



BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

COMUNICACION " A " 3310 I 31/07/01

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular  
RUNOR 1 - 456.  
Régimen informativo de tenencias  
de títulos valores argentinos y  
del exterior

Nos dirigimos a Uds. para comunicarles que la Dirección de Cuentas Internacionales de la Secretaría de Política Económica del Ministerio de Economía, requiere información sobre las tenencias de títulos valores argentinos y del exterior que se mantienen en cartera propia o en custodia a cuenta de terceros, a los efectos de las estimaciones de las series estadísticas del sector externo a cargo de la Dirección Nacional de Cuentas Internacionales (DNCI).

Asimismo, los datos serán utilizados para poder cumplir con los compromisos de participación del país en las encuestas de inversión de cartera que coordina a nivel mundial el Fondo Monetario Internacional.

Las entidades bancarias locales deberán suministrar a la DNCI a fin de cada semestre calendario, comenzando con los datos del 30/06/2001, las cifras correspondientes a las tenencias que mantienen en cartera propia y en custodia de sus clientes de títulos valores argentinos y del exterior. Las presentaciones tendrán carácter estadístico y deberán ajustarse al modelo e instrucciones que se agregan como anexos.

Se fija en 45 días corridos, a partir de vencido el semestre que se informa, el plazo para su remisión a la Dirección Nacional de Cuentas Internacionales, excepto para los datos correspondientes al 30/06/2001, para los cuales se determina como fecha de vencimiento el 12 de septiembre del corriente año.

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Susana Laura Monteagudo	Hilda Beatriz Biasone
Analista	Gerente de Análisis
Subgerencia de Información	Financiero e Información a/c
Monetaria y Financiera	

ANEXOS

ANEXO I

TENENCIAS EN CARTERA PROPIA DE VALORES ARGENTINOS Y DEL EXTERIOR.

Objetivo de la encuesta:

El objetivo de esta encuesta es recopilar información sobre las tenencias de activos de cartera por parte de residentes y no residentes, cumpliendo con el compromiso asumido de participación en la Encuesta Coordinada de Portafolio (CPIS 2001) y en la Encuesta Piloto a Custodios Residentes de Tenencias de Terceros, que coordina el Fondo Monetario Internacional a nivel mundial, y para la compilación del balance de pagos y de la posición de inversión internacional.

A quienes va dirigida y que valores comprende:

La encuesta va dirigida a todos los bancos locales por sus tenencias de valores argentinos y del exterior y comprende todos los valores que tiene el banco en su cartera propia.

LA INFORMACIÓN QUE SE SOLICITA ES NO CONSOLIDADA. CORRESPONDE SOLO A LAS TENENCIAS EN EL PAIS Y POR LO TANTO LOS DATOS NO SE DEBEN CONSOLIDAR CON LAS TENENCIAS DE SUCURSALES EN EL EXTERIOR.

La información se dividirá en 3 partes:

- I. Cartera Propia - BCRA
- II. Cartera Propia - RML (requisitos mínimos de liquidez)
- III. Cartera Propia - Otros valores

I. Cartera Propia BCRA

Datos requeridos

Campo	Información
1	Fecha a la que corresponde la información que se declara
2	Código ISIN
3	Código MAE
4	Código de Caja de Valores
5	Denominación del valor
6	Código del tipo de valor
7	Código del país del emisor
8	Código de la moneda de emisión
9	Tipo de cartera
10	Valor nominal (Tenencia) EN MILES
11	Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS
12	Precio
13	Valor nominal (Posición) EN MILES
14	Valor de Mercado (Posición) EN MILES DE PESOS

II. Cartera Propia - RML

Campo	Información
1	Fecha a la que corresponde la información que se declara
2	Código ISIN
3	Código MAE
4	Código de Caja de Valores
5	Denominación del valor
6	Código del tipo de valor

