

## **INSTRUCTIVO PARA EL USO DEL LIBRO DE ÓRDENES Y LIBRO DE OPERACIONES**

### **Aclaraciones Iniciales:**

*Los libros de Órdenes y Operaciones proporcionados a través de AnywherePortfolio contienen toda la operatoria efectuada en nuestro Mercado, como así también la realizada a través de interconexión en el Mercado de Valores de Buenos Aires (MerVal), por parte de nuestros agentes miembros.*

*El procedimiento detallado en el presente instructivo permite llevar el Libro de Operaciones acorde el CRI N° 59 de CNV, Sección II Puntos 1 y 2; debido a que en el mismo se distingue entre cartera propia (acorde al criterio de CNV) y cartera de terceros, de acuerdo con lo declarado por el propio Agente; y además permite identificar (dentro de las operaciones de cartera propia) las operaciones efectuadas por el propio Agente con sus propios fondos a través de la identificación del número de cuenta de la operación.*

*Los Agentes obligados a llevar estos registros son los Agentes de Negociación (AN), y los Agentes de Liquidación y Compensación (ALyC) en los términos que en los puntos siguientes se detallan.*

*Por otra parte también se encuentra disponible en AnywherePortfolio 5 el detalle/registro diario de las operaciones donde hayan intervenido los Agentes de Corretaje de Valores Negociables (ACVN), a los fines de confeccionar el libro especial exigido por las NORMAS de CNV que deben llevar estos agentes. Dicho registro deberá ser resguardado de la manera que se establece en el punto 3.2 del presente (no siendo de aplicación el resto de los puntos de este instructivo).*

### **1. ¿Qué es el Libro de Órdenes? ¿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 ingresadas para cartera propia como para sus Comitentes en el registro central de órdenes del Mercado. 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. ¿Cómo se lleva el Libro de Órdenes y Operaciones?**

El Agente deberá descargar diariamente un archivo desde la aplicación AnywherePortfolio, con los registros del Libro de Órdenes y del Libro de Operaciones correspondientes a la rueda del día de la descarga.

El Libro de Órdenes se encuentra disponible en **AnywherePortfolio 3** en formato “PDF” presionando el botón “Ver PDF”, y formato “texto delimitado por comas” presionando el botón “Descargar”.



**AnywherePortfolio**

Argentina Clearing S.A. Cerrar Sesión

- Operatoria
- Contabilidad
- Comprobantes
  - Operaciones
  - Déb. y Créd.
  - Flujos
  - Liq. Canc. Entrega
  - Facturación
  - Retenciones
  - Liquidaciones
  - Libro de Órdenes**
  - Libro de Operaciones
- Servicios
- Administración
- AP 4.0

Estimado Miembro Compensador:

Le recordamos que para mantener los más altos estándares de seguridad de los contratos que brindarles un servicio más ajustado a sus necesidades, **es crítico que antes de las 13:00 horas las precisiones que requieren:**

1. Los **Informes de pago:**
  - a. Sólo **se validarán** cuando el depósito **se acredite en la cuenta de destino**
  - b. Cualquier informe recibido posteriormente puede ser causa suficiente para la iniciación de pertinentes
2. Las **Solicitudes de extracción:**
  - a. Las recibidas posteriormente serán procesadas el día hábil siguiente



**AnywherePortfolio**

Cerrar Sesión Rosario, 6 de octubre

Fecha

< 2015 >

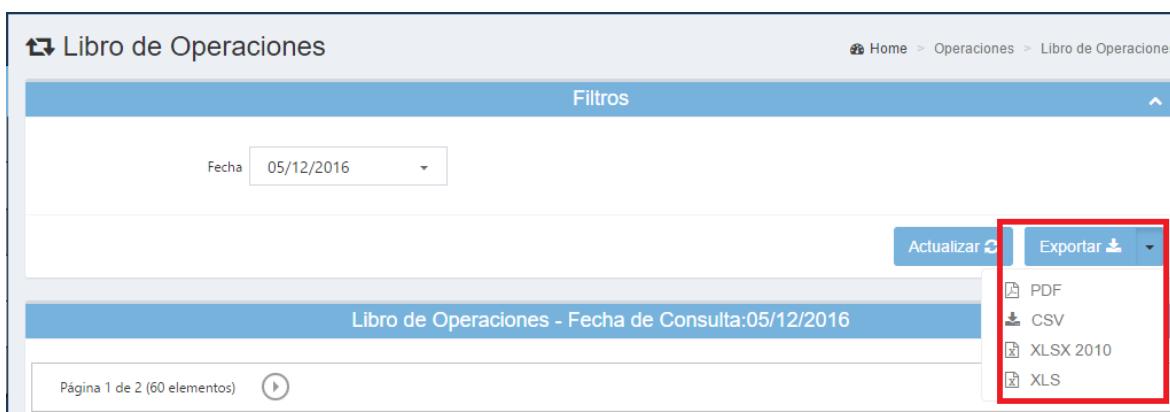
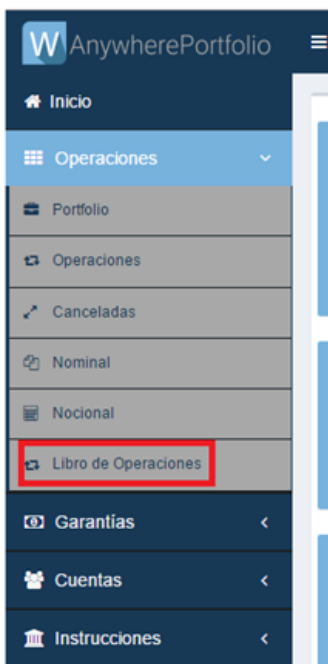
< Octubre de 2015 >

