,381.54)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	04/04/2016	13,640,000.00	16,340,044.13	16,505,927.31	(165,883.18)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	12/10/2015	11/04/2016	310,000.00	350,854.22	354,402.05	(3,547.83)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0218	13/10/2015	11/04/2016	240,000.00	279,237.13	282,493.86	(3,256.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0326	13/10/2015	07/10/2016	2,200,000.00	2,388,064.02	2,460,221.62	(72,157.60)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00621	14/10/2015	11/04/2016	9,800,000.00	13,341,486.89	13,476,395.85	(134,908.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00729	15/10/2015	13/01/2016	1,500,000.00	1,695,957.82	1,698,463.82	(2,506.00)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	16/10/2015	13/04/2016	10,060,000.00	11,288,115.90	11,412,482.42	(124,366.52)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	19/10/2015	17/03/2016	217,000.00	214,099.36	216,327.79	(2,228.43)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	19/10/2015	18/01/2016	2,800,000.00	3,321,493.75	3,335,030.95	(13,537.20)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	20/10/2015	18/01/2016	2,747,000.00	2,759,056.31	2,766,650.48	(7,594.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	20/10/2015	18/01/2016	1,730,000.00	2,037,269.67	2,041,980.17	(4,710.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	21/10/2015	19/01/2016	1,490,000.00	1,753,399.81	1,757,669.39	(4,269.58)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	20/04/2016	14,560,000.00	16,371,119.25	16,565,306.36	(194,187.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/10/2015	20/04/2016	20,680,000.00	23,250,293.37	23,526,078.26	(275,784.89)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	10,060,000.00	11,263,580.67	11,386,499.94	(122,919.27)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	680,000.00	758,213.03	766,319.71	(8,106.68)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/10/2015	25/04/2016	4,300,000.00	4,812,587.47	4,864,042.81	(51,455.34)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	28/10/2015	25/04/2016	2,540,000.00	2,847,704.24	2,875,634.98	(27,930.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
MH0524	30/10/2015	27/04/2016	10,000,000.00	11,657,060.93	11,797,402.16	(140,341.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0621	03/11/2015	01/02/2016	8,700,000.00	11,729,346.51	11,758,546.90	(29,200.39)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	01/02/2016	410,000.00	487,703.08	487,741.17	(38.09)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	03/11/2015	02/03/2016	660,000.00	787,155.26	790,955.81	(3,800.55)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/11/2015	03/05/2016	211,000.00	210,096.03	212,358.35	(2,262.32)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/11/2015	03/03/2016	780,000.00	927,484.11	930,648.75	(3,164.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	05/11/2015	03/02/2016	3,130,000.00	3,685,503.86	3,694,770.81	(9,266.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/11/2015	05/01/2016	1,740,000.00	2,065,892.32	2,064,192.69	1,699.63	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	06/11/2015	04/05/2016	660,000.00	743,384.62	750,658.13	(7,273.51)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	10/11/2015	09/03/2016	144,000.00	142,347.18	143,280.91	(933.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	11/11/2015	09/02/2016	5,300,000.00	6,966,043.10	6,991,731.39	(25,688.29)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	13/11/2015	11/05/2016	11,720,000.00	13,102,075.23	13,235,464.96	(133,389.73)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	17/11/2015	15/02/2016	7,950,000.00	9,383,199.61	9,414,356.73	(31,157.12)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	22/02/2016	790,000.00	933,074.25	936,968.36	(3,894.11)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	23/11/2015	20/05/2016	1,610,000.00	1,795,446.87	1,818,433.84	(22,986.97)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0222	24/11/2015	22/01/2016	300,000.00	414,842.71	415,458.46	(615.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0729	24/11/2015	13/01/2016	1,400,000.00	1,512,713.37	1,514,948.60	(2,235.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	25/11/2015	26/01/2016	4,693,000.00	4,590,660.82	4,608,819.80	(18,158.98)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	25/11/2015	23/02/2016	350,000.00	414,891.78	416,673.81	(1,782.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	26/11/2015	24/05/2016	10,800,000.00	11,436,207.93	11,623,659.24	(187,451.31)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	27/11/2015	25/02/2016	1,533,000.00	1,506,798.21	1,512,643.12	(5,844.91)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	27/11/2015	25/02/2016	117,000.00	115,262.92	115,811.42	(548.50)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	27/11/2015	25/05/2016	11,800,000.00	13,302,505.25	13,306,252.91	(3,747.66)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2015	29/11/2016	680,000.00	732,103.79	752,467.82	(20,364.03)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	30/11/2015	29/11/2016	3,920,000.00	4,202,931.04	4,319,838.81	(116,907.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	02/12/2015	01/03/2016	454,000.00	446,810.62	448,422.79	(1,612.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0118	02/12/2015	30/05/2016	480,000.00	557,905.06	563,742.42	(5,837.36)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	05/01/2016	4,110,000.00	4,807,154.29	4,801,094.58	6,059.71	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	02/12/2015	01/03/2016	2,090,000.00	2,465,782.88	2,482,823.82	(17,040.94)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	04/12/2015	06/01/2016	67,000.00	65,178.51	65,118.63	59.88	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	06/01/2016	1,170,000.00	1,373,178.24	1,372,217.39	960.85	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	04/12/2015	06/01/2016	1,190,000.00	1,395,945.02	1,393,441.01	2,504.01	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	07/12/2015	07/03/2016	253,000.00	249,487.57	250,514.59	(1,027.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
BO0720	07/12/2015	05/02/2016	35,200,000.00	45,996,372.23	46,113,168.24	(116,796.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	07/12/2015	07/01/2016	5,890,000.00	6,892,656.27	6,884,153.72	8,502.55	USD	Alpha Sociedad de Valores
MH0519	07/12/2015	07/03/2016	9,200,000.00	9,563,041.70	9,591,922.90	(28,881.20)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	09/12/2015	07/04/2016	267,000.00	264,172.43	265,263.83	(1,091.40)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	09/12/2015	06/06/2016	230,000.00	290,858.91	293,568.52	(2,709.61)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE1018	09/12/2015	08/03/2016	6,510,000.00	7,690,372.36	7,717,900.10	(27,527.74)	USD	Alpha Sociedad de Valores

