



BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

COMUNICACION " B " 6812

I

31/01/01

A LAS ENTIDADES FINANCIERAS:

Ref.: Circular LISOL-1-194.

Exigencia de capital mínimo por riesgo de mercado. Volatilidades para febrero de 2001

Nos dirigimos a Uds. en relación con el tema de la referencia para hacerles conocer en anexo las volatilidades diarias y zonas que corresponden a los títulos valores públicos nacionales y acciones del panel "MERVAL", a los efectos de calcular durante febrero de 2001 la exigencia diaria de capital mínimo en función del valor a riesgo de las posiciones que se determinen para tales activos, conforme a la metodología a que se refiere el punto 7.2. de la Sección 7. de las normas sobre "Capitales mínimos de las entidades financieras".

Saludamos a Uds. muy atentamente.

BANCO CENTRAL DE LA REPUBLICA ARGENTINA

Juan Carlos Isi
Gerente de Consultas
Normativas

José I. Rutman
Gerente Principal
de Normas

ANEXO



B.C.R.A.	EXIGENCIA DE CAPITAL MINIMO POR RIESGO DE MERCADO. VOLATILIDADES PARA FEBRERO DE 2001	Anexo a la Com. "B" 6812
----------	---	--------------------------------

Especie	Volatilidad diaria	Zona "md"
1. Títulos Públicos		
Bonos Externos Globales R.A. 2001 - 9,25%	0,0020	3
Bonos Externos Globales R.A. 2003 - 8,375%	0,0095	3
Bonos Externos Globales R.A. 2005 - 11%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2006 - 11%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2009 - 11,75%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2010 - 11,375%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2015 - 11,75%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2017 - 11,375%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2019 - 12,125%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2020 - 12%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2027 - 9,75%	0,0155	4
Bonos Externos Globales R.A. 2030 - 10,25%	0,0155	4
Bonos Externos Globales Serie B - vto. 15.04.2001	0,0020	3
Bonos Externos Globales Serie C - vto. 15.10.2001	0,0060	3
Bonos Externos Globales Serie D - vto. 15.10.2002	0,0095	3
Bonos Externos Globales Serie E - vto. 15.10.2003	0,0155	4
Bonos Externos Globales Serie F - vto. 15.10.2004	0,0155	4
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Badlar vto. 14.07.2001	0,0020	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Encuesta vto. 14.07.2001	0,0020	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Badlar 2a. Serie vto. 2.11.2001	0,0060	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Encuesta 2a. Serie vto. 2.11.2001	0,0060	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Encuesta 3a. Serie vto. 24.4.2002	0,0095	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Encuesta 4a. Serie vto. 22.8.2002	0,0095	3
Bonos del Gobierno a Tasa Variable según Encuesta vto. 30.10.2002	0,0095	3
Bonos del Tesoro a mediano plazo al 8,75% vto. 09.05.2002	0,0095	3
Bonos del Tesoro a mediano plazo a Tasa Variable vto. 21.07.2003	0,0095	3
Bonos del Tesoro a largo plazo al 9,9375% vto. 19.09.2027	0,0155	4
Bonos del Tesoro a mediano plazo al 9,50% vto. 24.05.2001	0,0020	3
Bonos del Tesoro a mediano plazo al 11,25% vto. 24.05.2004	0,0095	3
Bonos del Tesoro a mediano plazo al 11,75% vto. 21.05.2003	0,0095	3
Bonos del Tesoro a mediano plazo al 12,125% vto. 21.05.2005	0,0155	4
Bonos Externos 1992	0,0060	3
Bonos de Cons. de Deudas Prev. en moneda nacional	0,0030	1
Bonos de Cons. de Deudas Prev. en m. n. 2da. serie	0,0075	1
Bonos de Consolidación en moneda nacional-1a. serie	0,0135	1
Bonos de Consolidación en moneda nacional-2a. serie	0,0195	2



Bonos de Consolidación en moneda nacional-3a. serie	0,0195	2
Letras Externas de la República Argentina al 8,75%	0,0135	1
Letras Externas de la República Argentina al 11,75%	0,0195	2
Bonos de Cons. de Deudas Prev. en US\$	0,0020	3
Bonos de Cons. de Deudas Prev. en US\$ 2da. serie	0,0060	3
Bonos de Consolidación en US\$ - 1a. serie	0,0095	3
Bonos de Consolidación en US\$ - 2a. serie	0,0155	4
Bonos de Consolidación en US\$ - 3a. serie	0,0095	3
Bonos de la Rep. Argentina Cupón Variable vto. 2005	0,0155	4
Letras Externas de la Rep. Arg. en US\$ vto. 2004	0,0095	3
Letras del Tesoro US\$ (LE 67, 75, 77, 80, 82, 84, 85 y 86)	0,0020	3
Letras del Tesoro US\$ (LE 83)	0,0060	3
Bonos Garantizado a Tasa Fija R.A. en US\$ (PAR)	0,0155	4
Bonos a Tasa Flotante en US\$ (F.R.B.)	0,0095	3
Bonos Garant. a Tasa Flotante R.A. en US\$ (DISCOUNT)	0,0155	4

2. Acciones

Acindar	0,0400	-
Atanor	0,0300	-
Banco Francés	0,0350	-
Banco Galicia	0,0350	-
Banco Río	0,0350	-
Banco Suquía	0,0350	-
Bansud	0,0350	-
Capex	0 0200	-
Central Costanera	0,0300	-
Central Puerto	0 0200	-
Comercial del Plata	0,0400	-
Grupo Financiero Galicia	0,0350	-
Indupa	0,0350	-
IRSA	0,0200	-
Juan Minetti	0,0300	-
Ledesma	0,0300	-
Molinos Río de la Plata	0,0350	-
PC Holdings	0,0200	-
Renault	0,0400	-
Repsol	0,0200	-
Santander C. Hispano	0,0300	-
Siderar	0,0350	-
Siderca	0,0300	-
Telecom	0,0300	-
Telefónica de Argentina	0,0300	-
Telefónica S.A.	0,0300	-
Transportadora de Gas del Sur	0,0200	-
YPF	0,0200	-