

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA



COMUNICACIÓN "A" 4199	01/09/2004
-----------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular  
RUNOR 1 - 693

***Régimen Informativo Contable Mensual  
(R.I.C.M) – Operaciones a Término (R.I. –  
O.T.).***

---

Nos dirigimos a Uds. en relación a la Comunicación "A" 4196, vinculada con el régimen informativo de referencia.

Al respecto, les hacemos llegar las instrucciones operativas para su presentación.

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Gustavo Bricchi  
Gerente de Gestión  
de la Información

Rubén Marasca  
Subgerente General  
de Análisis y Auditoría

ANEXO: 7 Hojas



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

### 22.1. Instrucciones generales

- 22.1.1. La información diaria se proporcionará respetando la estructura e instrucciones del diseño 4601, y nominando al archivo "OPTERM.TXT" que contendrá los datos conforme al diseño de registro inserto en el punto 22.4.
- 22.1.2. Accediendo al sitio de Internet ([www3.bcra.gov.ar](http://www3.bcra.gov.ar)) e identificándose con el mismo código de usuario y Password de acceso único por entidad a que hace referencia la Comunicación "B" 7120, podrán ingresar las compras y ventas a término de moneda extranjera, títulos públicos y otros activos. Para enviar los archivos, se deberá hacer clic en el botón "Browse" y aparecerá una ventana en la cual se ubicarán el o los archivos en su equipo. Una vez seleccionado, se deberá presionar enter y luego enviarán la información presionando el botón "Enviar Archivo".
- 22.1.3. En caso de no poseer datos a informar en un día determinado, se enviará el diseño 4601 completando los campos 1 a 3 y el de rectificativa e integrando los restantes campos con blancos o ceros según corresponda.
- 22.1.4. En caso de que la entidad no realice ninguna de las operaciones comprendidas, deberá remitir una nota con carácter de Declaración Jurada a la Gerencia de Gestión de la Información informando tal situación, a efectos de ser exceptuadas de la presentación de este régimen informativo. Dicha nota deberá estar firmada por el Responsable de la Generación y Cumplimiento del Régimen Informativo y por el Responsable Máximo de Auditoría Interna. Si con posterioridad la entidad comenzara a realizar operaciones a término, deberá informar mediante nota del mismo tenor, dirigida a la citada gerencia, la fecha de inicio de las mismas, a partir de la cual deberá dar cumplimiento al presente régimen informativo.
- 22.1.5. Se rechazará la información diaria si la del día inmediato anterior no se encuentra validada.

### 22.2. Instrucciones particulares

- 22.2.1. El campo 4 "Ámbito de negociación o contraparte" se completará con los siguientes códigos:
- 01: BCBA – INDOL
  - 02: ROFEX
  - 03: MAE
  - 04: DOMAY
  - 05: Residentes en el país – Sector Financiero
  - 06: Residentes en el país – Sector no Financiero
  - 07: Residentes en el exterior – Mercados autorregulados
  - 08: Residentes en el exterior – Otros

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 1
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

22.2.2. El campo 5 “Activo Subyacente” se completará con los siguientes códigos:

- 1: Moneda extranjera
- 2: Títulos públicos nacionales
- 3: Títulos públicos extranjeros
- 4: Títulos valores privados
- 9: Otros

22.2.3. En caso de completarse el campo 5 “Activo subyacente” con 9 “Otros”, el campo 11 “Cantidad de activo subyacente” se completará con ceros.

22.2.4. El campo 9 “Liquidación” se completará con los siguientes códigos:

- 1: Diaria de diferencias
- 2: Al vencimiento de diferencias
- 3: Con entrega
- 9: Otra

22.2.5 El campo 10 “Concepto” se completará con los siguientes códigos:

- 1: Alta de compras
- 2: Baja de compras
- 3: Alta de ventas
- 4: Baja de Ventas

22.2.6. Los movimientos deberán informarse totalizando en Cantidad del activo subyacente (campo 11) y en Importe concertado de la operación a término en moneda de liquidación (campo 12), las operaciones del día que tengan en común los siguientes atributos: Ámbito de negociación o contraparte (campo 4), Activo subyacente (campo 5), Moneda del activo subyacente (campo 6), Moneda de liquidación (campo 7), Fecha de vencimiento (campo 8), Liquidación (campo 9) y Concepto (campo 10).

22.2.7. Las posiciones al final de cada día serán calculadas en esta Institución en base a los datos suministrados, e informadas diariamente a cada entidad. El 15/09/04, corresponderá informar las posiciones iniciales como operaciones del día, completando el campo 10 “Concepto” con 1 o 3, es decir, “Alta de Compras” o “Alta de ventas”, respectivamente.

22.2.8. A los efectos de suministrar las posiciones diarias no vencidas, esta Institución creará códigos de partida compuestos por la misma combinación de atributos descripta en el punto 22.2.6 de estas instrucciones, considerándose “Posición neta compradora” cuando el último dígito sea 1 y “Posición Neta vendedora” cuando el último dígito sea 3. Se aclara que las posiciones se calcularán en base al campo 11 “Cantidad de activo subyacente”.

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN “A” 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 2
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

#### 22.2. Validación de la información.

Una vez procesada la información, si ésta resulta válida, el B.C.R.A. emitirá el pertinente comprobante de validación, en el que constarán las posiciones finales de las operaciones que tengan en común los mismos atributos, calculadas en esta Institución en base a los datos diarios informados por cada entidad.