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

d) Divisas Implícitas (continuación)

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto nominal	Precio pactado	Valor de mercado	Superávit no realizado	Moneda de denominación	Mecanismo centralizado de negociación
CE 1018	09/12/2015	08/12/2016	980.000.00	1.053.350.73	1.086.326.87	(32.976.14)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	10/12/2015	09/03/2016	140.000.00	1.38.473.60	1.39.107.61	(634.01)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	10/12/2015	09/03/2016	2.107.000.00	2.209.656.97	2.200.934.95	8.722.02	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	10/12/2015	11/01/2016	2.360.000.00	2.766.404.25	2.754.094.55	12.309.70	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	10/12/2015	11/01/2016	780.000.00	919.332.49	915.241.72	4.090.77	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	11/12/2015	11/01/2016	1.930.000.00	2.258.207.73	2.250.615.29	7.592.44	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	14/12/2015	13/01/2016	1.950.000.00	2.286.449.81	2.279.820.35	6.629.46	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	14/12/2015	14/03/2016	240.000.00	281.439.52	281.686.73	(227.21)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM117	15/12/2015	14/01/2016	878.000.00	922.007.27	922.470.65	(463.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	15/12/2015	14/03/2016	9.650.000.00	11.363.954.60	11.400.431.75	(36.477.15)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	15/12/2015	14/12/2016	1.380.000.00	1.473.674.87	1.519.169.44	(45.494.57)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	16/12/2015	15/03/2016	468.000.00	461.709.51	464.260.57	(2.551.06)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	16/12/2015	15/01/2016	1.570.000.00	1.830.476.61	1.830.417.39	59.22	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	16/12/2015	15/01/2016	430.000.00	507.360.56	507.455.33	(94.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	16/12/2015	15/01/2016	1.660.000.00	1.933.399.34	1.933.760.49	(361.15)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	17/12/2015	14/06/2016	390.000.00	437.691.36	443.920.46	(6.229.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	18/12/2015	16/12/2016	3.920.000.00	4.198.780.32	4.342.570.07	(143.789.75)	USD	Alpha Sociedad de Valores
ADM116	22/12/2015	03/03/2016	235.000.00	230.358.62	231.296.29	(937.67)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE0719	22/12/2015	20/01/2016	950.000.00	1.154.872.08	1.152.764.56	2.107.52	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	22/12/2015	20/06/2016	4.980.000.00	5.560.605.58	5.637.550.81	(76.945.23)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	23/12/2015	13/01/2016	11.780.000.00	13.743.386.22	13.745.591.71	(2.205.49)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	23/12/2015	22/03/2016	1.280.000.00	1.512.549.67	1.522.854.31	(10.304.64)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	23/12/2015	22/03/2016	2.090.000.00	2.459.915.78	2.474.508.73	(14.592.95)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	28/12/2015	27/01/2016	3.930.000.00	4.595.625.59	4.603.244.52	(7.618.93)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	28/12/2015	27/06/2016	3.970.000.00	4.450.757.06	4.518.004.02	(67.246.96)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	29/12/2015	08/01/2016	19.540.000.00	22.815.609.11	22.820.261.28	(4.652.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	29/12/2015	08/01/2016	19.540.000.00	22.815.609.11	22.820.261.28	(4.652.17)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	29/12/2015	28/01/2016	4.020.000.00	4.710.414.61	4.720.868.77	(10.455.16)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	29/12/2015	27/06/2016	390.000.00	437.971.78	443.718.16	(5.746.38)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00222	30/12/2015	29/03/2016	8.400.000.00	11.833.006.05	11.910.604.86	(77.598.81)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00621	30/12/2015	29/01/2016	7.300.000.00	9.281.178.91	9.304.956.01	(23.777.10)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00621	30/12/2015	29/02/2016	7.100.000.00	9.071.226.49	9.102.855.79	(31.629.30)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00720	30/12/2015	22/02/2016	36.300.000.00	47.311.140.62	47.477.395.99	(166.255.37)	USD	Alpha Sociedad de Valores
B00720	30/12/2015	25/04/2016	17.800.000.00	23.746.317.80	23.942.592.02	(196.274.22)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	30/12/2015	20/01/2016	3.950.000.00	4.620.466.39	4.624.163.46	(3.697.07)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	30/12/2015	27/06/2016	8.640.000.00	9.675.623.50	9.821.813.52	(146.190.02)	USD	Alpha Sociedad de Valores
CE 1018	31/12/2015	04/01/2017	3.120.000.00	3.362.297.96	3.487.786.73	(125.488.77)	USD	Alpha Sociedad de Valores
Total			732,346,000.00	905,542,687.05	911,915,138.87	(6,372,451.82)		

