



BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Comunicación “B” 11387/2016

Ref.: Volatilidades. Inversiones a plazo con retribución variable: títulos públicos nacionales elegibles. Octubre de 2016. Tasa a aplicar a los flujos futuros de fondos de activos y pasivos actualizables por “CER” —septiembre de 2016—.

03/10/2016

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Nos dirigimos a Uds. para hacerles llegar las volatilidades diarias que corresponden a los títulos públicos, instrumentos de regulación monetaria del Banco Central de la República Argentina y acciones del panel “MERVAL”, conforme a la metodología desarrollada por esta Institución.

En línea con lo señalado en el párrafo precedente, les informamos también que la volatilidad diaria que corresponda aplicar durante octubre de 2016 a las posiciones en dólares estadounidenses es igual a 0,0185.

Además, les comunicamos que la tasa a emplear en septiembre de 2016 para ajustar los flujos futuros de fondos de activos y pasivos actualizables por “CER” en la determinación del “VANajrp”, a los efectos de elaborar la información a remitir a través del Régimen Informativo sobre la Exigencia e Integración de Capitales Mínimos —relacionada con el riesgo por variaciones de la tasa de interés— es de 21,8% anual. En otro orden, atento a lo dispuesto en el punto 2.5.5.1. de las normas sobre “Depósitos e inversiones a plazo”, se indican en Anexo los títulos públicos nacionales elegibles para octubre de 2016 a los efectos de determinar el rendimiento en las inversiones a plazo con retribución variable.

Saludamos a Uds. atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

ANA M. DENTONE, Subgerente de Emisión de Normas. — MATÍAS A. GUTIÉRREZ GIRAULT, Gerente de Emisión de Normas.

ANEXO

B.C.R.A.	VOLATILIDADES. INVERSIONES A PLAZO CON RETRIBUCIÓN VARIABLE: TÍTULOS PÚBLICOS NACIONALES ELEGIBLES. OCTUBRE DE 2016.	Anexo a la Com. “B” 11387
----------	--	---------------------------

Especie	Volatilidad diaria	Elegible DIVA
---------	--------------------	---------------



1. Títulos Públicos		
Bonos internacionales de la República Argentina usd al 6,875% Vto. 2021 (AA21D)	0,0205	no
Bonos internacionales de la República Argentina usd al 7,50% Vto. 2026 (AA26D)	0,0135	no
Bonos internacionales de la República Argentina usd al 7,625% Vto. 2046 (AA46D)	0,0195	no
Títulos Discount denominados en pesos (DICP)	0,0140	sí
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley argentina (DICA)	0,0190	sí
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley de Nueva York (DICY)	0,0335	sí
Títulos Cuasipar denominados en pesos (CUAP)	0,0535	no
Bonos de Consolidación en moneda nacional - 6a. Serie al 2% (PR13)	0,0120	sí
Bonos de Consolidación Proveedores - 8a. Serie en pesos (PR15)	0,0100	sí
Bonos Garantizados Fondo Fiduciario para el Des. Prov. - vto. 2018 (NF18P)	0,0090	no





Bonos de la Nación Argentina en dólares al 7% 2017 (AA17D)	0,0165	sí
Bonos de la Nación Argentina \$ tasa BADLAR privada + 275 pb, vto. 2018 (AMX8P)	0,0040	no
Bonos de la Nación Argentina \$ tasa BADLAR privada + 250 pb, vto. 2019 (AMX9P)	0,0075	no
Bonos de la Nación Argentina \$ tasa Badlar privada + 200pb, vto. 28.03.2017 (AM17P)	0,0050	no
Bonos de la Nación Argentina en Dls. al 8,75% vto. 2024 (AY24D)	0,0130	sí
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 1,75% vto. 2016 (AO16D)	0,0100	sí
Bonos de la Nación Argentina en \$ a tasa variable vto. 9.5.2017 (AY17P)	0,0080	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 0,75% vto. 2017 (AF17D)	0,0145	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 0,75% vto. Junio 2017 (AJ17D)	0,0155	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar 0,75% vto. sept 2017 (AS17D)	0,0160	no





Bonos de la Nación Argentina en \$ Badlar privada +300 pbs. Vto. 2017 (AO17P)	0,0045	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 2,40% vto. 2018 (AM18D)	0,0130	no
Bonos de la Nación Argentina \$ BADLAR privada + 325 pb, vto. 2020 (AM20P)	0,0065	no
Bonos del Tesoro Nacional en pesos con ajuste por C.E.R. al 2,50% Vto. 2021 (TC21P)	0,0040	sí
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa fija vto. 5.3.2018 (TM18P)	0,0035	sí
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa fija vto. 19.9.2018 (TS18P)	0,0035	sí
Títulos Públicos Ciudad de Buenos Aires Clase 4 Vto. 2019 (BDC19)	0,0195	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 28.12.16 (H28D6)	0,0055	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 04.01.17 (H04E7)	0,0055	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 11.01.17 (H11E7)	0,0055	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 18.01.17 (H18E7)	0,0055	n. a.





Letras del BCRA en pesos, segmento interno, con vencimiento 05.10.16 (I05O6)	0,0020	n. a.
Letras del BCRA en pesos, segmento interno, con vencimiento 12.10.16 (I12O6)	0,0020	n. a.
Letras del BCRA en pesos, segmento interno, con vencimiento 19.10.16 (I19O6)	0,0020	n. a.

n.a.: no aplicable.

2. Acciones	Volatilidad diaria
Agrometal (AGRO)	0,0380
Aluar Aluminio Argentino (ALUA)	0,0275
BBVA Banco Francés (FRAN)	0,0315
Banco Macro (BMA)	0,0315
Caputo (CAPU)	0,0485
Carbochlor (CARC)	0,0405
Celulosa Argentina (CELU)	0,0280
Central Puerto (CEPU)	0,0200
Comercial del Plata (COME)	0,0300
Consultatio (CTIO)	0,0295





Cresud (CRES)	0,0285
Edenor (EDN)	0,0340
Endesa Costanera (CECO2)	0,0335
Grupo Financiero Galicia (GGAL)	0,0280
JMIN - Holcim Argentina (JMIN)	0,0330
Mirgor (MIRG)	0,0315
Pampa Energía (PAMP)	0,0325
Petróleo Brasileiro - Petrobrás (APBR)	0,0460
Petrolera del Conosur (PSUR)	0,0935
San Miguel (SAMI)	0,0285
Siderar (ERAR)	0,0275
Telecom Argentina (TECO2)	0,0265
Tenaris (TS)	0,0260
Transener (TRAN)	0,0350
YPF (YPFD)	0,0285

e. 11/11/2016 N° 84103/16 v. 11/11/2016

Fecha de publicacion: 11/11/2016

