



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN “A” 5228

26/09/2011

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular
RUNOR 1 - 974

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

Nos dirigimos a Uds. para hacerles llegar el nuevo Texto Ordenado de las instrucciones operativas correspondientes al régimen informativo de referencia, de acuerdo con las disposiciones difundidas mediante la Comunicación “A” 5227.

Se señala que las principales modificaciones son:

- Incorporación de los campos 14, 15 y 16 en el diseño 4601.
- Incorporación de los puntos 22.2.6 a 22.2.7 relacionadas con instrucciones de cómo integrar los campos mencionados en el acápite anterior.
- Adecuación de la leyenda de error 14 ante la incorporación de los campos 14 y 15.
- Incorporación de las leyendas de error 15, 16 y 17.
- Incorporación de las leyendas de error 201 y 202 vinculadas con criterios de validación entre Posición General de Cambios y Operaciones a Término.

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Ricardo O. Maero
Gerente Principal de
Régimen Informativo

Estela M. del Pino Suárez
Subgerente General de Régimen Informativo y
Central de Balances a/c

ANEXO



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: 4a	COMUNICACIÓN "A" 5228	Vigencia: 11/10/2011	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. La fecha a consignar en el campo 14 “Fecha de Concertación de la Operación” deberá corresponder a una fecha comprendida dentro de la semana estadística informada de acuerdo con la fecha consignada en el campo 3.

22.2.7. El campo 15 “Número de Identificación de la Contraparte” será de integración obligatoria cuando se trate de operaciones de futuros realizadas en mercados no regulados, y se completará de acuerdo con el siguiente esquema:

- Si se informó en campo 5, códigos 03, 05 o 06, en este campo se consignará el número de CUIT.
- Si se informó en campo 5, códigos 07 o 08, el número de identificación se informará de la siguiente manera:
 - En los cinco primeros dígitos se registrará el código de la entidad informante que será el número de la cuenta corriente abierta en esta Institución;
 - En los dos siguientes se incluirán los caracteres correspondientes al código de país de residencia de las personas físicas o jurídicas radicadas en el exterior, de acuerdo con la codificación de Country Codes del SWIFT;
 - En los cuatro dígitos restantes se utilizará un único número correlativo para cada una de ellas, cuyas tres últimas posiciones deberán coincidir con las asignadas cuando se utilizaba como código de país el numérico de tres posiciones previsto en la codificación de países y territorios difundido por la Comunicación “A” 3147.
- En los restantes casos se integrará con ceros.

22.2.8. El campo 16 “Denominación de la Contraparte” sólo deberá integrarse cuando se haya consignado en campo 5 los códigos 03 o 05 a 08. No deberá contener caracteres tabuladores ni comillas. Deberá generarse en caracteres mayúsculas sin acento.

Versión: 4a	COMUNICACIÓN “A” 5228	Vigencia: 11/10/2011	Página 2
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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

22.2.9. 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 **cada día (campo 14)** que tengan en común los siguientes atributos: Tipo de operación (campo 4), Ámbito de negociación o contraparte (campo 5) o **Número de Identificación de la Contraparte (campo 15)**, 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: 3a	COMUNICACIÓN "A" 5228	Vigencia: 11/10/2011	Página 3
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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

Denominación: Operaciones a término				Hoja 1 de 2
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)

Versión: 4a	COMUNICACIÓN "A" 5228	Vigencia: 11/10/2011	Página 4
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



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

Denominación: Operaciones a término				Hoja 2 de 2
N° Campo	Nombre	Tipo (1)	Longitud	Observaciones
14	Fecha de Concertación de la Operación	Numérico	8	AAAAMMDD.
15	Número de Identificación de la Contraparte	Numérico	11	Según pto. 22.2.7. de estas instrucciones.
16	Denominación de la Contraparte	Carácter	50	Según pto. 22.2.8. de estas instrucciones.
17	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.				



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

22.5. 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 ERRÓNEA	Se trata de una fecha: <ul style="list-style-type: none"> - 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.
10	INFORMACIÓN ANTICIPADA	Se envió la información semanal, no encontrándose validada la de la semana estadística anterior.

Versión: 4a	COMUNICACIÓN "A" 5228	Vigencia: 11/10/2011	Página 6
-------------	-----------------------	-------------------------	----------



B.C.R.A.		PRESENTACION DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL	
		Sección 22. Operaciones a término	
Código	Leyenda	Causa	
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 la misma fecha de concertación de la operación (campo 14) con idéntica combinación de campos: tipo de operación (campo 4), ámbito de negociación o contraparte (campo 5), Nº de Identificación de la Contraparte (campo 15) , 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).	
15	FECHA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN ERRONEA (CAMPO 14)	<p>Se trata de una fecha:</p> <ul style="list-style-type: none"> - inexistente (por ejemplo 20021335), - contiene caracteres no numéricos, - se completó con todos ceros, o bien - no corresponde a una fecha comprendida de la semana estadística que se informa. 	
16	NUMERO DE IDENTIFICACION MAL INFORMADA (CAMPO 15)	<ul style="list-style-type: none"> - Habiéndose informado en campo 5 códigos 03, 05 o 06, el número de identificación informado en este campo no corresponde a una Clave Única de Identificación Tributaria (CUIT) válida, o bien - Habiéndose informado en campo 5 códigos 07 u 08, se integró con ceros este campo, o bien - Para los restantes códigos del campo 5 no se integró el campo 15 con ceros. 	
17	DENOMINACIÓN DE LA CONTRAPARTE MAL INFORMADO (CAMPO 16)	<p>Habiéndose informado en campo 5 códigos 03, 05 a 08:</p> <ul style="list-style-type: none"> - la denominación informada contiene uno o más caracteres no habilitados, o bien - Se integró este campo con blancos. 	



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

VALIDACIÓN DE ENTRE POSICION GENERAL DE CAMBIOS Y OPERACIONES A TERMINO		
Código	Leyenda	Causa
201	DISCREPANCIA EN CONCERTACIONES DE COMPRAS A TERMINO EN MONEDA EXTRANJERA DIA XX	<ul style="list-style-type: none"> - Para la fecha señalada, el total equivalente en dólares estadounidenses de "Altas de Compras" (C11=1) menos las "Bajas de Compras"(C11=2) informado en campo 12 para operaciones liquidables en pesos (C8=ARS) no se corresponde con el importe citado en PGC por el mismo concepto, o bien, - Para la fecha señalada, se informó con ceros este concepto en la PGC.
202	DISCREPANCIA EN CONCERTACIONES DE VENTAS A TERMINO EN MONEDA EXTRANJERA DIA XX	<ul style="list-style-type: none"> - Para la fecha señalada, el total equivalente en dólares estadounidenses de "Altas de Ventas" (C11=3) menos las "Bajas de Ventas"(C11=4) informado en campo 12 para operaciones liquidables en pesos (C8=ARS) no se corresponde con el importe citado en PGC por el mismo concepto, o bien, - Para la fecha señalada, se informó con ceros este concepto en la PGC.



B.C.R.A.	PRESENTACION DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	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 "OP-TERM.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.