e) Oro

Contratos de venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

7.- Contratos de compra de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.6

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Compra	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

8.- Contratos de venta de futuros

a) Títulos Valores de deuda Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

b) Acciones Cuenta 6.1.5

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Ejecutado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

c) Divisas Cuenta 6.1.3

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha Valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

d) Oro Cuenta 6.1.4

Contratos de Venta	Fecha de Pacto	Fecha valor	Monto Nominal	Precio Pactado	Valor de Mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación
NADA QUE REPORTAR			0.00	0.00	0.00	0.00		
Total			0.00	0.00	0.00	0.00		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

9. Inversiones en otras obligaciones DOP

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
Total		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	

9. Inversiones en otras obligaciones USD (*)

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
Total		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2015 fue de DOP45.5544 por USD1.00.

1ro. de enero de 2016

10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

a) Títulos Valores de Deuda

En DOP

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
D01002213424	BCRD 10.01.2020 (R)	1,560,000.00	1,559,660.93	1,539,128.76	(20,532.17)	DOP	OTC	0.08%
D01002246622	BCRD 03.03.2017 (R)	10,000,000.00	10,630,582.84	10,524,620.00	(105,962.84)	DOP	OTC	0.49%
D01002212822	BCRD 30.07.2021 (R)	193,080,000.00	189,061,812.12	191,029,490.40	1,967,678.28	DOP	OTC	9.51%
D01005241026	MH1 2019 (R)	88,000,000.00	100,252,263.89	100,242,032.00	(10,231.89)	DOP	OTC	4.33%
D01005204115	MH5 2019 (R)	137,000,000.00	138,908,399.70	138,903,889.00	(4,510.70)	DOP	OTC	6.74%
D01005239624	AMD1 2016 (R)	257,700,000.00	248,688,916.96	248,715,289.50	26,372.54	DOP	OTC	12.69%
D01005224329	MH1 2020 (R)	373,800,000.00	453,971,169.09	453,952,065.00	(19,104.09)	DOP	OTC	18.40%
D01005234625	MH1 2021 (R)	458,200,000.00	568,350,533.71	568,250,017.80	(100,515.91)	DOP	OTC	22.56%
D01005241125	MH1 2022 (R)	311,100,000.00	404,873,234.79	404,849,985.00	(23,249.79)	DOP	OTC	15.32%
D01005204412	MH1 2029 (R)	57,500,000.00	58,637,062.50	58,637,292.50	230.00	DOP	OTC	2.83%
D01005204214	MH5 2024	13,800,000.00	14,560,787.65	14,561,056.20	268.55	DOP	OTC	0.68%
D01005205013	MH1 2026	129,600,000.00	129,023,265.98	126,973,267.20	(2,049,998.78)	DOP	OTC	6.38%
Total		2,031,340,000.00	2,318,517,690.16	2,318,178,133.36	(339,556.80)			100.00%

En USD (*)

Código ISIN	Títulos Valores de Deuda	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
D01005244525	MH CDEEE 2023 (R)	2,223,000.00	2,501,523.20	2,501,250.69	(272.51)	DOP	OTC	100.00%
Total		2,223,000.00	2,501,523.20	2,501,250.69	(272.51)			100.00%

(*) El tipo de cambio al cierre del 31-12-2015 fue de DOP45.5544 por USD1.00.

