



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 11916	6/12/2019
------------------------	-----------

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: ***Tasas continuas de descuento para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión. Comunicación "A" 6397.***

Nos dirigimos a Uds. para comunicarles las tasas continuas de descuento al 30/11/2019 (Anexo I), a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

Saludamos a Uds. atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

Mariana A. Diaz
Subgerente de Normas Contables
y Regímenes Cambiarios

Rodrigo J. Danessa
Gerente Principal de Régimen Informativo y
Centrales de Información a/c

ANEXO



B.C.R.A.	ANEXO I	Anexo a la Com. "B" 11916
----------	---------	---------------------------------

Tasas continuas de descuento, a ser utilizadas por las entidades financieras dentro del marco estandarizado para la medición del riesgo de tasa de interés en la cartera de inversión (RTICI), según las normas sobre "Lineamientos para la gestión de riesgos en las entidades financieras" (Com. "A" 6397).

30.11.19

Punto medio de la banda temporal (t_k) en años	Tasa de interés conti- nua $R(t_k)$ en Pesos	Tasa de interés conti- nua $R(t_k)$ en Dólares
0,0028	59,36%	321,83%
0,0417	64,53%	301,62%
0,1667	78,64%	247,46%
0,375	95,07%	184,20%
0,625	106,15%	136,36%
0,875	110,79%	106,22%
1,25	110,40%	78,84%
1,75	103,00%	58,67%
2,5	87,77%	43,02%
3,5	69,47%	32,51%
4,5	55,95%	26,67%
5,5	46,31%	22,95%
6,5	39,33%	20,38%
7,5	34,13%	18,49%
8,5	30,12%	17,05%
9,5	26,96%	15,91%
12,5	20,49%	13,59%
17,5	14,63%	11,48%
25,0	10,24%	9,90%