- 7 Código del país del emisor
- 8 Código de la moneda de emisión
- 9 Tipo de cartera
- 10 Valor nominal (Tenencia) EN MILES
- 11 Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS
- 12 Precio

### III. Cartera Propia - Otros valores

#### Campo Información

- 1 Fecha a la que corresponde la información que se declara
- 2 Código ISIN
- 3 Código MAE
- 4 Código de Caja de Valores
- 5 Denominación del valor
- 6 Código del tipo de valor
- 7 Código del país del emisor
- 8 Código de la moneda de emisión
- 9 Tipo de cartera
- 10 Valor nominal (Tenencia) EN MILES
- 11 Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS
- 12 Precio
- 13 Valor nominal (Posición) EN MILES
- 14 Valor de Mercado (Posición) EN MILES DE PESOS

#### Instrucciones

##### Aclaraciones sobre los datos requeridos:

Campo 2. Código ISIN asignado al titula. En todos los casos en que el titulo tenga Código ISIN en este campo se Deberá indicar dicho código. En la Cartera de RML se puede indicar alternativamente ISIN o el código CUSIP. Para los títulos que no tuvieran ISIN se deberá indicar el código de MAE o de Caja de Valores en los Campos 3 o 4 respectivamente.

Campo 3. En caso de no contar con código ISIN se debera completar en este campo el codigo asignado por el MAE.

Campo 4: En caso de no contar con codigo ISIN se debera completar en este campo el codigo asignado por el Caja de Valores.

Campo 5: Denominacion del valor. (Es especialmente importante completar este campo con detalle en aquellos titulos que no tienen codigo ISIN)

Campo 6. Consignar de acuerdo a la siguiente tabla.

- 01 Acciones de empresas residentes
- 02 ADRs de empresas residentes
- 03 Acciones de empresas no residentes
- 04 CEDEARs de empresas no residentes
- 05 Titulos publicos de gobiernos residentes
- 06 Titulos publicos de gobiernos no residentes
- 07 Titulos privados emitidos por empresas residentes
- 08 Titulos privados emitidos por empresas no residentes
- 09 Certificados de deposito emitidos por residentes
- 10 Certificados de deposito de bancos no residentes
- 11 Cuotas parte de fondos comunes de inversion del exterior
- 12 Certificados de participacion en fideicomisos del exterior

Campo 7. Consignar el codigo de pais de residencia del emisor del titulo de deuda, accion o de

constitucion del fondo comun de inversion o fideicomiso financiero. Utilizar para esta clasificacion la tabla de codificacion de paises. En el caso de los ADRs y CEDEARs se debera considerar el pais de residencia del emisor del pasivo subyacente al mismo.

Campo 8. Consignar en este campo el codigo de moneda de emision del valor segun la tabla de codificacion de monedas.

Campo 9. Se debe consignar el codigo de acuerdo a la siguiente tabla.

I Cartera de Investment

T Cartera de Trading

P Pases con el BCRA

Campo 10. Cartera - TENENCIA: saldo fisico a la fecha informada. Consignar cantidad en el caso de acciones, ADRs, CEDEARs y cuotapartes de fondos comunes de inversion y Valor Nominal Original en el caso de los titulos de deuda. DATO EN MILES

Campo 11 Consignar el valor de mercado de la Cartera / TENENCIA valuando los titulos al precio informado en el Campo 12. DATO EN MILES DE PESOS

Campo 12 Precio de cierre el dia de la fecha informada.

Para la cartera de investment informada al BCRA se debe utilizar el precio de costo o compra de la operacion segun las normas del BCRA.

Para los titulos que componen los RML utilizar el precio del DBNY (segun normas del BCRA)

Para el resto de los titulos:

Titulos publicos locales: precio informado por el MAE (Valor Tecnico de Calculo).

Titulos privados locales: precio de la BCBA

Titulos internacionales: precio informado por Bloomberg o Reuters.

Titulos sin cotizacion NO se deben valorar. En precio colocar n/d.