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO I - ESTADO DE CARTERA DE INVERSIÓN
31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016
(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

1ro. de enero de 2016

10. Depósitos y Títulos Valores de Disponibilidad Restringida

b) Acciones

Código ISIN	Acciones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Bolsa de Valores	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

c) Inversiones en otras obligaciones

Código ISIN	Otras Inversiones	Valor Nominal	Costo Amortizado	Valor de mercado	Superávit no Realizado	Moneda de Denominación	Mecanismo Centralizado de Negociación	Porcentaje de Participación
NADA QUE REPORTAR		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Total		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO II - ESTADO DE CUSTODIA

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADOS DE CUSTODIA

A continuación presentamos los estados de cartera de custodia de la Compañía al 31 de diciembre de 2017, 2016 y 31 de diciembre de 2017.

Tipos de Clientes	31 de diciembre de 2017					
	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Títulos	Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	2,183	969	1,214	-	5,244,337,148	240,409,687 DOP
Personas Jurídicas DOP	255	35	220	-	1,375,012,296	48,981,305 DOP
Clientes Profesionales DOP	85	35	50	-	12,789,506,515	487,767,197 DOP
Personas Físicas USD	109	109	-	-	12,349,246	170,886 USD
Personas Jurídicas USD	4	4	-	-	2,323,861	25,813 USD
Clientes Profesionales USD	11	11	-	-	13,374,894	157,281 USD
Total Clientes	2,523	1,039	1,484	-	19,408,855,958	777,158,189
Total USD	124	124	-	-	28,048,001	353,979
Tipos de Clientes	31 de diciembre de 2016					
	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		Cantidad de Títulos	Cantidad de Valor Nominal	Fruto devengado
		Activos	Inactivos			
Personas Físicas DOP	1,792	923	869	-	5,277,223,525	230,595,042 DOP
Personas Físicas USD	62	62	-	-	6,938,970	133,165 USD
Personas Jurídicas DOP	213	33	180	-	2,629,710,000	101,088,753 DOP
Personas Jurídicas USD	2	2	-	-	1,335,000	33,709 USD
Clientes Profesionales DOP	74	34	40	-	7,545,927,368	294,726,686 DOP
Clientes Profesionales USD	10	10	-	-	4,594,551	96,625 USD
Total Clientes	2,079	990	1,089	-	15,452,860,893	626,410,481
Total USD	74	74	-	-	12,868,521	263,499

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO II - ESTADO DE CUSTODIA

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADOS DE CUSTODIA (CONTINUACIÓN)

Tipos de Clientes	Cantidad de Clientes	Cantidad de clientes mandantes		1ro. de enero de 2016		Fruto devengado	Moneda de Denominación
		Activos	Inactivos	Cantidad de Títulos	Cantidad de Valor Nominal		
Personas Físicas DOP	1,464	867	597		32,443,492	4,556,464,757	DOP
Personas Físicas USD	55	55	-		724,438	3,824,290	USD
Personas Jurídicas DOP	177	30	147		3,196,969	1,013,785,000	DOP
Personas Jurídicas USD	3	3	-		602	602,000	USD
Clientes Profesionales DOP	73	32	41		324,038,786	5,342,868,896	DOP
Clientes Profesionales USD	7	7	-		2,738,212	41,982,928	USD
Total Clientes	1,714	929	785		359,679,247	10,913,118,653	DOP
Total USD	65	65	-		3,463,252	46,409,218	USD
							USD

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manuel Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO III - ESTADO DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

ESTADO DE OTROS RESULTADOS INTEGRALES

A continuación presentamos los estados de otros resultados integrales, comprendidos durante los años terminados al 31 de diciembre de 2017 y 2016.

	Notas	2017	2016
Utilidad neta		580,949,152	269,376,281
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		580,949,152	269,376,281

Santiago Camarena
Vicepresidente Ejecutivo

Juan Manual Barranco
Vicepresidente de Finanzas

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.*Información Suplementaria***ANEXO IV - ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO****31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016***(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)***ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO**

A continuación presentamos los estados de otros resultados integrales, comprendidos durante los años terminados al 31 de diciembre de 2017 y 2016.

