



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN “A” 4967	24/07/2009
-----------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular
RUNOR 1 - 886

***Régimen Informativo Contable Mensual -
Operaciones a Término (R.I. - O.T.).***

Nos dirigimos a Uds. en relación a la Comunicación “A” 4964 relacionada con el régimen informativo de referencia.

Al respecto, les hacemos llegar en anexo las hojas que corresponde reemplazar en el Texto Ordenado de la Sección 22 de Presentaciones de Informaciones al Banco Central.

Les informamos que las principales modificaciones son:

- Adaptación del procedimiento para informar la ausencia de datos a las disposiciones del punto 1.3.1.2 de la Sección 1, mediante la incorporación de la opción “NO OPERA” en el punto 22.1.3;
- Modificación de la Gerencia a la que se debe dirigir la nota solicitando la excepción en la presentación (punto 22.1.4);
- Discontinuación del envío de las posiciones semanales calculadas en esta Institución, con la consecuente eliminación de los puntos 22.2.7. y 22.2.8. ;
- Eliminación del punto 22.5. Modelo de comprobante de validación;
- Modificación de la leyenda de error 09 del punto 22.6;

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Ricardo O. Maero
Gerente de Régimen Informativo

Guillermo Corzo
Subgerente General de Régimen Informativo y
Central de Balances

ANEXO: 3 HOJAS



B.C.R.A.	PRESENTACION DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	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 deberá elegir la opción "NO OPERA" al momento de enviar la información.**

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 Régimen Informativo** 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 **con vencimiento**
- 2: **Opción** de compra
- 3: **Opción** de venta
- 4: **Operación a término sin vencimiento**

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: 3º	COMUNICACIÓN "A" 4967	Vigencia: 24/07/2009	Página 1
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACION DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	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).

22.3. Validación de la información.

Una vez procesada la información, si ésta resulta válida, el B.C.R.A. emitirá el pertinente comprobante de validación.

22.4. Diseño de registro.

Versión: 3º	COMUNICACIÓN “A” 4967	Vigencia: 24/07/2009	Página 2
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.	PRESENTACION DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	Sección 22. Operaciones a Término

22.6. Tabla de errores de validación.

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 ERRONEA	Se trata de una fecha: - inexistente (por ejemplo 20021335), - contiene caracteres no numéricos, - se completó con todos ceros (excepto cuando en el campo 4 se informa código 4) o bien, - es anterior o igual al primer día de la semana estadística que se informa.

Versión: 3º	COMUNICACIÓN "A" 4967	Vigencia: 24/07/2009	Página 4
-------------	-----------------------	-------------------------	----------