



BANCO CENTRAL
DE LA REPÚBLICA ARGENTINA

| | |
|------------------------|------------|
| COMUNICACIÓN "B" 12101 | 10/12/2020 |
|------------------------|------------|

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 30/11/2020 (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

ANEXO



| | | |
|----------|---------|---------------------------------|
| B.C.R.A. | ANEXO I | Anexo a la Com. "B" 12101 |
|----------|---------|---------------------------------|

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).

30.11.20

| Punto medio de la banda temporal (t_k) en años | Tasa de interés continua $R(t_k)$ en Pesos | Tasa de interés continua $R(t_k)$ en Dólares |
|--|--|--|
| 0,0028 | 33,37% | 15,15% |
| 0,0417 | 34,35% | 15,17% |
| 0,1667 | 37,21% | 15,21% |
| 0,375 | 41,08% | 15,28% |
| 0,625 | 44,50% | 15,35% |
| 0,875 | 46,89% | 15,42% |
| 1,25 | 49,05% | 15,50% |
| 1,75 | 50,18% | 15,59% |
| 2,5 | 49,86% | 15,67% |
| 3,5 | 48,02% | 15,69% |
| 4,5 | 45,95% | 15,63% |
| 5,5 | 44,15% | 15,51% |
| 6,5 | 42,68% | 15,34% |
| 7,5 | 41,51% | 15,13% |
| 8,5 | 40,58% | 14,88% |
| 9,5 | 39,82% | 14,61% |
| 12,5 | 38,26% | 13,69% |
| 17,5 | 36,84% | 12,06% |
| 25,0 | 35,78% | 9,85% |