Campo 13. Cartera - POSICION: prestamos mas compras contado a liquidar y a termino, menos los depositos y ventas contado a liquidar y a termino.. Consignar cantidad en el caso de acciones, ADRs, CEDEARs y cuotapartes de fondos comunes de inversion y Valor Nominal Original en el caso de los titulos de deuda. DATO EN MILES

Campo 14 Consignar el valor de mercado de la Cartera - POSICION valuando los titulos al precio informado en el Campo 10. DATO EN MILES DE PESOS.

Periodicidad:

La presentacion tendra caracter semestral comenzando con los datos al 30/06/01. Debera remitirse a la Direccion Nacional de Cuentas Internacionales, sita en el Ministerio de Economia, H. Yrigoyen 250 Ciudad de Buenos Aires, Oficina 838 B, dentro de los cuarenta y cinco dias (45) corridos de vencido el semestre que se informa.

Alternativas para la transferencia de la informacion:

Los datos deberan ser suministrados de la siguiente manera:

. En CD, en diskette de 3 1/2 de alta densidad formateados bajo sistema operativo DOS o en su defecto a traves de email a la direccion gmande@mecon.gov.ar. Los archivos que se envien por email no deben tener un tamano

superior a 1 mega. En caso de que se supere ese tamaño, se puede compactar los archivos con el programa zip.

Los CD y los diskettes deberán tener etiqueta donde de consignara código y nombre de la entidad bancaria y nombre y número de teléfono del responsable del suministro de la información. Deberán ser entregados en la Dirección Nacional de Cuentas Internacionales H. Yrigoyen 250, piso 8 oficina 838 B.

En caso de ser enviada por email, en el Asunto se deberá hacer referencia al número de comunicación. Asimismo en el encabezado del texto se deberán consignar los siguientes datos: código y nombre de la entidad bancaria y nombre y número de teléfono del responsable del suministro de la información

Los archivos generado por cada entidad deberán estar en formato ASCII y deberán denominarse de la siguiente manera:

- I. Cartera Propia - BCRA                    nnnnnCPIS1.txt
- II. Cartera Propia - RML                    nnnnnCPIS2.txt
- II. Cartera Propia - Otros valores        nnnnnCPIS3.txt

donde "nnnnn" es el código de la entidad informante cuya estructura se detalla a continuación.

#### Estructura de los archivos

Los campos de cada registro deberán estar separados por comas (,). En el caso de los campos numéricos si el dato tiene menos dígitos que la longitud máxima del campo NO es necesario completar el número con 0 (ceros) tanto en la parte entera como en la decimal.

#### Cartera Propia - BCRA

Campo	Tipo	Long	Dec	Formato	Ejemplo
1 Fecha	C	10		dd/mm/aaaa	30/03/2001
2 Código ISIN	C	12			ARARGE031633
3 Código MAE	C	5			
4 Código de Caja de Valores	C	4			
5 Denominación del valor	C	60		(1)	TITULO X
6 Tipo de valor	C	2		(2)	05
7 Código del país emisor	C	2		(3)	AR
8 Código de la moneda de emisión	C	3		(3)	USD
9 Tipo de cartera	C	1		(4)	T
10 Valor (Tenencia) EN MILES	N	7	0	nnnnnnn	36184
11 Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS	N	10	0	nnnnnnnnnn	35079
12 Precio	N	12	8	(5) nnn.nnnnnnnn	0.96948611
13 Valor	N	7	0	nnnnnnn	3510

(Posicion) EN MILES  
 14 Valor de Mercado N 10 0 nnnnnnnnnn 3402  
 (Posicion) EN MILES  
 DE PESOS

El registro con los datos dados en el ejemplo en formato ASCII debera quedar como sigue:

