



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

COMUNICACIÓN "B" 12022	10/6/2020
------------------------	-----------

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 31/05/2020 (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

Silvina Ibañez
Subgerente de Regímenes Prudenciales
y Normas de Auditoría

Mariana A. Diaz
Gerente de Régimen
Informativo a/c

ANEXO



B.C.R.A.	ANEXO I	Anexo a la Com. "B" 12022
----------	---------	---------------------------------

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).

31.05.20

Punto medio de la banda temporal (t_k) en años	Tasa de interés continúa $R(t_k)$ en Pesos	Tasa de interés continúa $R(t_k)$ en Dólares
0,0028	25,33%	241,48%
0,0417	26,50%	231,13%
0,1667	29,86%	201,78%
0,375	34,33%	163,61%
0,625	38,19%	130,63%
0,875	40,79%	107,15%
1,25	43,00%	83,26%
1,75	43,95%	63,71%
2,5	43,21%	47,38%
3,5	40,87%	36,05%
4,5	38,49%	29,71%
5,5	36,50%	25,66%
6,5	34,93%	22,86%
7,5	33,70%	20,81%
8,5	32,73%	19,24%
9,5	31,95%	18,00%
12,5	30,34%	15,47%
17,5	28,89%	13,19%
25,0	27,80%	11,47%