

INSTRUCTIVO PARA EL USO DEL LIBRO DIGITAL DE ÓRDENES Y LIBRO DIGITAL DE OPERACIONES

1) ¿Qué es el Libro de Ordenes? ¿Qué es el Libro de Operaciones?

El Agente tiene la obligación de llevar un *registro* donde asentará diariamente, en forma secuencial y cronológica, *las órdenes* recibidas de sus *Comitentes*. Este registro debe encontrarse indefectiblemente al día y debe asegurar la inalterabilidad de los datos contenidos en el mismo. Asimismo, es obligación del Agente llevar un *registro* donde asentará diariamente las *operaciones realizadas para cartera propia* y para cuenta de *Comitentes*. Este registro debe encontrarse indefectiblemente al día y debe asegurar la inalterabilidad de los datos contenidos en el mismo.

2) ¿Qué es el Libro Digital de Ordenes? ¿Qué es el Libro Digital de Operaciones?

El Libro Digital de Ordenes es el sistema provisto por ROFEX® que permite la registración en soporte digital, en forma diaria, secuencial y cronológica, de las órdenes de los Comitentes, asegurando la veracidad e inalterabilidad de los registros. El Libro Digital de Operaciones es el sistema implementado por ROFEX para la registración en soporte digital y en forma diaria de las operaciones realizadas, tanto para cartera propia como para cuenta de Comitentes, asegurando la veracidad e inalterabilidad de los registros.

Ambos registros digitales tienen como interfaz la aplicación *AnywherePortfolio* y vienen a reemplazar el actual sistema de registro manual de órdenes y operaciones, proveyendo de esta manera de la información digitalizada de éstos registros.

3) ¿Cómo se lleva el Libro Digital de Órdenes y Operaciones?

Es obligación del Agente descargar diariamente un archivo en formato “.pdf” desde la aplicación *AnywherePortfolio*, con los registros del Libro Digital de Órdenes y del Libro Digital de Operaciones correspondientes a la rueda del día de la descarga.

- 4) ¿Cuánto tiempo están disponibles para su descarga los registros diarios del Libro Digital de Órdenes y del Libro Digital de Operaciones publicados en *AnywherePortfolio*?

Los registros diarios de ambos Libros estarán disponibles en la aplicación *AnywherePortfolio* durante un máximo de cuarenta y cinco (45) días calendario para ser recuperadas por el Agente.

- 5) ¿Cómo deben resguardarse los archivos descargados? ¿Por cuánto tiempo deben conservarse los registros?

Existen dos alternativas para resguardar los registros del Libro Digital de Órdenes y del Libro Digital de Operaciones: a través de un medio óptico o mediante su impresión en un Libro llevado al efecto.

El Agente debe almacenar los archivos descargados diariamente desde *AnywherePortfolio*, pudiendo hacerlo en un medio óptico (CD-R, CD-RW, DVD-R, DVD-RW, Blu-ray (*)) al menos en forma mensual, o bien optar por imprimir los mismos y adherirlos a un libro rubricado por ROFEX.

() El medio óptico utilizado deberá poseer nro. de serie puesto por el fabricante.*