Dom	Lun	Mar	Mié	Jue	Vie	Sáb
27	28	29	30	1	2	3
4	5	6	7	8	9	10
11	12	13	14	15	16	17
18	19	20	21	22	23	24
25	26	27	28	29	30	31
1	2	3	4	5	6	7

MC: Todos

Mostrar Ver PDF Descargar

El Libro de Operaciones se encuentra disponible en **AnywherePortfolio 5** en varios formatos para poder editar la información (debido a lo establecido en la primera aclaración establecida en el punto 6 del presente instructivo).



### 3. ¿Cómo deben resguardarse los archivos descargados?

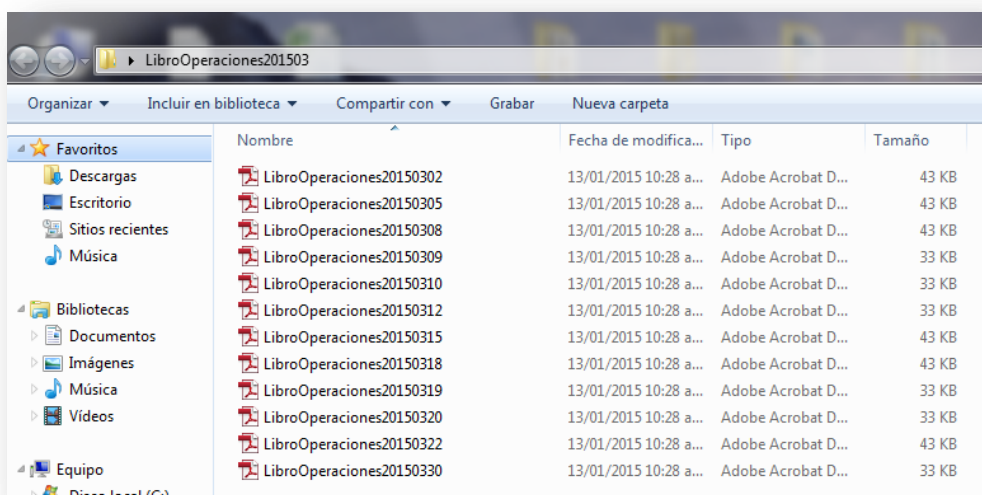
El Agente informará a ROFEX, mediante la presentación de la nota modelo elaborada al efecto (ver ANEXO I), el medio elegido para las copias de resguardo de los registros del Libro de Órdenes y del Libro de Operaciones, en oportunidad de su primer uso, así como también al momento de cambiar este método. Existen dos alternativas para resguardar los registros del Libro de Órdenes y del Libro de Operaciones:

- a. Mediante un medio de almacenamiento de archivos digitales (Ver punto 3.1).
- b. Mediante su impresión en un libro foliado y rubricado por la autoridad de registro correspondiente (Ver punto 3.2).

### 3.1 Mediante un medio de almacenamiento de archivos digitales. Procedimiento:

**3.1.1** Descargar diariamente los archivos pertenecientes al libro de órdenes y operaciones desde el área de AnywherePortofolio, denominada como “Libro de Órdenes” y “Libro de Operaciones” respectivamente.

**3.1.2** De manera mensual y por mes calendario, almacenar en una carpeta los archivos correspondientes al registro de órdenes y operaciones del mes inmediato anterior cerrado (cada libro en una carpeta separada), identificando claramente los archivos correspondientes a cada día. Ej: para el libro de operaciones del mes de Marzo de 2015 colocar en la carpeta el nombre “LibroOperaciones201503”, y para cada uno de los archivos contenidos en la misma colocar “LibroOperaciones20150301” para saber exactamente a qué año, mes y día pertenece el registro.



