BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Comunicación "B" 11428/2016

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

30/11/2016

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 diciembre de 2016 a las posiciones en dólares estadounidenses es igual a 0,0190.
Además, les comunicamos que la tasa a emplear en noviembre 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 19,8% 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 diciembre 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. DICIEMBRE DE 2016.	Anexo a la Com. "B" 11428

Especie	Volatilidad diaria	Elegible DIVA

1. Títulos Públicos		
Bonos internacionales de la República Argentina usd al 7,50% Vto. 2026 (AA26D)	0,0140	no
Bonos internacionales de la República Argentina usd al 7,625% Vto. 2046 (AA46D)	0,0195	no
Títulos Discount denominados en pesos (DICP)	0,0130	si
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley argentina (DICA)	0,0190	si
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley de Nueva York (DICY)	0,0375	si
Valores Negociables vinculados al PBI en dólares ley de Nueva York (TVPY)	0,0405	no
Valores Negociables vinculados al PBI en euros ley de Londres (TVPE)	0,0230	no
Bonos de Consolidación en moneda nacional - 6a. Serie al 2% (PR13)	0,0120	no
Bonos de la Nación Argentina en dólares al 7% 2017 (AA17D)	0,0135	si
Bonos de la Nación Argentina en pesos BADLAR privada + 275 pb, vto. 2018 (AMX8P)	0,0040	no

Bonos de la Nación Argentina en pesos BADLAR privada + 250 pb, vto. 2019 (AMX9P)	0,0070	no
Bonos de la Nación Argentina en $ Badlar privada + 200pb, vto. 28.03.2017 (AM17P)	0,0050	no
Bonos de la Nación Argentina en Dls. al 8,75% vto. 2024 (AY24D)	0,0115	si
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 0,75% vto. 2017 (AF17D)	0,0140	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 0,75% vto. sept 2017 (AS17D)	0,0120	no
Bonos de la Nación Argentina en $ Badlar privada +300pbs. vto. 2017 (AO17P)	0,0045	no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 2,40% vto. 2018 (AM18D)	0,0125	si
Bonos de la Nación Argentina en pesos BADLAR privada + 325 pb, vto. 2020 (AM20P)	0,0065	no
Bonos del Tesoro Nacional en pesos con ajuste por CER al 2,50% vto. 2021 (TC21P)	0,0045	si
Bonos del Tesoro Nacional en $ a tasa fija vto.5.3.2018 (TM18P)	0,0040	si

Bonos del Tesoro Nacional en $ a tasa fija vto.19.9.2018 (TS18P)	0,0080	si
Bonos del Tesoro Nacional en $ a tasa fija vto. 3.10.21. (TO21P)	0,0090	si
Bonos del Tesoro Nacional en $ a tasa fija vto. 17.10.23. (TO23P)	0,0065	si
Bonos del Tesoro Nacional en $ a tasa fija vto. 17.10.26. (TO26P)	0,0055	si
Letras del tesoro en dólares vto. 30.1.17. (L2DE7)	0,0005	si
Títulos Públicos Ciudad de Buenos Aires Clase 4 vto. 2019 (BDC19)	0,0195	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 21.12.16 (H21D6)	0,0060	n. a.
Letras del BCRA en pesos con vencimiento 28.12.16 (H28D6)	0,0060	n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos con vto. 18.01.17 (H18E7)	0,0060	n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos con vto. 25.01.17 (H25E7)	0,0060	n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 07.12.16 (I07D6)	0,0050	n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 14.12.16 (I14D6)	0,0050	n. a.

Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 21.12.16 (I21D6)	0,0050	n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 15.03.17 (I15M7)	0,0050	n. a.

n.a.: no aplicable.

2. Acciones	Volatilidad diaria
Agrometal (AGRO)	0,0375
Aluar Aluminio Argentino (ALUA)	0,0260
BBVA Banco Francés (FRAN)	0,0295
Banco Macro (BMA)	0,0300
Caputo (CAPU)	0,0480
Carboclor (CARC)	0,0415
Celulosa Argentina (CELU)	0,0275
Central Puerto (CEPU)	0,0200
Comercial del Plata (COME)	0,0280
Consultatio (CTIO)	0,0280
Cresud (CRES)	0,0280

Edenor (EDN)	0,0310
Endesa Costanera (CECO2)	0,0320
Grupo Financiero Galicia (GGAL)	0,0260
JMIN - Holcim Argentina (JMIN)	0,0330
Mirgor (MIRG)	0,0305
Pampa Energía (PAMP)	0,0305
Petróleo Brasileiro - Petrobrás (APBR)	0,0440
Petrolera del Conosur (PSUR)	0,0855
San Miguel (SAMI)	0,0280
Siderar (ERAR)	0,0260
Telecom Argentina (TECO2)	0,0250
Tenaris (TS)	0,0255
Transener (TRAN)	0,0320
YPF (YPFD)	0,0275

e. 05/01/2017 N° 100956/16 v. 05/01/2017

Fecha de publicacion: *05/01/2017*