#### 22.4. Diseño de registro.

Versión: 1 <sup>a</sup>	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 3
-------------------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

Denominación: Operaciones a término				Hoja 1 de 1
N° Campo	Nombre	Tipo (1)	Longitud	Observaciones
1	Código de diseño	Carácter	4	Constante 4601
2	Código de entidad	Numérico	5	El que corresponde a la cuenta corriente en pesos abierta en esta Institución.
3	Fecha de información	Numérico	8	AAAAMMDD. Día hábil que se informa.
4	Ámbito de negociación o contraparte	Numérico	2	Según pto. 22.2.1 de estas instrucciones.
5	Activo subyacente	Numérico	1	Según pto. 22.2.2 de estas instrucciones.
6	Moneda del activo subyacente	Carácter	3	De acuerdo a codificación de Currency Codes del SWIFT.
7	Moneda de liquidación	Carácter	3	De acuerdo a codificación de Currency Codes del SWIFT.
8	Fecha de vencimiento	Numérico	8	AAAAMMDD
9	Liquidación	Numérico	1	Según pto. 22.2.4 de estas instrucciones.
10	Concepto	Numérico	1	Según pto. 22.2.5 de estas instrucciones.
11	Cantidad de activo subyacente	Numérico	11	Según pto. 22.2.3 de estas instrucciones e Instrucciones Particulares de las N.P.
12	Importe concertado de la operación a término en moneda de liquidación	Numérico	11	En unidades sin decimales. (2)
13	Rectificativa	Carácter	1	Consignar "R" en caso de rectificativa; de lo contrario consignar "N".

(1) Los campos numéricos se alinean a la derecha y se completan con ceros a la izquierda; los campos carácter se alinean a la izquierda y se completan con blancos a la derecha.

(2) Los importes se expresarán sin signo.

N.P.: Normas de Procedimiento de este requerimiento.

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 4
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

### 22.5. Modelo de comprobante de validación

<p align="center"><b>BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA</b> Superintendencia de Entidades Financieras y Cambiarias <b>Gerencia de Gestión de la Información</b></p> <p align="center"><u>COMPROBANTE DE VALIDACIÓN</u></p> <p>Entidad: Banco de la Nación Argentina</p> <p>Información sobre: Operaciones a Término</p> <p>Día informado: 15.09.04</p> <p>Por la presente señalamos que la información suministrada no contiene errores de validación</p>
--

<p align="center"><b>BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA</b> Superintendencia de Entidades Financieras y Cambiarias <b>Gerencia de Gestión de la Información</b></p> <p align="center">Día informado: 15.09.2004</p> <table><thead><tr><th align="left">Partida</th><th align="center">Concepto</th><th align="right">Posición</th></tr></thead></table>	Partida	Concepto	Posición
Partida	Concepto	Posición	

### 22.6. Tabla de errores de validación.

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 5
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

Código	Leyenda	Causa
01	FALTA ARCHIVO "OPTERM.TXT"	Se omitió grabar el archivo de referencia o se lo envió vacío o el diseño no corresponde al 4601.
02	LONGITUD DE REGISTRO NO CORRESPONDE	La grabación del registro no se efectuó según el diseño correspondiente.
03	ENTIDAD MAL INFORMADA	El código de entidad informado no es correcto.
04	FECHA DE INFORMACIÓN ERRÓNEA	Se trata de una fecha inexistente (por ejemplo 20021335), contiene caracteres no numéricos o todos ceros o la información corresponde a un período no habilitado para su procesamiento, o la información no corresponde al día hábil a informar.
05	CAMPO IMPORTE MAL INFORMADO	El campo 12 contiene blancos o caracteres no numéricos, o bien fue integrado con ceros.
06	CAMPO CÓDIGO MAL INFORMADO	El código informado no coincide con ninguno de los habilitados. Aplicable a campos 4, 5, 9 y/o 10.
07	CANTIDAD MAL INFORMADA	<ul style="list-style-type: none"><li>- El campo 11 contiene blancos o caracteres no numéricos ó</li><li>- Habiéndose completado el campo 5 "Concepto" con 9, no se completó el campo 11 con ceros ó</li><li>- Habiéndose completado el campo 5 "Concepto" con 1, 2, 3 y/o 4, se completó el campo 11 con ceros.</li></ul>
08	MONEDA MAL INFORMADA	El código de moneda informado en los campos 6 y/o 7 no coincide con ninguno de los habilitados (Currency Codes del SWIFT).
09	FECHA DE VENCIMIENTO ERRÓNEA	Se trata de una fecha inexistente (por ejemplo 20021335), contiene caracteres no numéricos o todos ceros o es anterior o igual a la fecha de información.

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 6
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL EN SOPORTES ÓPTICOS
	Sección 22. Operaciones a Término

Código	Leyenda	Causa
10	INFORMACIÓN ANTICIPADA	Se envió la información diaria, no encontrándose validada la del día inmediato anterior.
11	INFORMACIÓN YA PRESENTADA Y ACEPTADA	Se remitió información correspondiente a una fecha de información ya validada
12	CAMPO RECTIFICATIVA MAL INFORMADO	El campo Rectificativa sólo admite los caracteres "N" y "R".
13	RECTIFICATIVA MAL INGRESADA	Se remitió información rectificativa correspondiente a un período no validado.
14	NOVEDAD DUPLICADA	Se informó más de un registro para igual ámbito de negociación o contraparte (campo 4), activo subyacente (campo 5), moneda del activo subyacente (campo 6), moneda de liquidación (campo 7), fecha de vencimiento (campo 8), liquidación (campo 9) y concepto (campo 10).
15	NO CORRESPONDENCIA ENTRE FECHA DE INFORMACIÓN Y CONCEPTO	Habiéndose completado en el campo 3 con 15/09/04 se consignó en el campo 10 "Concepto" un código distinto de 1 o 3.

Versión: 1ª	COMUNICACIÓN "A" 4199	Vigencia: 01/09/2004	Página 7
-------------	-----------------------	-------------------------	----------