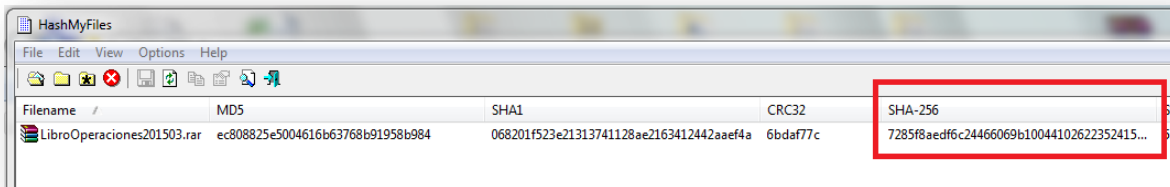
**3.1.3** Comprimir en un único fichero .ZIP (o .RAR) la carpeta contenedora de los archivos mencionados en el punto anterior.

**3.1.4** Previo a efectuar el respaldo en el medio de almacenamiento correspondiente, y a los fines de obtener el algoritmo “SHA256” del archivo comprimido (a utilizarse en el punto 3.1.6), que permite asegurar la inalterabilidad de los registros, podrá utilizar el software que a continuación se describe o bien otro similar de acuerdo con lo establecido en el punto 3.1.8. En el caso de optar por HashMyFiles deberá:

**3.1.4.1** Descargar archivo HashMyFiles.zip del sitio web <http://www.nirsoft.net/utills/hashmyfiles.zip>

**3.1.4.2** Abrir el Archivo HashMyFiles.zip, ejecutar HashMyFiles.exe, elegir la opción “Add Files”, dentro de la pestaña “File” y seleccionar el archivo generado en punto 3.1.3.

**3.1.4.3** Aparecerá un detalle del archivo con varios códigos algorítmicos como el MD5, el SHA1, entre otros (los que el software calcula por default), debiendo el Agente sólo copiar el código algorítmico perteneciente al código “SHA256”.



**3.1.5** Los archivos comprimidos pertenecientes a los registros de órdenes y operaciones pueden ser resguardados en cualquier medio apto para almacenar de forma inalterable y segura dichos archivos digitales (CD-R, CD-RW, DVD-R, DVD-RW, Blu-ray, Pen Drive, Tarjeta de memoria, Disco Rígido, o similares que cumplan la misma función). Además el Agente deberá efectuar un respaldo de los mismos en otro medio de almacenamiento digital distinto al principal seleccionado.

**3.1.6** Para dejar un registro físico e inalterable de los archivos digitales que conforman los libros de órdenes y de operaciones del Agente, se deberá llevar en un único libro de actas foliado y rubricado por la autoridad de registro correspondiente, denominado “Libro Índice de Órdenes y Operaciones” o “Libro de Órdenes y Operaciones” el cual contendrá los datos de los archivos comprimidos pertenecientes a cada uno de los libros y a cada mes calendario. El cuadro a completar es el que se muestra a continuación con los datos del ejemplo establecido en el punto 3.1.2 (Libro de Operaciones). Debajo se establece también el cuadro a utilizar para el Libro de Órdenes.

<b>Libro de Operaciones ROFEX</b>	<b>Año</b>	2015
	<b>Mes</b>	03
<b>Denominación del registro comprimido:</b>	LibroOperaciones201503	
<b>Fecha de la primer operación del mes:</b>	02/03/2015	
<b>Fecha de la última operación del mes:</b>	30/03/2015	
<b>Cantidad de archivos que contiene el registro comprimido:</b>	12	
<b>Cadena de caracteres alfanuméricos obtenida de los archivos contenidos en el soporte, lograda mediante el algoritmo criptográfico SHA256.</b>	7285f8aedef6c24466069b100441026223 52415ef73cfdebcd8d749b8f3aa492	

<b>Libro de Órdenes ROFEX</b>	<b>Año</b>	2015
	<b>Mes</b>	03
<b>Denominación del registro comprimido:</b>	LibroOrdenes201503	
<b>Fecha de la primer orden del mes:</b>	02/03/2015	
<b>Fecha de la última orden del mes:</b>	30/03/2015	
<b>Cantidad de archivos que contiene el registro comprimido:</b>	12	
<b>Cadena de caracteres alfanuméricos obtenida de los archivos contenidos en el soporte, lograda mediante el algoritmo criptográfico SHA256.</b>	7285f8aedef6c24466069b1004410262235 2415ef73cfdebcd8d749b8f3aa492	

**3.1.7** Luego de completar los cuadros los mismos deben ser impresos y pegados en el Libro Índice de Órdenes y Operaciones o Libro de Órdenes y Operaciones de manera mensual. Además deberá cruzarse la firma y sello del Agente entre cada 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.

