



BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN “A” 4333	08/04/2005
-----------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular
RUNOR 1 - 730

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

Nos dirigimos a Uds. en relación a las Comunicaciones “A” 4330 y “C” 41380 vinculadas con el régimen informativo de referencia.

Al respecto, les hacemos llegar el nuevo texto ordenado con las instrucciones operativas para su presentación, las que serán de aplicación a partir de la semana estadística del 1 al 7 del corriente.

Adicionalmente se acompañan en Anexo las instrucciones especiales para la integración de las posiciones iniciales al 31.03.05.

Asimismo, les informamos que se ha resuelto extender el plazo de presentación de la primera semana estadística y de las posiciones iniciales al 15 del corriente y, de la segunda semana estadística al 20.

Saludamos a Uds. muy atentamente..

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Gustavo Bricchi
Gerente de Gestión
de la Información

Guillermo R. Corzo
Subgerente General de Regulación
y Régimen Informativo a/c

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 **semanal** 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) 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 y opciones de moneda extranjera**. 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 **una semana estadística determinada**, 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 **semanal si la de la semana estadística inmediata** anterior no se encuentra validada.

22.2. Instrucciones particulares

22.2.1. El campo 4 "Tipo de operación" se completará con los siguientes códigos:

- 1: Operación a término
- 2: Operación de compra
- 3: Operación de venta

22.2.2. El campo 5 "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

Versión: 2º	COMUNICACIÓN "A" 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 1
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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

07: Residentes en el exterior – Mercados autorregulados

08: Residentes en el exterior – Otros

22.2.3. El **campo 6** “Activo Subyacente” se completará **en todos los casos con código 1 (Moneda extranjera)**.

22.2.4. El **campo 10** “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 11** “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 12**) y en **Importe concertado de la operación en moneda de liquidación (campo 13)**, las operaciones de **la semana** que tengan en común los siguientes atributos: **Tipo de operación (campo 4)**, **Ámbito de negociación o contraparte (campo 5)**, **Activo subyacente (campo 6)**, **Moneda del activo subyacente (campo 7)**, **Moneda de liquidación (campo 8)**, **Fecha de vencimiento (campo 9)**, **Liquidación (campo 10)** y **Concepto (campo 11)**.

22.2.7. **Las posiciones al final de cada semana estadística serán calculadas en esta Institución en base a los datos suministrados, e informadas semanalmente a cada entidad.**

22.2.8. A los efectos de suministrar las posiciones **semanales** no vencidas, esta Institución creará códigos de partida compuestos por la misma combinación de atributos descrita 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 12** “Cantidad de activo subyacente”.

22.3. 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 **semanales** informados por cada entidad.

22.4. Diseño de registro.

Versión: 2º	COMUNICACIÓN “A” 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 2
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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. Ultimo día de la semana estadística.
4	Tipo de operación	Numérico	1	Según pto. 22.2.1 de estas instrucciones.
5	Ámbito de negociación o contraparte	Numérico	2	Según pto. 22.2.2 de estas instrucciones.
6	Activo subyacente	Numérico	1	Según pto. 22.2.3 de estas instrucciones.
7	Moneda del activo subyacente	Carácter	3	De acuerdo a codificación de Currency Codes del SWIFT.
8	Moneda de liquidación	Carácter	3	De acuerdo a codificación de Currency Codes del SWIFT.
9	Fecha de vencimiento	Numérico	8	AAAAMMDD
10	Liquidación	Numérico	1	Según pto. 22.2.4 de estas instrucciones.
11	Concepto	Numérico	1	Según pto. 22.2.5 de estas instrucciones.
12	Cantidad de activo subyacente	Numérico	11	Según Instrucciones Particulares de las N.P.
13	Importe concertado de la operación a término en moneda de liquidación	Numérico	11	En unidades sin decimales. (2)
14	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: 2º	COMUNICACIÓN "A" 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 3
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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">BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA Superintendencia de Entidades Financieras y Cambiarias Gerencia de Gestión de la Información</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>Semana informada: 07.04.05</p> <p>Por la presente señalamos que la información suministrada no contiene errores de validación</p>
--

<p align="center">BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA Superintendencia de Entidades Financieras y Cambiarias Gerencia de Gestión de la Información</p> <p align="center">Semana informada: 07.04.2005</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: 2º	COMUNICACIÓN "A" 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 4
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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 último día de la semana estadística.
05	CAMPO IMPORTE MAL INFORMADO	El campo 13 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, 6, 10 y/o 11.
07	CANTIDAD MAL INFORMADA	El campo 12 contiene blancos o caracteres no numéricos o bien fue integrado con ceros.
08	MONEDA MAL INFORMADA	El código de moneda informado en los campos 7 y/o 8 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 al primer día de la semana estadística que se informa.



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 semanal , no encontrándose validada la de la semana estadística 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 tipo de operación (campo 4), ámbito de negociación o contraparte (campo 5), activo subyacente (campo 6), moneda del activo subyacente (campo 7), moneda de liquidación (campo 8), fecha de vencimiento (campo 9), liquidación (campo 10) y concepto (campo 11).

Versión: 2º	COMUNICACIÓN "A" 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 6
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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

ANEXO

INSTRUCCIONES ESPECIALES PARA LAS POSICIONES INICIALES AL 31.03.05

- a) Para informar las posiciones iniciales de operaciones a término y opciones de compra y venta de moneda extranjera al 31.03.2005, corresponderá enviar el archivo "OPTERM.TXT" incluyendo el diseño 4609 (además del diseño 4601 con información correspondiente a la primer semana estadística). Dicho diseño tendrá el mismo formato que el 4601, reemplazando el campo 1 "Código de diseño" por 4609.
El campo 3 "Fecha de información" se integrará con 20050407.
El campo 11 "Concepto" sólo podrá completarse con 1 o 3, es decir, "Alta de Compras" o "Alta de ventas", respectivamente.
En caso de no poseer datos a informar, se enviará el diseño 4609, completando los campos 1 a 3 y el de rectificativa e integrando los restantes campos con blancos o ceros según corresponda.
- b) Controles de validación: se aplicarán las leyendas de error vigentes para el diseño 4601, aclarándose que para el error 14 "Novedad duplicada" sólo se admitirá un registro para igual combinación de los atributos correspondientes a los campos 4 a 10.
- c) Controles adicionales para el diseño 4609

Código	Leyenda	Causa
901	FALTA INFORMAR DISEÑO 4609	El diseño no corresponde al 4609, o bien no se informó ningún registro con código de diseño 4609.
902	NO CORRESPONDENCIA ENTRE CÓDIGO DE DISEÑO Y CONCEPTO	Se consignó en el campo 11 "Concepto" un código distinto de 1 o 3.

Versión: 1º	COMUNICACIÓN "A" 4333	Vigencia: 08/04/2005	Página 7
-------------	-----------------------	-------------------------	----------