30/03/2001,ARARGE031633,TITULO  
 X,05,AR,USD,T,36184,35079,0.96948611,3510,3402

Cartera Propia - RML

Campo	Tipo	Long	Dec	Formato	Ejemplo
1 Fecha	C	10		dd/mm/aaaa	30/03/2001
2 Codigo ISIN	C	12			ARARGE031633
3 Codigo MAE	C	5			
4 Codigo de Caja de Valores	C	4			
5 Denominacion del valor	C	60		(1)	TITULO X
6 Tipo de valor	C	2		(2)	05
7 Codigo del pais del emisor	C	2		(3)	AR
8 Codigo de la moneda de emision	C	3		(3)	USD
9 Tipo de cartera	C	1		(4)	T
10 Valor nominal (Tenencia) EN MILES	N	7	0	nnnnnnn	36184
11 Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS	N	10	0	nnnnnnnnnn	35079
12 Precio	N	12	8	(5) nnn.nnnnnnnn	0.96948611

El registro con los datos dados en el ejemplo en formato ASCII debera quedar como sigue:

30/03/2001,ARARGE031633,TITULO X,05,AR,USD,T,36184,35079,0.96948611

Cartera Propia - Otros valores

Campo	Tipo	Long	Dec	Formato	Ejemplo
1 Fecha	C	10		dd/mm/aaaa	30/03/2001
2 Codigo ISIN	C	12			ARARGE031633
3 Codigo MAE	C	5			
4 Codigo de Caja de Valores	C	4			
5 Denominacion del valor	C	60		(1)	TITULO X
6 Tipo de valor	C	2		(2)	05
7 Codigo del pais del emisor	C	2		(3)	AR
8 Codigo de la moneda de emision	C	3		(3)	USD
9 Tipo de cartera	C	1		(4)	T
10 Valor nominal (Tenencia) EN MILES	N	7	0	nnnnnnn	36184
11 Valor de Mercado (Tenencia) EN MILES DE PESOS	N	10	0	nnnnnnnnnn	35079
12 Precio	N	12	8	(5) nnn.nnnnnnnn	0.96948611
13 Valor nominal	N	7	0	nnnnnnn	3510

(Posicion) EN MILES  
14 Valor de Mercado N 10 0 nnnnnnnnnn 3402  
(Posicion) EN MILES DE  
PESOS

El registro con los datos dados en el ejemplo en formato ASCII debera quedar como sigue:

30/03/2001,ARARGE031633,TITULO  
X,05,AR,USD,T,36184,35079,0.96948611,3510,3402

#### Referencias:

- (1) Si la cantidad de caracteres es menor a la longitud maxima del campo NO es necesario completar con blancos a la derecha.
- (2) Rango posible: 01 al 12, referirse a la tabla correspondiente indicada anteriormente.
- (3) Para estos codigos referirse a las tablas cuyas denominaciones son: Pais.xls y moneda.xls. Estas tablas seran suministradas en soporte magnetico en la Direccion de Cuentas Internacionales del Ministerio de Economia (H. Yrigoyen 250 piso 8 of. 838-B), tambien pueden solicitarse por E-mail a la direccion dpiagg@mecon.gov.ar o mongar@mecon.gov.ar
- (4) Referirse a la tabla correspondiente indicada anteriormente. Valores posibles I, T o P.
- (5) En este campo se aconseja utilizar el punto (.) decimal en lugar de la coma (,) para evitar confusiones con los separadores de los campos, que deberan ser comas.

#### ANEXO II

#### TENENCIAS POR CUENTA DE TERCEROS DE VALORES ARGENTINOS Y DEL EXTERIOR.

#### Objetivo de la encuesta:

El objetivo de esta encuesta es recopilar informacion sobre las tenencias de activos de cartera por parte de residentes y no residentes, cumpliendo con el compromiso asumido de participacion en la Encuesta Coordinada de Portafolio (CPIS 2001) y en la Encuesta Piloto a Custodios Residentes de Tenencias de Terceros, que coordina el Fondo Monetario Internacional a nivel mundial, y para la compilacion del balance de pagos y de la posicion de inversion internacional.