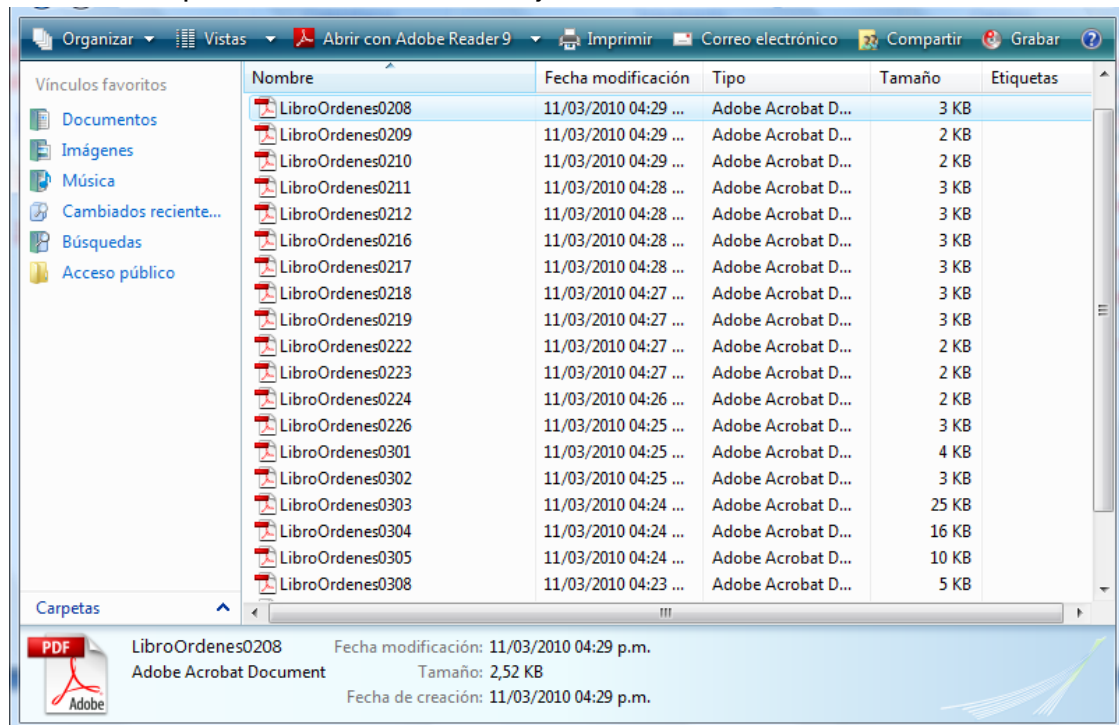
En el caso de optar por almacenar los mismos en un medio óptico, el Agente deberá llevar un libro foliado que contenga por cada soporte los siguientes datos:

- a) **Denominación del registro**, ej: “Registro de órdenes”
- b) **Mes y año al que corresponde el registro**, ej: “03/2010”
- c) **Nombre del(los) archivo(s) grabados en el soporte**; ej: “operaciones marzo”
- d) **Fecha de primera y última registración**, ej: “01/03/2010; 31/03/2010”
- e) **Cantidad de archivos que contiene el registro**; ej: “5 archivos”
- f) **Cadena de caracteres alfanuméricos obtenida de los archivos contenidos en el soporte, lograda mediante el algoritmo criptográfico MD5.**

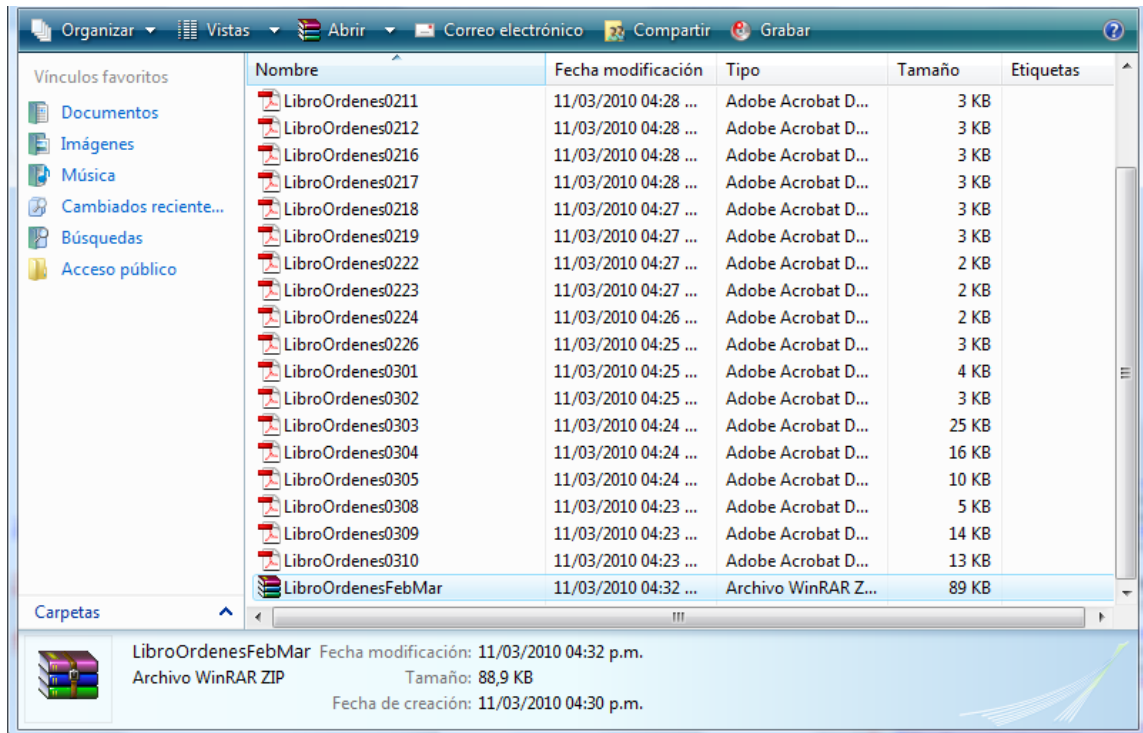
- g) Numeración del CD o DVD puesta por el fabricante (ubicado en el orificio del soporte al dorso)
- h) Número interno de los CDs o DVDs que será una asignación numérica correlativa ascendente comenzando con el Nro. 1.