	2017	2016
	Notas	
Flujo neto originado por actividades de la operación:		
Comisiones pagadas	(111,670,476)	(60,124,358)
Ingreso neto por instrumentos financieros a valor razonable	1,867,221,452	3,275,144,191
Egreso neto por instrumentos financieros a derivados	(842,667,124)	(679,813,616)
Ingreso (Egreso) neto por instrumentos financieros a costo amortizado	36,345,218	(1,146,188,602)
Gastos de administración y comercialización pagados	(221,190,083)	(198,158,236)
Intereses pagados	(134,909,248)	(133,591,807)
Impuestos pagados	(1,463,938)	(29,018,474)
Otros ingresos netos por actividades de la operación	41,781,558	28,551,894
Flujo Neto originado por actividades de la operación	633,447,359	1,056,800,992
Flujo neto originado por actividades de inversión:		
Dividendos y otros ingresos percibidos de inversiones en sociedades	561	489
Incorporación de propiedades, planta y equipo	(2,831,421)	(623,521)
Flujo neto originado por actividades de inversión	(2,830,860)	(623,032)
Flujo neto originado por actividades de financiamiento:		
Ingreso (Egreso) neto por pasivos financieros	333,397,940	(421,972,513)
Dividendos pagados	(250,000,000)	-
Flujo neto originado por actividades de financiamiento	83,397,940	(421,972,513)
Flujo neto total positivo del periodo	714,014,439	634,205,447
Efecto de la variación por cambios en la tasa de cambio sobre el efectivo y efectivo equivalentes de efectivo	55,472,787	16,295,561
Aumento neto en el efectivo	769,487,226	650,501,008
Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del año	1,281,365,491	630,864,483
Efectivo y equivalentes de efectivo al final del año	2,050,852,717	1,281,365,491
Transacciones no monetarias:		
Capital	250,000,000	210,717,400
Reserva legal	50,000,000	42,143,480
Resultados acumulados	(300,000,000)	(252,860,880)

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - TABLA DE RIESGO DE LIQUIDEZ 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Tabla de riesgo de liquidez:

A continuación presentamos la determinación de los flujos de cajas estático y flujos de cajas acumulado al 31 de diciembre de 2017 y 2016.

	2017									
	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
Activo y equivalentes de efectivo	2,050,852,717	-	-	-	-	-	-	-	2,050,852,717	2,050,852,717
Certificado financiero	1,090,678,043	-	-	-	-	-	-	-	1,090,678,043	1,090,678,043
Inversiones en instrumentos financieros:										
A valor razonable con cambios en resultados	2,947,948,362	-	-	-	-	-	1,253,053	703,244,601	3,652,446,016	2,947,948,362
A valor razonable con cambios en resultados comprometidos	1,714,138,717	-	-	-	-	-	-	-	1,714,138,717	1,714,138,717
A valor razonable instrumentos financieros derivados	1,863,172	25,730,305	11,583,104	6,920,371	13,982,557	26,870	-	-	60,106,379	39,176,581
A costo amortizado	65,582,578	8,893,136	114,699	11,663,139	44,842,249	13,349,714	131,597	401,066,667	401,066,667	-
Otras Cuentas por Cobrar	7,871,063,589	34,623,441	11,697,804	18,583,510	58,824,907	13,376,583	1,384,650	1,104,311,268	144,577,112	74,590,413
Total									9,113,865,651	7,917,384,833
Pasivos financieros:										
A valor razonable	(250,719,085)	(679,945,145)	(1,066,923,150)	(833,201,433)	(249,857,051)	(476,835,021)	(47,263,726)	-	(3,624,844,611)	2,017,587,381
A valor razonable - instrumentos financieros derivados	(42,462,100)	(162,105,178)	(190,613,105)	(155,531,093)	(284,762,005)	(7,272,444)	(798,846)	-	(823,544,771)	395,180,383
A costo amortizado:										
Obligaciones con bancos	-	-	(4,878,889)	-	-	-	(1,860,241,252)	-	(1,865,120,141)	(4,878,889)
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	-	-	(1,015,068)	-	(11,767,672)	-	(875,000,000)	(887,782,740)	-
Otras cuentas por pagar	(553,926)	(5,880,305)	(831,805)	-	-	-	-	-	(7,366,036)	(7,366,036)
Cuentas por pagar a relaciones	-	(2,224,156)	-	-	-	-	-	-	(2,224,156)	(2,224,156)
Acumulaciones y otras obligaciones	-	-	(9,907,048)	-	(40,705,840)	-	-	-	(50,612,888)	(9,907,048)
Total	(293,735,111)	(850,154,784)	(1,283,253,997)	(989,747,594)	(555,324,896)	(495,975,137)	(1,908,303,824)	(875,000,000)	(7,261,495,343)	2,388,391,635
Flujo de caja estático	7,577,328,478	(815,531,343)	(1,281,556,193)	(971,184,084)	(496,500,089)	(482,598,554)	(1,908,919,174)	229,311,268	1,852,370,308	10,305,776,468
Flujo de caja acumulado	7,577,328,478	6,761,797,134	5,480,240,941	4,509,076,857	4,012,576,768	3,529,978,214	1,623,059,040	1,852,370,308		

