



BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "A" 1239

03/08/88

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS AUTORIZADAS PARA OPERAR EN CAMBIOS Y CORREDORES DE CAMBIO:

Ref.: Circular REGIMEN INFORMATIVO DE LAS OPERACIONES CAMBIARIAS Y OBLIGACIONES CON EL EXTERIOR REFEX-1-38.

Nos dirigimos a Uds. para hacerles comunicarles el Régimen Informativo Cambiario que deberán aplicar para declarar las transacciones a término que se conciertan de acuerdo con lo dispuesto en la Comunicación "A" 1235 CAMEX-1-161 del 3.8.89.

Todas las entidades facultadas para operar en el mercado a término, proporcionarán los datos de las operaciones que se concierten y liquiden, los saldos de posición y demás informaciones, conforme con los requerimientos de los modelos que se acompañan (Operaciones de Pase, Anexo I, Compras y Ventas a Término, Anexo II, Posición de Cambios, Anexo III y Tipo de Cambio Futuro Promedio Ponderado, Anexo IV).

La información será entregada diariamente en el Departamento de Estadísticas Cambiarias hasta las 18.

Las entidades que operan en el Mercado Libre de Cambios, no incluirán en los formularios ¿??? de Resumen de las Operaciones y 111 de Posición de Cambios, los datos solicitados por la presente.

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Cristina Berz  
Subgerente de Estudios y  
Estadísticas del Sector Externo

Oraldo N. Fernández  
Subgerente General

ANEXOS

OPERACIONES DE PASE CONCERTADAS Y LIQUIDADAS EL DIA:

Entidad: Nombre:

Código:

Fecha de vencimiento de las concertaciones	ACTIVAS					PASIVAS				
	Importe en miles de dólares	Cantidad de operaciones	Tipo de Cambio a término			Importe en miles de dólares	Cantidad de operaciones	Tipo de Cambio a término		
			Máximo	Mínimo	Promedio Ponderado (b)			Máximo	Mínimo	Promedio Ponderado (b)
TOTAL DE CONCERTACIONES DEL DIA	-----	-----				-----	-----			
menos: LIQUIDACIONES	-----	-----				-----	-----			
MOVIMIENTOS NETOS DEL DIA										

Sello y firmas autorizadas

B.C.R.A.

OPERACIONES DE PASE

Anexo I a la Com. "A"  
1239

(b) Tipo de cambio futuro promedio ponderado (Anexo IV)

COMPRAS Y VENTAS A TERMINO CONCERTADAS Y LIQUIDADAS EL DIA:

Entidad: Nombre:

Código:

Fecha de vencimiento de las concertaciones	COMPRAS					VENTAS				
	Importe en miles de dólares	Cantidad de operaciones	Tipo de Cambio a término			Importe en miles de dólares	Cantidad de operaciones	Tipo de Cambio a término		
			Máximo	Mínimo	Promedio Ponderado (b)			Máximo	Mínimo	Promedio Ponderado (b)
TOTAL DE CONCERTACIONES DEL DIA	-----	-----				-----	-----			
menos: LIQUIDACIONES	-----	-----				-----	-----			
MOVIMIENTOS NETOS DEL DIA										

Sello y firmas autorizadas

B.C.R.A.

COMPRAS Y VENTAS A TERMINO

Anexo II a la Com. "A" 1239

(b) Tipo de cambio futuro promedio ponderado (Anexo IV)

POSICION GENERAL DE CAMBIOS A TERMINO AL CIERRE DE LAS OPERACIONES DEL DIA:

Entidad: Nombre:

Código

Fecha de vencimiento de las concertaciones	OPERACIONES DE PASE					OPERACIONES A TERMINO					Posición Neta (3 + 6) (7)
	Activas (a) (1)	(b)	Pasivas (a) (2)	(b)	Neto (1 - 2) (a) (3)	Compras (a) (4)	(b)	Ventas (a) (5)	(b)	Neto (4 - 5) (a) (6)	
TOTALES											

- En miles de dólares -

- I - Total a término (7):
- II - Posición contado (Fórm. 111):
- III- Posición general de cambios (I + II):
- IV - Otras tenencias de monedas extranjeras no computadas en el formulario 111 (equivalente en dólares estadounidenses)
- V - Total III + IV:

Comunicación "A" 1235, punto 3

10% de los Recursos Propios no inmovilizados	_____
2% de la Responsabilidad Computable	_____
1% de la Responsabilidad Computable	_____

Sello y firmas autorizadas

- (a) Importes en miles de dólares estadounidenses.
- (b) Tipo de cambio futuro promedio ponderado. (Anexo IV).

Nota: El detalle por fecha de vencimiento deberá proveerse únicamente al 7, 15, 23 (o día hábil inmediato anterior) y a fin de mes, en tanto que el total de los vencimientos de las posiciones de cambio (8), los Saldos de Posición y tenencia (I a V) y la información Comunicación "A" 1235, punto 3, deberán suministrarse diariamente.

B.C.R.A.

OPERACIONES DE PASE

Anexo III a la Com. "A" 1239

B.C.R.A.	TIPO DE CAMBIO FUTURO PROMEDIO PONDERADO	Anexo IV a la Com. "A" 1239
----------	--	-----------------------------

Metodología de cálculo

El tipo de cambio futuro promedio ponderado (TCFPP) resulta de:

$$TCFPP = \frac{\sum_{i=1}^n Q_i - TCF_1}{\sum_{i=1}^n Q_i}$$

donde  $Q_1$  : valor de la operación concertada "i" en dólares estadounidenses

$TCF_1$ : tipo de cambio futuro concertado para la operación "i" en A por dólar estadounidense.

i : 1 a n operaciones.

Se informará el tipo de cambio futuro promedio ponderado (TCFPP) con dos decimales.