A los fines de obtener el algoritmo MD5 previsto en el punto f) que permite asegurar la inalterabilidad de los registros, el Agente, previo a efectuar el respaldo en el medio óptico, deberá proceder siguiendo las instrucciones que se detallan a continuación:

- 1) Almacenar los archivos correspondientes al registro de órdenes u operaciones en una misma carpeta, identificando los archivos correspondientes a cada día. Ej:

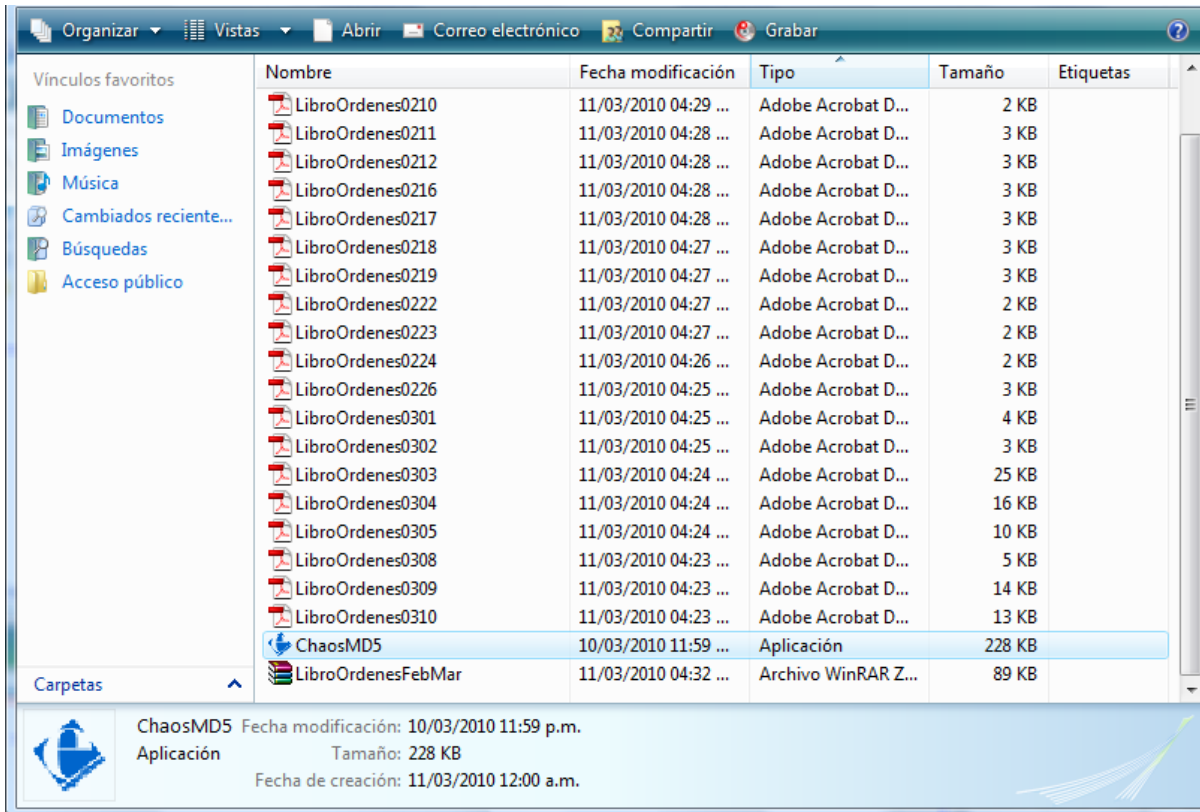


- 2) Comprimir en un único fichero .ZIP los archivos mencionados en el punto anterior.