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - TABLA DE RIESGO DE LIQUEDEZ 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Tabla de riesgo de liquidez: (continuación):

	2016							
	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
Activo y equivalentes de efectivo	1,281,365,491	-	-	-	-	-	-	-
Inversiones en instrumentos financieros:								
A valor razonable con cambios en resultados	357,267,172	-	-	-	-	-	-	-
A valor razonable con cambios en resultados comprometida	2,183,433,719	-	-	-	-	-	-	-
A valor razonable								
Instrumentos financieros derivados	1,011,990	4,695,187	13,353,726	7,435,069	9,807,928	1,137,314	14,026,412	-
A costo amortizado	-	-	4,252,880	-	-	-	-	-
Otras Cuentas por Cobrar	2,200,610	50,229,395	370,684	2,671,761	1,767,081	161,114	1,728,785	-
Total	3,825,278,882	60,924,582	17,977,290	10,110,830	11,575,009	1,298,428	29,881,270	2,342,122,507
Pasivos financieros:								
A valor razonable	(140,242,125)	(546,779,179)	(446,215,542)	(512,129,293)	(221,503,963)	(230,009,776)	(33,630,310)	(905,922)
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(12,113,330)	(43,347,228)	(49,444,747)	(48,626,982)	(50,567,979)	(23,868,706)	(841,511)	(21,420)
A costo amortizado:								
Obligaciones con bancos	-	-	-	-	-	(935,430,231)	(798,712,221)	(1,079,122)
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	(684,670)	(2,364,001)	(779,409)	(238,885)	-	(67,252)	(936,721)	(684,496,356)
Otras cuentas por pagar	-	-	-	-	-	-	-	(307,129)
Acumulaciones y otras obligaciones	-	-	-	-	-	(47,315,010)	(5,677)	(47,320,687)
Total	(153,040,125)	(592,490,408)	(496,439,698)	(560,995,160)	(272,071,942)	(1,236,690,975)	(834,126,440)	(686,809,949)
Flujo de caja estático	3,672,238,857	(531,565,826)	(478,462,408)	(550,884,330)	(260,406,933)	(1,235,392,547)	(804,245,170)	1,655,312,558
Flujo de caja acumulado	3,672,238,857	3,140,673,031	2,662,210,623	2,111,326,293	1,850,829,360	615,436,813	(188,808,357)	1,466,504,201

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO V - TABLA DE RIESGO DE LIQUEDEZ 31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016 (Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Tabla de riesgo de liquidez: (continuación):

