



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 11597

2/10/2017

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: ***Volatilidades. Inversiones a plazo con retribución variable: títulos públicos nacionales elegibles. Octubre de 2017. Tasa a aplicar a los flujos futuros de fondos de activos y pasivos actualizables por "CER" –septiembre de 2017–.***

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 2017 a las posiciones en dólares estadounidenses es igual a 0,0190.

Además, les comunicamos que la tasa a emplear en septiembre de 2017 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 17,2 % 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 2017 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 2017	Anexo a la Com. "B" 11597
Especie		Volatilidad diaria Elegible DIVA
1. Títulos Públicos		
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 6,875% vto. 2021 (AA21D)		0,0110 no
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 5,625% vto. 2022 (A2E2D)		0,0085 no
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 6,875% vto. 2027 (A2E7D)		0,0100 no
Bonos de la Nación Argentina USD al 5,75% vto. 2025. (AA25D)		0,0080 no
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 7,50% vto. 2026 (AA26D)		0,0115 no
Bonos de la Nación Argentina USD al 7,625% vto. 2037. (AA37D)		0,0100 no
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 7,625% vto. 2046 (AA46D)		0,0195 no
Bonos internacionales de la República Argentina USD al 7,125% vto. 2117 (AC17D)		0,0115 no
Títulos Discount denominados en pesos (DICP)		0,0110 si
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley argentina (DICA)		0,0210 si
Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley de Nueva York (DICY)		0,0380 no
Bonos de Consolidación en moneda nacional - 6a. Serie al 2% (PR13)		0,0115 no
Bonos de Consolidación Proveedores - 8a. Serie en pesos (PR15)		0,0085 no
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)		0,0065 no
Bonos de la Nación Argentina en Dls. al 8,75% vto. 2024 (AY24D)		0,0095 si
Bonos de la Nación Argentina en \$ Badlar privada +300pbs. vto. 2017 (AO17P)		0,0040 no
Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 2,40% vto. 2018 (AM18D)		0,0120 no
Bonos de la Nación Argentina en dólares estadounidenses al 8% vto. 2020 (AO20D)		0,0115 no
Bonos de la Nación Argentina \$ tasa BADLAR privada + 325 pb, vto. 2020 (AM20P)		0,0060 no
Bonos de la Nación Argentina en \$ Badlar privada + 200 bp vto. 2022. (AA22P)		0,0065 no
Bonos del Tesoro Nacional en \$ con ajuste por C.E.R. al 2,25% vto. 2020 (TC20P)		0,0060 no
Bonos del Tesoro Nacional \$ con ajuste por C.E.R. al 2,50% vto. 2021 (TC21P)		0,0040 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)		0,0055 no
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa fija vto. 3.10.21. (TO21P)		0,0095 si
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa fija vto. 17.10.23. (TO23P)		0,0085 si
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa fija vto. 17.10.26. (TO26P)		0,0085 no
Bonos del Tesoro Nacional en \$ a tasa de Política Monetaria vto. 2020. (TJ20P)		0,0025 si
Títulos de Deuda, CABA, Clase 4, al 3,98%, vto. 17.05.2019. (BDC19)		0,0185 n. a.
Títulos de Deuda en \$, CABA, Clase 22, tasa variable, vto. 29.03.2024 (BDC24)		0,0055 n. a.
Títulos de deuda pública Pcia. Bs As tasa variable vto. 31.05.2022 (PBY22)		0,0050 n. a.
Títulos de Deuda Pública de la Pcia. de Buenos Aires al 9,125% vto. 2024. (PBM24)		0,0170 n. a.
Títulos de deuda Pcia. De Mendoza, Clase 1 vto. 2021 (PMJ21)		0,0050 n. a.
Letras del tesoro en dólares vto. 10.11.17. (LTDN7)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 24.11.17. (L2DN7)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 15.12.17. (LTDD7)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 26.01.18. (L2DE8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 09.02.18. (LTDF8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 23.02.18. (L2DF8)		0,0020 si
Letras del tesoro en dólares vto. 16.03.18. (LTDM8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 13.04.18. (L4DA8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 15.06.18. (LTDJ8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 13.07.18. (LTDL8)		0,0020 no
Letras del tesoro en dólares vto. 24.08.18. (L2DG8)		0,0020 no
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 18.10.17 (I18O7)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 15.11.17 (I15N7)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 20.12.17 (I20D7)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 17.01.18 (I17E8)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 21.02.18 (I21F8)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 21.03.18 (I21M8)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 18.04.18 (I18A8)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 16.05.18 (I16Y8)		0,0020 n. a.
Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 21.06.18 (I21J8)		0,0020 n. a.



B.C.R.A.	VOLATILIDADES. INVERSIONES A PLAZO CON RETRIBUCIÓN VARIABLE: TÍTULOS PÚBLICOS NACIONALES ELEGIBLES. OCTUBRE DE 2017	Anexo a la Com. "B" 11597
----------	---	---------------------------------

2. Acciones	Volatilidad diaria
Agrometal (AGRO)	0,0365
Aluar Aluminio Argentino (ALUA)	0,0235
Andes Energía (PGR)	0,0270
Autopistas del Sol (AUSO)	0,0270
BBVA Banco Francés (FRAN)	0,0240
Banco Macro (BMA)	0,0255
Boldt (BOLT)	0,0305
Central Puerto (CEPU)	0,0215
Comercial del Plata (COME)	0,0210
Cresud (CRES)	0,0245
Distribuidora de Gas Cuyana (DGCU2)	0,0420
Edenor (EDN)	0,0270
Grupo Financiero Galicia (GGAL)	0,0220
JMIN - Holcim Argentina (JMIN)	0,0295
Mirgor (MIRG)	0,0315
Pampa Energía (PAMP)	0,0260
Petróleo Brasileiro - Petrobrás (APBR)	0,0365
San Miguel (SAMI)	0,0265
Siderar (ERAR)	0,0230
Telecom Argentina (TECO2)	0,0230
Tenaris (TS)	0,0220
Transener (TRAN)	0,0285
Transportadora de Gas del Norte (TGNO4)	0,0290
Transportadora de Gas del Sur (TGSU2)	0,0265
YPF (YPFD)	0,0250