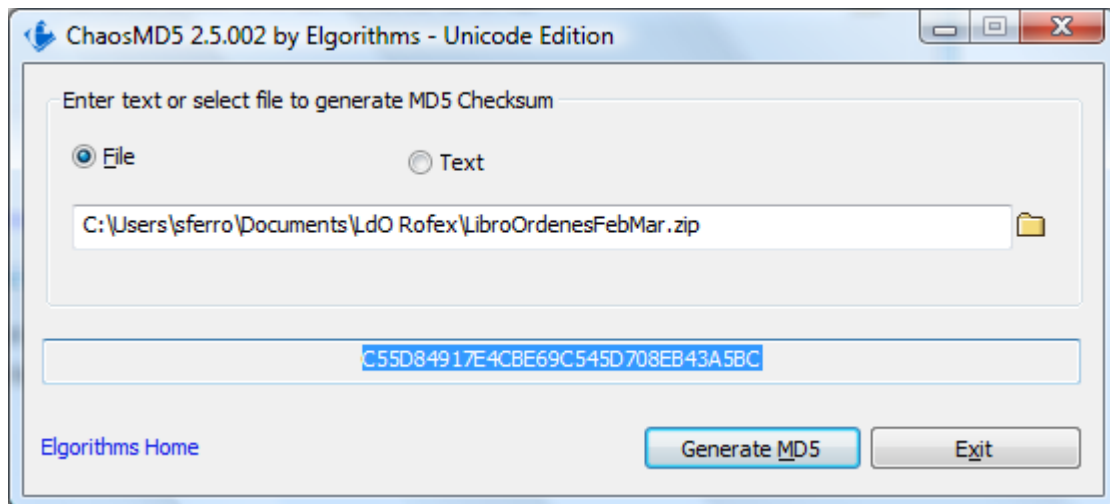


- 3) Descargar archivo ChaosMD5.zip del sitio web <http://www.rofex.com.ar/tecnologia/ChaosMD5.zip>

- 4) Extraer ChaosMD5.exe en la misma carpeta donde se encuentra el fichero comprimido.



- 5) Ejecutar ChaosMD5, elegir opción "File" y seleccionar el archivo generado en punto 2).



- 6) Presionar el botón Generate MD5 y copiar y/o transcribir el digesto de mensaje (marcado en azul) para su posterior registro en el libro llevado a tal efecto.

En el caso de optar por volcar los registros en un Libro rubricado, al adherirse las hojas impresas del registro deberá cruzarse la firma y sello del Agente entre la hoja adherida y el folio del libro, sin dejar espacios en blanco entre las hojas adheridas ni ingresar órdenes u operaciones en forma manual, de modo de asegurar la inalterabilidad de los registros.

A los fines de optar por una de estas alternativas, el Agente deberá presentar ante ROFEX la nota modelo que figura en el Anexo I del presente documento para constancia.

Tiempo de conservación: la información correspondiente al Libro Digital de Órdenes y al Libro Digital de Operaciones se conservará por el plazo de diez (10) años, debiendo estar disponible para su consulta durante los dos (2) primeros años de dicho período. El Agente informará a ROFEX, mediante la presentación de la nota modelo elaborada al efecto, el medio elegido para las copias de resguardo de los registros del Libro Digital de Órdenes y del Libro Digital de Operaciones, en oportunidad de su primer uso, así como también al momento de cambiar este método.

- 6) ¿Qué información contiene el Libro Digital de Ordenes publicado en *AnywherePortfolio*?

- 1) Fecha
- 2) Hora, minuto y segundo.
- 3) Nro. de orden
- 4) Cuenta
- 5) Compra/Venta
- 6) Contratos
- 7) Tipo de operación: puede ser “Futuro”, “Put” o “Call”.
- 8) Sigla (ejemplos: DOJul10; SMay10 240)
- 9) Precio
- 10) Tipo de Orden (electrónica o piso)
- 11) Tipo de ejecución: (pantalla o Block Trade)

12) Usuario

13) Estado: sus posibles valores pueden ser “Ejecutada” o “No ejecutada”.