	1.- Hasta 6	2.- de 7 a 15	3.- de 16 a 30	4.- de 31 a 60	5.- de 61 a 90	1ro. de enero de 2016			8.- Más de 360	Total Bands	Total 30 días
						6.- de 91 a 180	7.- de 181 a 360				
Activo y equivalentes de efectivo	630,864,483	-	-	-	-	-	-	-	-	630,864,483	630,864,483
Inversiones en instrumentos financieros:											
A valor razonable con cambios en resultados	1,766,520,389	-	-	-	-	-	201,321	438,493,413	2,205,215,123	1,766,520,389	1,766,520,389
A valor razonable con cambios en resultados comprometidos	2,312,516,191	-	-	-	-	-	-	-	2,312,516,191	2,312,516,191	2,312,516,191
A valor razonable											
Instrumentos financieros derivados	16,877,936	6,221,350	31,445,159	1,931,191	43,019	21,582,831	36,053	7,484	78,145,022	54,544,444	54,544,444
A costo amortizado			119,253,000						119,253	119,253	119,253
Otras Cuentas por Cobrar	3,202,394	8,729,036	1,413,369	8,015,342	43,019	1,848,911	843,000	1,750,468	25,803,120	13,344,798	13,344,798
Total	4,729,981,393	14,950,306	32,977,761	9,946,533	43,019	23,431,742	1,090,974	440,251,365	5,252,663,193	4,777,909,558	4,777,909,558
Pasivos financieros:											
A valor razonable	(64,426,271)	(341,797,281)	(117,596,491)	(84,091,261)	(169,625,857)	(214,908,011)	(31,756,142)	(5,669,742)	(1,029,871,056)	(523,820,043)	(523,820,043)
A valor razonable - Instrumentos financieros derivados	(4,180,867)	(16,252,456)	(24,936,239)	(24,168,323)	(15,621,803)	(34,941,888)	(3,038,965)	(519,502)	(123,660,043)	(45,369,563)	(45,369,563)
A costo amortizado:											
Obligaciones con bancos	-	-	-	-	-	-	(1,805,951,850)	(1,404,129)	(1,807,355,979)	-	-
Obligaciones por instrumentos financieros emitidos	-	(1,183,562)	-	(10,119,840)	-	(800,000,000)	(200,000,000)	-	(1,011,303,402)	(1,183,562)	(1,183,562)
Otras cuentas por pagar	-	-	(13,432,269)	-	-	-	-	-	(13,432,269)	(13,432,269)	(13,432,269)
Cuentas por pagar a relacionadas	-	(37,108)	-	-	-	-	-	-	(37,108)	(37,108)	(37,108)
Acumulaciones y otras obligaciones	-	(2,225,719)	-	-	-	(26,309,154)	-	-	(28,534,873)	(2,225,719)	(2,225,719)
Total	(68,607,138)	(361,496,126)	(155,964,999)	(118,379,424)	(185,247,660)	(1,076,159,053)	(2,040,746,957)	(7,593,373)	(4,014,194,731)	(586,068,264)	(586,068,264)
Flujo de caja estatico	4,661,374,254.77	(346,545,740.83)	(122,987,218.24)	(108,432,891.10)	(185,204,641.13)	(1,052,727,310.28)	(2,039,665,983.08)	432,657,991.58	3,238,468,461.86	4,191,841,295.70	4,191,841,295.70
Flujo de caja acumulado	4,661,374,254.77	4,314,820,513.93	4,191,841,295.70	4,083,408,404.59	3,898,203,763.46	2,845,476,453.18	805,810,470.10	1,238,460,461.68	1,238,460,461.68	1,238,460,461.68	1,238,460,461.68

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO VI – OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(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 diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la Compañía no mantenía saldos en las cuentas de deudores por intermediación.

Cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia

Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la compañía no mantenía cuentas por cobrar en operaciones de cartera propia.

Propiedad de Inversión

Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, 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 (ver nota 26).

Acreedores por intermediación

Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la Compañía no mantenía cuenta por pagar a acreedores por intermediación.

Cuentas por pagar por operaciones de cartera propia

Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, la Compañía no mantenía saldo en la por pagar por operaciones de cartera propia.

Hechos relevantes

El siguiente es un listado de los hechos relevantes ocurridos desde 1ro. de enero de 2017 al 31 de diciembre de 2017.

Fecha	Hecho Relevante
11/04/2017	Convocatoria Asamblea General Ordinaria Anual de Accionistas de Alpha Sociedad de Valores, S. A., Puesto de Bolsa.
28/04/2017	Convocatoria Asamblea General Ordinaria Anual y Extraordinaria de Accionistas de Alpha Sociedad de Valores, S. A. Puesto de Bolsa
02/05/2017	Colocación total en el Mercado Primario de la Quinta emisión del Programa de Emisiones SIVEM-098 por un monto de DOP 200,000,000
05/05/2017	Informe Anual de Gobierno Corporativo del año 2016.
05/05/2017	Aprobación Estados Financieros al 31 de diciembre de 2016.
05/05/2017	Aprobación distribución de dividendos por la suma de RD\$250,000,000 de las ganancias netas obtenidas al cierre del 2016. Aprobación aumento de los capitales social autorizado y social suscrito y pagado mediante la capitalización de utilidades acumuladas a RD\$ 900,000,000 y la reserva establecida en la Ley No. 19-00 fue aumentada a RD\$180,000,000.
26/05/2017	Designación Juan Manuel Barranco Simó como Vicepresidente de Finanzas de la Sociedad.
26/05/2017	Renuncia Jose Y. Michelen Wiscovitch al cargo de Presidente del Consejo de Administración de Alpha.
17/10/2017	Suscripción contrato de Cesión de Créditos Edesur y Edenorte
14/11/2017	Suscripción contrato de línea de crédito con garantía prendaria

ALPHA Sociedad de Valores, S. A.

Información Suplementaria

ANEXO VI – OTRAS NOTAS INFORMATIVAS

31 de diciembre de 2017, 2016 y al 1ro. de enero de 2016

(Valores expresados en pesos dominicanos-DOP)

Hechos posteriores

A juicio de la Administración entre el 31 de diciembre de 2017 y la fecha de presentación de estos estados financieros, no existen hechos posteriores significativos que afecten los estados financieros de la Compañía.