#### A quienes va dirigida y que valores comprende:

La encuesta va dirigida a todos los bancos locales en su calidad de custodios de titulos valores de terceros y comprende todas las tenencias mantenidas en custodia a favor de terceros en Caja de Valores, Cryl, Clearstream, Euroclear, DTC, Tesoro fisico y otros.

#### Datos requeridos

#### Campo Informacion

- 1 Fecha a la que corresponde la informacion que se delcara
- 2Codigo ISIN
- 3Codigo MAE
- 4Codigo de Caja de Valores

- 5 Denominacion del Titulo
- 6 Tipo de valor
- 7 Pais del emisor
- 8 Moneda de emision
- 9 Pais de residencia del tenedor
- 10 Categoria del tenedor residente
- 11 Valor nominal (EN MILES)
- 12 Precio
- 13 Valor de Mercado (EN MILES DE \$)

#### Instrucciones

#### Aclaraciones sobre los datos requeridos:

Campo 2. Codigo ISIN asignado al titulo. En todos los casos en que el titulo tenga Codigo ISIN en este campo se debera indicar dicho codigo.. Para los titulos que no tuvieran ISIN se debera indicar el codigo de MAE o de Caja de Valores en los Campos 3 o 4 respectivamente.

Campo 3. En caso de no contar con codigo ISIN se debera completar en este campo el codigo asignado por el MAE.

Campo 4: En caso de no contar con codigo ISIN se debera completar en este campo el codigo asignado por el Caja de Valores.

Campo 5: Denominacion del valor. (Es especialmente importante completar este campo con detalle en aquellos titulos que no tienen codigo ISIN)

Campo 6. Consignar de acuerdo a la siguiente tabla.

- 01 Acciones de empresas residentes
- 02 ADRs de empresas residentes
- 03 Acciones de empresas no residentes
- 04 CEDEARs de empresas no residentes
- 05 Titulos publicos de gobiernos residentes
- 06 Titulos publicos de gobiernos no residentes
- 07 Titulos privados emitidos por empresas residentes
- 08 Titulos privados emitidos por empresas no residentes
- 09 Certificados de deposito emitidos por residentes
- 10 Certificados de deposito de bancos no residentes
- 11 Cuotas parte de fondos comunes de inversion del exterior
- 12 Certificados de participacion en fideicomisos del exterior

Campo 7. Consignar el codigo de pais de residencia del emisor del titulo de deuda, accion o de constitucion del fondo comun de inversion o fideicomiso financiero. Utilizar para esta clasificacion la tabla de codificacion de paises. En el caso de los ADRs y CEDEARs se debera considerar el pais de residencia del emisor del pasivo subyacente al mismo.

Campo 8. Consignar en este campo el codigo de moneda de emision del valor segun la tabla de codificacion de monedas.

Campo 9. Consignar el pais de residencia del tenedor del titulo segun la tabla de codificacion.

Campo 10. En caso de que el tenedor del titulo fuera un residente de Argentina, se debera consignar en este campo la categoria del mismo de acuerdo a la



siguiente tabla.

- 1 AFJP
- 2 Companias de Seguros
- 3 Agentes de bolsa
- 4 Otros bancos locales
- 5 Fondos comunes de inversion constituidos en el pais
- 6 Otros tenedores residentes en Argentina

Campo 11. Consignar cantidad en el caso de acciones, ADRs, CEDEARs y cuotas partes de fondos comunes de inversion. En el caso de los titulos de deuda se debera consignar el Valor Nominal Original. DATO EN MILES.

Campo 12 Precio de cierre el dia de la fecha informada.

- . Para titulos publicos locales: precio informado por el MAE (Valor Tecnico de Calculo).
- . Para titulos privados locales: precio de la BCBA
- . Para titulos internacionales: precio informado por Bloomberg o Reuters.
- . Titulos sin cotizacion NO se deben valorar. En precio colocar n/d.

Campo 13. Consignar el valor de mercado, que surge de la multiplicacion de los Cantidad y Precio. DATO EN MILES DE PESOS.