Funcionalidades:

- Las ordenes ingresadas en el sistema de negociación para **cuentas propias del Miembro Compensador**, no se registran en el Libro Digital de Ordenes.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para cuentas **a confirmar**, sólo se registran en el Libro Digital de Ordenes en caso de que las mismas hayan finalizado en una operación y ésta, posteriormente, haya sido asignada a una cuenta comitente. En este caso, la orden del Comitente se registrará con el horario de la orden ingresada con la cuenta a confirmar y no con el horario de la asignación.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para **cuentas a confirmar** que no hayan finalizado en una operación, no se registrarán en el Libro Digital de Ordenes.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para **cuentas a confirmar** que hayan finalizado en una operación, luego transferida en *give up* a otra **cuenta a confirmar** no se registrarán en el Libro Digital de Ordenes ni del Miembro Compensador emisor ni del Miembro Compensador receptor.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para **cuentas de comitentes (terceros)** que hayan finalizado o no en una operación, se registrarán en el Libro Digital de Ordenes.
- Las órdenes ingresadas a través de un funcionario de la Mesa de Operaciones de ROFEX serán identificadas con el usuario *monombre del usuario*
- Las órdenes de compra y/o venta que se ejecuten en el recinto se registrarán con el horario de la operación de piso.

- En el caso de correcciones en la rueda, de la cuenta comitente de un negocio ya cerrado, el libro digital de órdenes sólo reflejará tal situación cuando no se modifique el volumen de la transacción.
- Las correcciones fuera de rueda no se reflejarán en el libro digital de órdenes.

Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para cuentas propias y/o de comitentes de Agentes que no sean Miembros Compensadores, se registrarán como órdenes de comitentes del Miembro Compensador respectivo. Mismo criterio de registración aplicará para las órdenes de Operadores Individuales.

7) ¿Qué información contiene el Libro Digital de Operaciones publicado en *AnywherePortfolio*?

1. Fecha
2. Hora, minuto y segundo
3. Nro. de Boleta
4. Cuenta
5. Compra/Venta
6. Cantidad
7. Unidad de medida (ej.: toneladas, U\$S)
8. Tipo (puede ser Futuro, Put o Call).
9. Posición (ej.: DLR072010)
10. Ejercicio
11. Precio
12. Origen

Funcionalidades:

- Figuran todas las operaciones registradas ante Argentina Clearing. Los orígenes posibles son:
 - 1 – Rueda de Piso
 - 2 – Rueda Electrónica
 - 3 - Pase
 - 4 - Ejercicio
 - 5 - Corrección

- 6 - Caída opciones
- 7 - Caída futuros
- 8 - Cambio de comitentes
- 9 - Caída futuros entrega
- 11 - Futuro por Caída Opciones
- 14 - Cancelación Futuros con Entrega
- 15 - Entrega
- 20 y 21- Asignaciones
- 22 a 25 - Give Up

8) ¿Qué hacer en caso de dudas o mal funcionamiento del Registro de órdenes o del Registro de Operaciones en AnywherePortfolio?

En caso de dudas o errores en el funcionamiento de estos Registros, dirigirse a Atención al cliente: atencionalcliente@rofex.com.ar .

ANEXO I

FO 7.03.19 Registro de Ordenes y Registro de Operaciones

“Sres. Mercado a Término de Rosario SA

Departamento de Fiscalización y Control

Presente

Ref.: “Registro de órdenes y Registro de Operaciones –”.

Por la presente informamos a Uds. que se utilizará el siguiente sistema para la recuperación y conservación del Registro de órdenes y Registro de operaciones:

Tildar el medio elegido

- Medio óptico (CD-R, CD-RW, DVD-R, DVD-RW, Blue-Ray)
- Libros debidamente foliados y rubricados por ROFEX
- Sistema propio a homologar por ROFEX

Características de los sistemas:

En caso de que se hubiera optado por CD no regrabable u otro medio óptico:

1. Se almacenarán los archivos descargados diariamente desde *AnywherePortofolio* en forma mensual, con las formalidades establecidas por las normas internas
2. Podrán ser leídos la cantidad de veces que sea requerido, permitiendo la consulta permanente de los listados a través del computador o de la impresión de la información.
3. Serán conservados por 5 años, estando disponibles para su consulta por el plazo de 2 años.

En caso de que se hubiera optado por libros foliados y rubricados:

1. Se descargarán diariamente los archivos desde *AnywherePortofolio* y serán adherirlos al libro rubricado por ROFEX, con las formalidades establecidas por las normas internas.
2. Serán conservados por el plazo legal de 10 años, estando disponibles para su consulta por el plazo de 2 años.

En caso de sistemas propios homologados por ROFEX, se estará a lo resuelto en la correspondiente autorización.

Sin más, le saluda a Uds. atentamente,

ANEXO II

REFERENCIAS NORMATIVAS:

- i) Texto ordenado Normas de la Comisión Nacional de Valores, Capítulo XXIV,

Artículo 16º.
- ii) ROFEX: artículo 35.2º, incisos d) e i) del Reglamento Interno; Aviso Nro. 237º.