



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 11612	31/10/2017
------------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: ***Volatilidades. Inversiones a plazo con retribución variable: títulos públicos nacionales elegibles. Noviembre de 2017. Tasa a aplicar a los flujos futuros de fondos de activos y pasivos actualizables por "CER" –octubre 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 noviembre de 2017 a las posiciones en dólares estadounidenses es igual a 0,0190.

Además, les comunicamos que la tasa a emplear en octubre 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 16,9 % 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 noviembre 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. NOVIEMBRE DE 2017	Anexo a la Com. "B" 11612	
	Especie	Volatilidad	Elegible
	1. Títulos Públicos	diaria	DIVA
	Bonos internacionales de la República Argentina usd al 6,875% vto. 2021 (AA21D)	0,0095	no
	Bonos internacionales de la República Argentina usd al 5,625% vto. 2022 (A2E2D)	0,0080	no
	Bonos internacionales de la República Argentina usd al 6,875% vto. 2027 (A2E7D)	0,0105	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)	0,0110	no
	Títulos Discount denominados en pesos (DICP)	0,0110	si
	Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley argentina (DICA)	0,0195	si
	Títulos Discount denominados en dólares regidos por la ley de Nueva York (DICY)	0,0330	no
	Valores Negociables vinculados al PBI en dólares ley de Nueva York (TVPY)	0,0345	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 \$ BADLAR privada + 275 pb, vto. 2018 (AMX8P)	0,0040	no
	Bonos de la Nación Argentina \$ BADLAR privada + 250 pb, vto. 2019 (AMX9P)	0,0065	no
	Bonos de la Nación Argentina en Dls. al 8,75% vto. 2024 (AY24D)	0,0090	si
	Bonos de la Nación Argentina vinculados al dólar al 2,40% vto. 2018 (AM18D)	0,0110	no
	Bonos de la Nación Argentina usd al 8% vto. 2020 (AO20D)	0,0105	si
	Bonos de la Nación Argentina \$ BADLAR privada + 325 pb, vto. 2020 (AM20P)	0,0060	no
	Bonos de la Nación Argentina en \$ Badlar privada + 200 pb vto. 2022. (AA22P)	0,0065	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)	0,0050	no
	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)	0,0090	no
	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)	0,0030	si
	Títulos de Deuda en \$, CABA, Clase 22, a tasa variable, vto. 29.03.2024. (BDC24)	0,0050	n. a.
	Títulos de deuda pública Pcia. de Bs As a tasa variable vto. 31.05.2022 (PBY22)	0,0045	n. a.
	Títulos de Deuda Pública de Pcia. de Bs As al 9,125% vto. 2024. (PBM24)	0,0160	n. a.
	Títulos de deuda Pcia. De Mendoza, Clase 1 vto. 2021 (PMJ21)	0,0055	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. 11.05.18. (L2DY8)	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. 28.09.18. (L2DS8)	0,0020	no
	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.
	Letras del B.C.R.A. en pesos, segmento interno, con vto. 18.07.18 (I18L8)	0,0020	n. a.

n.a.: no aplicable



B.C.R.A.	VOLATILIDADES. INVERSIONES A PLAZO CON RETRIBUCIÓN VARIABLE: TÍTULOS PÚBLICOS NACIONALES ELEGIBLES. NOVIEMBRE DE 2017	Anexo a la Com. "B" 11612
----------	---	---------------------------------

2. Acciones	Volatilidad diaria
Agrometal (AGRO)	0,0365
Aluar Aluminio Argentino (ALUA)	0,0225
Andes Energía (PGR)	0,0245
Autopistas del Sol (AUSO)	0,0270
BBVA Banco Francés (FRAN)	0,0230
Banco Macro (BMA)	0,0245
Boldt (BOLT)	0,0305
Central Puerto (CEPU)	0,0215
Comercial del Plata (COME)	0,0215
Cresud (CRES)	0,0240
Distribuidora de Gas Cuyana (DGPU2)	0,0415
Edenor (EDN)	0,0270
Grupo Financiero Galicia (GGAL)	0,0215
JMIN - Holcim Argentina (JMIN)	0,0295
Mirgor (MIRG)	0,0315
Pampa Energía (PAMP)	0,0255
Petróleo Brasileiro - Petrobrás (APBR)	0,0350
San Miguel (SAMI)	0,0265
Siderar (ERAR)	0,0230
Telecom Argentina (TECO2)	0,0225
Tenaris (TS)	0,0210
Transener (TRAN)	0,0280
Transportadora de Gas del Norte (TGNO4)	0,0295
Transportadora de Gas del Sur (TGSU2)	0,0255
YPF (YPFD)	0,0240