



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 11948	7/2/2020
------------------------	----------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: ***Tasas continuas de descuento para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión. Comunicación "A" 6397.***

Nos dirigimos a Uds. para comunicarles las tasas continuas de descuento al 31/01/2020 (Anexo I), a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

Saludamos a Uds. atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Silvina Ibañez
Subgerente de Regímenes Prudenciales
y Normas de Auditoría

Rodrigo J. Danessa
Gerente Principal de Régimen Informativo y
Centrales de Información a/c

ANEXO



B.C.R.A.	ANEXO I	Anexo a la Com. "B" 11948
----------	---------	---------------------------------

Tasas continuas de descuento, a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

31.01.20

Punto medio de la banda temporal (t_k) en años	Tasa de interés con- tínua $R(t_k)$ en Pesos	Tasa de interés con- tínua $R(t_k)$ en Dóla- res
0,0028	40,30%	140,90%
0,0417	42,87%	136,58%
0,1667	49,91%	123,93%
0,375	58,19%	106,34%
0,625	63,93%	89,81%
0,875	66,54%	77,02%
1,25	66,85%	62,83%
1,75	63,88%	50,05%
2,5	57,29%	38,39%
3,5	49,22%	29,77%
4,5	43,22%	24,82%
5,5	38,95%	21,64%
6,5	35,86%	19,44%
7,5	33,56%	17,82%
8,5	31,79%	16,59%
9,5	30,39%	15,61%
12,5	27,52%	13,62%
17,5	24,93%	11,82%
25,0	22,99%	10,47%