



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN “A” 4964	13/07/2009
-----------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular
CONAU 1 - 892

Régimen Informativo de Operaciones a Término.

Nos dirigimos a Uds. para comunicarles las nuevas disposiciones vinculadas con el “Régimen Informativo de Operaciones a Término”.

En ese sentido, se han modificado en el Apartado 1 - Tipo de Operación, los siguientes conceptos:

- 1.1. Operación a término **con vencimiento**
- 1.4. Operación a término **sin vencimiento**

Por otra parte, se aclara que en el caso de los contratos sin vencimiento, se deberá informar su baja en el Régimen Informativo cuando se cancelen.

Las presentes modificaciones tendrán vigencia para la presentación correspondiente a la última semana estadística de Julio de 2009.

En anexo se acompañan las hojas de la Circular CONAU-1 que corresponde reemplazar en el respectivo régimen.

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Ricardo O. Maero
Gerente de Régimen
Informativo

Guillermo R. Corzo
Subgerente General de Régimen
Informativo y Central de Balances

ANEXO



B.C.R.A.	REGIMEN INFORMATIVO CONTABLE MENSUAL
	16 – OPERACIONES A TERMINO

Instrucciones Particulares

Deberán informarse las compras y ventas a término y opciones de moneda extranjera identificando el ámbito de negociación o contraparte y el vencimiento de la operación.

Los movimientos deberán informarse totalizando las operaciones de la semana estadística que tengan en común los atributos solicitados.

Como cantidad de activo subyacente deberá informarse el importe en la moneda correspondiente a se activo.

Se informarán como Bajas las operaciones rescindidas o ejercidas con anterioridad a la fecha de vencimiento. **Para las operaciones sin vencimiento, siempre se informará su Baja cuando se cancelen.**

Las operaciones de swaps de moneda se informarán desagregando la transacción en tantas operaciones a término como pagos se hayan pactado.

Versión: 3°	COMUNICACIÓN "A" 4964	Vigencia: 13/07/2009	Página 2
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	REGIMEN INFORMATIVO CONTABLE MENSUAL
	16 – OPERACIONES A TERMINO

Datos Solicitados

1. Tipo de operación
 - 1.1. Operación a término **con vencimiento**
 - 1.2. Opción de compra
 - 1.3. Opción de venta
 - 1.4. **Operación a término sin vencimiento**

2. Ámbito de Negociación o Contraparte
 - 2.1. BCBA - INDOL
 - 2.2. ROFEX
 - 2.3. MAE
 - 2.4. DOMAY
 - 2.5. Residentes en el País – Sector Financiero
 - 2.6. Residentes en el País – Sector no Financiero
 - 2.7. Residentes en el exterior – Mercados autorregulados
 - 2.8. Residentes en el exterior – Otros

3. Activo Subyacente
 - 3.1. Moneda Extranjera

4. Moneda del Activo Subyacente: código SWIFT

5. Moneda de Liquidación: código SWIFT

6. Fecha de vencimiento (dd/mm/aaaa)

7. Cantidad de activo subyacente

8. Importe concertado en moneda de liquidación

9. Liquidación:
 - 9.1. Diaria de diferencias
 - 9.2. Al vencimiento de diferencias
 - 9.3. Con entrega
 - 9.4. Otra

10. Concepto
 - 10.1. Alta de Compras
 - 10.2. Baja de Compras
 - 10.3. Alta de Ventas
 - 10.4. Baja de Ventas

Versión: 3°	COMUNICACIÓN "A" 4964	Vigencia: 13/07/2009	Página 3
-------------	-----------------------	-------------------------	----------