Otras revelaciones importantes

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

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

Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, 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

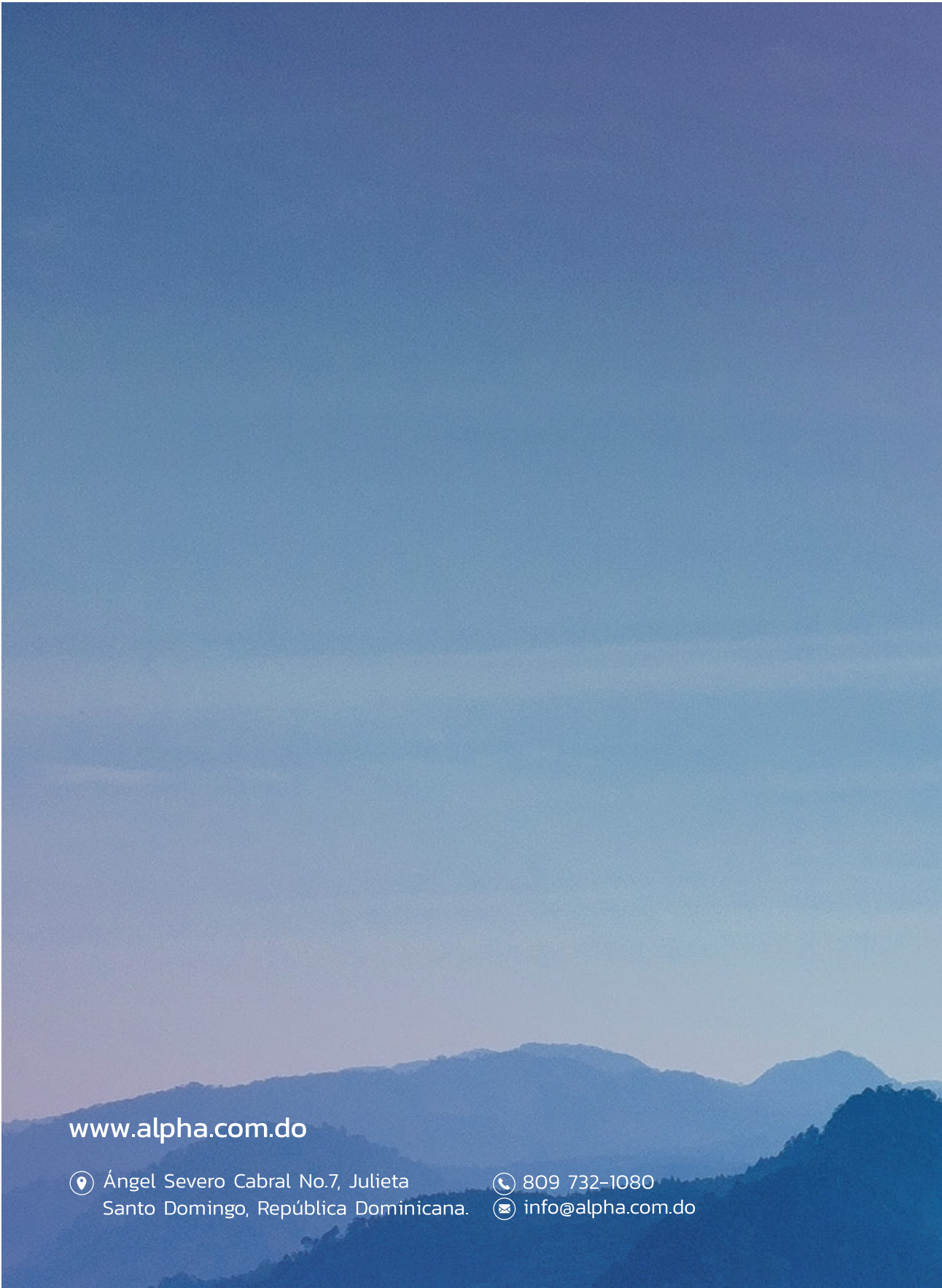
Al diciembre de 2017, 2016 y 1ro. de enero de 2016, los estados financieros no se presentan ajustados por inflación, debido a que para tales años dichos índice no alcanzó más de un dígito y no implica cambios importantes para ser revelados.



El valor de la confianza

Alpha^o
Inversiones





www.alpha.com.do

📍 Ángel Severo Cabral No.7, Julieta
Santo Domingo, República Dominicana.

☎ 809 732-1080
✉ info@alpha.com.do