



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "A" 6098	11/11/2016
-----------------------	------------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular
RUNOR 1 - 1240

Régimen Informativo para Supervisión Trimestral / Anual. Medición y Seguimiento del Riesgo de Liquidez. Modificaciones.

Nos dirigimos a Uds. para hacerles llegar en anexo las hojas que corresponde reemplazar de la Sección 48. de "Presentación de informaciones al Banco Central", en función de las disposiciones difundidas mediante la Comunicación "A" 6097.

En tal sentido, se destacan los siguientes cambios:

Cuadro I:

- Incorporación de la partida 252240/M "Depósitos judiciales".
- Adecuación de la denominación de las partidas 250200/M, 251200/M y 252231/M.
- Eliminación de la partida 240000/M.

Saludamos a Uds. atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Rodrigo J. Danessa
Gerente de Régimen
Informativo

Ricardo O. Maero
Gerente Principal de Régimen Informativo
y Centrales de Información

ANEXO



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	Sección 48. Medición y Seguimiento del Riesgo de Liquidez.

Salidas (cont.)

Código de Partida	Código de moneda	Concepto	Valor	Importe Mes 1	Importe Mes 2	Importe Mes 3
Campo 1	Campo 2		Campo 3	Campo 4	Campo 5	Campo 6
250000/M		Requerimientos adicionales.				
250100/M		Salidas de efectivo procedentes de operaciones con derivados.				
250200/M		Cláusulas activadas por deterioro significativo en la calidad crediticia de la entidad.				
250300/M		Cambios en valor de mercado de activos en garantía.				
250400/M		Garantías no segregadas mantenidas en exceso por la entidad financiera.				
250500/M		Garantías vinculadas con operaciones cuya integración podría - de acuerdo con lo previsto en el contrato- ser exigida en cualquier momento por la contraparte.				
250600/M		Contratos que permiten la sustitución de garantías.				
250700/M		Cambios en el valor de mercado de operaciones que requieren integración de garantía.				
250800/M		Pérdida de fondeo en títulos valores y otras facilidades de financiación.				
250900/M		Porción no utilizada de las facilidades de crédito y de liquidez comprometidas con:				
250910/M		Clientes minoristas y MiPyMEs.				



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	Sección 48. Medición y Seguimiento del Riesgo de Liquidez.

Salidas (cont.)

Código de Partida	Código de moneda	Concepto	Valor	Importe Mes 1	Importe Mes 2	Importe Mes 3
Campo 1	Campo 2		Campo 3	Campo 4	Campo 5	Campo 6
250920/M		Empresas del sector privado no financiero.				
250921/M		Facilidades de liquidez.				
250922/M		Facilidades de crédito.				
250930/M		Gobierno nacional, otros estados soberanos y sus bancos centrales y bancos multilaterales de desarrollo.				
250931/M		Facilidades de liquidez.				
250932/M		Facilidades de crédito.				
250940/M		Entidades financieras del país.				
250950/M		Entidades cambiarias, aseguradoras, agentes regulados por la C.N.V. y fiduciarios de fideicomisos no financieros.				
250951/M		Facilidades de liquidez.				
250952/M		Facilidades de crédito.				
250960/M		Otras personas jurídicas, sector público no financiero -excepto el Gobierno Nacional-, y entes no incluidos en los códigos anteriores.				
251000/M		Obligaciones contractuales de concesión de fondos dentro del período de 30 días.				
251100/M		A instituciones financieras, entidades cambiarias, aseguradoras, agentes regulados por la C.N.V. y fiduciarios de fideicomisos no financieros.				
251200/M		A clientes minoristas , MIPyMES y a empresas del sector privado no financiero. Excedente sobre el 50 % de entradas.				



B.C.R.A.	PRESENTACIÓN DE INFORMACIONES AL BANCO CENTRAL
	Sección 48. Medición y Seguimiento del Riesgo de Liquidez.

Salidas (cont.)

Código de Partida	Código de moneda	Concepto	Valor	Importe Mes 1	Importe Mes 2	Importe Mes 3
Campo 1	Campo 2		Campo 3	Campo 4	Campo 5	Campo 6
252000/M		Otras obligaciones contingentes de financiación.				
252100/M		Procedentes de instrumentos de financiación de operaciones de comercio exterior.				
252200/M		Otras obligaciones contingentes de provisión de fondos.				
252210/M		Facilidades de crédito y liquidez "no comprometidas".				
252220/M		Garantías y cartas de crédito no relacionadas con operaciones de financiación al comercio exterior.				
252230/M		Otras obligaciones no contractuales.				
252231/M		Por solicitudes de recompra de deuda de la misma entidad o por vehículos de inversión vinculados u otra facilidad financiera de ese tipo.				
252232/M		Por productos estructurados para mantener su negociabilidad.				
252233/M		Fondos administrados que se comercializan con el objeto de mantener estable su valor.				
252240/M		Depósitos judiciales.				
252300/M		Obligaciones no contractuales en las que las posiciones vendidas de clientes se cubren con activos de garantía de otros clientes.				
252400/M		Obligaciones no contractuales relacionadas con UTEs o inversiones minoristas que no se consolidan.				
253000/M		Otras salidas de efectivo contractuales.				
253100/M		Títulos de deuda en circulación.				
253200/M		Por posiciones vendidas descubiertas.				
253300/M		Otras salidas contractuales de efectivo no contempladas en los subcódigos previos.				

Las partidas sombreadas no se informarán.