**3.1.8** El Agente podrá utilizar el software al que se hace referencia en el punto 3.1.4.1 o cualquier otro software que permita calcular el mismo “hash” (el mismo código logarítmico) con el estándar “SHA256”.

### **3.2 Mediante su impresión en un libro foliado y rubricado llevado al efecto.**

#### **Procedimiento:**

**3.2.1** Descargar diariamente los archivos pertenecientes al libro de órdenes y operaciones desde el área de AnywherePortfolio, denominada como “Libro de Órdenes” y “Libro de Operaciones” respectivamente.

**3.2.2** Luego, diariamente también, se deberán volcar los registros en los libros foliados y rubricados por la autoridad de registro correspondiente, uno para las operaciones y otro para las órdenes. 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.

### **4. ¿Durante qué plazo deben resguardarse los Libros de Órdenes y de Operaciones?**

La información correspondiente al Libro de Órdenes y al Libro de Operaciones se conservará por el plazo mínimo de diez (10) años.

### **5. ¿Qué información contiene el Libro de Órdenes publicado en AnywherePortfolio?**

- 1) Fecha
- 2) Hora, minutos y segundos
- 3) Nro. de orden
- 4) Tipo Orden (\*)
- 5) Time in Force (\*\*)
- 6) Tipo: puede ser “Futuro”, “Put”, “Call”, “Combinada”, “Bono”, “Acción”.
- 7) Sigla (Ejemplo: DOFeb15, WTIMay15, MERV - XMEV - RO15D – CI).
- 8) Compra/Venta
- 9) Cantidad: corresponde a “Valor Nominal” en el caso de las acciones y títulos, y a “Cantidad de Contratos” en el caso de futuros y opciones sobre futuros.
- 10) Precio
- 11) Cuenta
- 12) CUIT/CUIL/CDI: muestra el número de CUIT, CUIL o CDI perteneciente a la cuenta que efectuó la orden.
- 13) Tipo Cartera: En caso de que la cuenta esté inmersa dentro del criterio de “cartera propia” (acorde al criterio de la CNV) el valor a mostrar será “Propia”, en caso contrario será “Terceros” (de acuerdo a lo declarado por el Agente al Mercado).
- 14) Usuario

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

16) Tipo Ejecución: el valor que puede tomar es “A” en caso de que la orden haya sido asignada.

17) Mercado

*(\*) El campo puede tomar los siguientes valores:*

#### **Para la operatoria en ROFEX**

- Limit (LMT): son órdenes para comprar o vender a un precio específico (precio límite) que es indicado al momento del ingreso de la misma.
- Market to Limit (MTL): son órdenes para comprar o vender al mejor precio actual. Si toda la orden no se ejecuta inmediatamente al precio de mercado, el resto de la orden se verá en pantalla, como una orden con el tamaño restante a completar, con el precio en el cual se ejecutó anteriormente. Si se coloca una orden Bid y no hay contraparte para matchearla la misma se descarta quedando en estado “Rejected”.

#### **Para la operatoria en MerVal**

- Limit (LMT): al igual que ROFEX.
- Stop Limit MerVal (STX): estas órdenes no se emiten hasta que el último precio operado llega a un determinado disparador (precio límite). En ese momento el sistema introduce una orden tipo LMT al precio límite.
- Market (MKT): son órdenes para comprar o vender un contrato al mejor precio actual, cualquiera que sea ese precio. En un mercado activo, las órdenes de mercado siempre se llenan, pero no necesariamente al precio exacto que el trader pretende. Si se coloca una orden Bid y no hay contraparte para matchearla ésta se descarta quedando en estado "Rejected"

*(\*\*) El campo puede tomar los siguientes valores:*

#### **Para la operatoria en ROFEX:**

- DAY: esta orden es válida hasta el final del día. Si la orden no se llenó antes del cierre de la rueda, la misma expira automáticamente.
- IOC: en este tipo de órdenes si cualquier parte de la misma que no se llena de inmediato se cancela. Las órdenes IOC pueden llenarse parcialmente, mientras que una orden FOK debe llenarse completamente o la misma es descartada.
- FOK: esta orden debe ser ejecutada inmediatamente como una orden completa tan pronto como esté disponible en el mercado, de lo contrario la orden se cancela.