Periodicidad:

La presentacion tendra caracter semestral comenzando con los datos al 30/06/01. Debera remitirse a la Direccion Nacional de Cuentas Internacionales, sita en el Ministerio de Economia, H. Yrigoyen 250 Ciudad de Buenos Aires, Oficina 838 B, dentro de los cuarenta y cinco dias (45) corridos de vencido el semestre que se informa.

Forma de entrega de la informacion:

Alternativas para la transferencia de la informacion:

Los datos deberan ser suministrados de la siguiente manera:

- . En CD, en diskette de 3 1/2 de alta densidad formateado bajo sistema operativo DOS o en su defecto a traves de email a la direccion gmande@mecon.gov.ar. Los archivos que se envien por email no deben tener un tamano superior a 1 mega. En caso de que se supere ese tamano, se puede compactar los archivos con el programa zip.
- . Los CD o diskettes deberan tener etiqueta donde se consignara codigo y nombre de la entidad bancaria y nombre y numero de telefono del responsable del suministro de la informacion. Deberan ser entregado en la Direccion Nacional de Cuentas Internacionales H. Yrigoyen 250, piso 8 oficina 838 B.
- . En caso de ser enviada por email, en el Asunto se debera hacer referencia al numero de comunicacion. Asimismo en el encabezado del texto se deberan consignar los siguientes datos: codigo y nombre de la entidad bancaria y nombre y numero de telefono del responsable del suministro de la informacion

El archivo generado por cada entidad debera estar en formato ASCII y debera denominarse nnnnnCPIS4.txt donde "nnnnn" es el codigo de la entidad informante cuya estructura se detalla a continuacion.

#### Estructura del archivo

Los campos de cada registro deberan estar separados por comas (,). En el caso de los campos numericos si el dato tiene menos digitos que la longitud maxima del campo NO es necesario completar el numero con 0 (ceros) tanto en la parte entera como en la decimal.

Campo	Tipo	Long	Dec	Formato	Ejemplo
1 Fecha	C	10		dd/mm/aaaa	30/03/2001
2 Codigo ISIN	C	12			ARARGE031633
3 Codigo MAE	C	5			
4 Codigo Caja de Valores	de C				
5 Denominacion del titulo	del C	60		(1)	TITULO X
6 Tipo de valor	C	2		(2)	05
7 Pais del emisor	C	2		(3)	AR
8 Moneda de emision	C	3		(3)	USD
9 Pais de residencia del tenedor	C	2		(3)	US
10 Categoria del tenedor residente	del C	1		(4)	1
11 Valor nominal (EN MILES)	N	7	0	nnnnnnn	35079
12 Precio	N	12	8	(5) nnn.nnnnnnnn	0.96948611
13 Valor de mercado	N	10		nnnnnnnnnn	3510

El registro con los datos dados en el ejemplo en formato ASCII debera quedar como sigue:

30/03/2001,ARARGE031633,TITULO X,05,AR,USD,US,1,35079,0.96948611,3510

#### Referencias:

- (1) Si la cantidad de caracteres es menor a la longitud maxima del campo NO es necesario completar con blancos a la derecha.
- (2) Rango posible: 01 al 12, referirse a la tabla correspondiente indicada anteriormente.
- (3) Para estos codigos referirse a las tablas cuyas denominaciones son: Pais.xls y moneda.xls. Estas tablas seran suministradas en soporte magnetico en la Direccion de Cuentas Internacionales del Ministerio de Economia (H. Yrigoyen 250 piso 8 of. 838-B), tambien pueden solicitarse por E-mail a la direccion dpiagg@mecon.gov.ar o mongar@mecon.gov.ar
- (4) Referirse a la tabla correspondiente indicada anteriormente.
- (5) En este campo se aconseja utilizar el punto (.) decimal en lugar de la coma (,) para evitar confusiones con los separadores de los campos, que deberan ser comas.