- GTD: este tipo de orden le permite seleccionar una fecha de expiración hasta la cual la orden continuará activa esperando ejecutarse. La orden se cancelará al finalizar el día ingresado como Fecha de Expiración.

#### **Para la operatoria en MerVal:**

- DAY: al igual que ROFEX.
- FOK: al igual que ROFEX.
- GTD: al igual que ROFEX.

#### **Aclaraciones – Libro de Órdenes:**

- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación vía *algo trading* o negociación algorítmica, no se registran en el Libro de Órdenes.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación a través de un Agente de Corretaje (ACVN), no se registran en el Libro de Órdenes.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para cuentas a confirmar, sólo se registran en el Libro de Órdenes 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 registran en el Libro de Órdenes.
- Las órdenes ingresadas en el sistema de negociación para cuentas a confirmar que hayan finalizado en una operación, luego transferida en give up, no se registrarán en el Libro de Órdenes ni del ALyC emisor ni del receptor.
- En el caso de modificaciones de cuenta solicitadas dentro de la rueda, no se reflejarán en el libro cuando la orden haya sido ingresada con una cuenta definitiva. En el caso que la orden haya sido ingresada con una cuenta a confirmar, dicha modificación se verá reflejada en el libro.
- Las modificaciones solicitadas fuera de rueda no se reflejarán en el Libro de Órdenes.
- Las órdenes ingresadas como GTD figuraran el día en que fueron ingresadas.

#### **6. ¿Qué información contiene el Libro de Operaciones publicado en AnywherePortfolio?**

- 1) Fecha Operación
- 2) Hora Operación
- 3) Operación Cartera Número

- 4) Cuenta registro Código
- 5) Tipo Operación (Compra/Venta)
- 6) Cantidad
- 7) Unidad de medida (Ejemplo: toneladas, U\$S).
- 8) Tipo Contrato (Puede ser Futuro, Put, Call, Título o Acción).
- 9) Contrato (Ejemplo: WTI052015; RO15022015; APBR).
- 10) Precio Ejercicio
- 11) Precio
- 12) Origen
- 13) CUIT/CUIL/CDI: muestra el CUIT, CUIL o CDI perteneciente a la cuenta que efectuó la operación.
- 14) Tipo Cartera: En caso de que la cuenta esté inmersa dentro del criterio de “cartera propia” (acorde al criterio de la CNV) el valor a mostrar será “Propio”, en caso contrario será “Terceros” (de acuerdo a lo declarado por el Agente al Mercado).
- 15) Contraparte: muestra el número de CUIT de la contraparte de la operación.
- 16) Fecha Liquidación: muestra la fecha de liquidación o de vencimiento del contrato al que la operación refiere, según corresponda.
- 17) Mercado
- 18) Valor Nocial: igual a precio por cantidad.

#### **Aclaraciones – Libro de Operaciones:**

- En el libro no figuran los derechos de mercado, las comisiones y aranceles, así como tampoco el número de boleto de cada operación. Es por ello que se proporciona el libro con cuatro columnas adicionales (vacías) para que sean completadas por el Agente.
- En las Cuentas a Confirmar, hasta tanto la operación no sea asignada a una cuenta comitente, en la columna “Tipo Cartera” del libro aparecerá por “default” la palabra “Terceros”.
- 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

**7. ¿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](mailto:atencionalcliente@rofex.com.ar).

ANEXO I

**FO 7.03.19 Registro de Órdenes 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 de almacenamiento digital (CD-R, CD-RW, DVD-R, DVD-RW, Blu-ray, Pen Drive, Tarjeta de memoria, Disco Rígido, o similares que cumplan la misma función)

Libros debidamente foliados y rubricados por la autoridad de registro correspondiente

Características de los sistemas:

En caso de que se hubiera optado por un medio de almacenamiento digital:

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 10 años.

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

1. Se descargarán diariamente los archivos desde AnywherePortofolio y serán adheridos al libro rubricado por la autoridad de registro correspondiente, con las formalidades establecidas por las normas internas.
2. Serán conservados por el plazo legal de 10 años.

Sin más, le saluda a Uds. atentamente

.....  
Firma y aclaración

ANEXO II

**REFERENCIAS NORMATIVAS:**

- i) Texto ordenado 2013 Normas de la Comisión Nacional de Valores, Título VII; Capítulo I (AN), Artículos 30 y 35; y Capítulo II (ALYC) – Artículos 36 y 41 ;
- ii) ROFEX: artículo 3.6.5, 3.6.6 y 3.6.7, Capítulo VI, Título III, del Reglamento Interno; Aviso vigente sobre Registro de órdenes y operaciones.