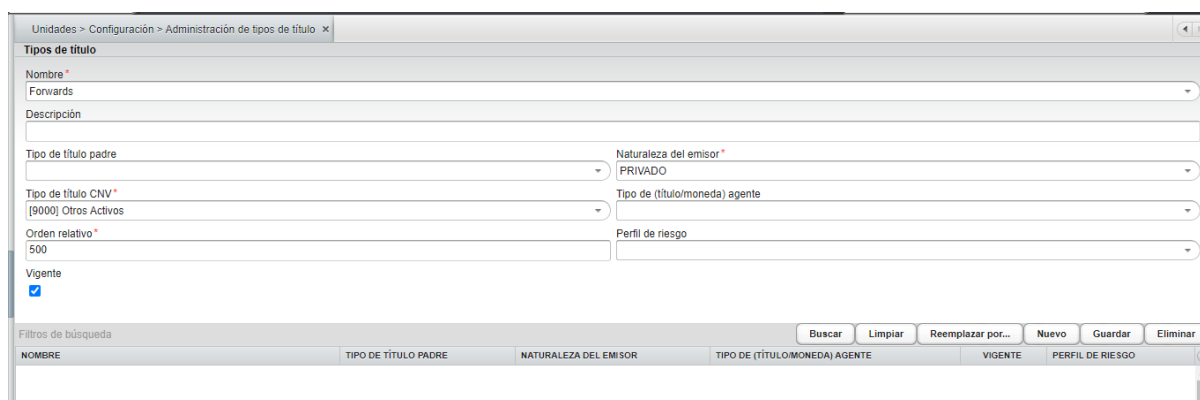


Rueda OTC MtR Agro

En el presente instructivo se detalla todo lo relacionado a la operatoria de forwards y opciones OTC MtR Agro en el **sistema Hígyrus**.

Parametrización paso a paso

Revisar que esté creado el tipo de título “Forwards” en la pantalla “Unidades > Configuración > Administración de tipos de título”. En caso de no estar dado de alta, se lo puede crear automáticamente desde la pantalla “Gestión bursátil > Sistema > Actualizar datos” ejecutando la función “Crear tipos de título”, o bien de forma manual desde la misma pantalla “Unidades > Configuración > Administración de tipos de título”:



Modificar parámetro general “cuentas.usos_subcuenta_ac”, agregando en valor el uso ACCUS-OTC y REG-OTC. Ejemplo:



Crear Mercado “OTCMTR”. Puede crearse de forma rápida desde “Gestión bursátil > Sistema > Actualizar datos” ejecutando la función “Importar mercados”, o bien siguiendo estos pasos:

Desde la pantalla “Dominios > Bursátil > Administración de mercados”, crear un nuevo registro:

- Código: OTCMTR.
- Código local: OTCMTR.
- Nombre: OTC MtR.
- Ubicación: Argentina.

Mercados		
Código *	Código local *	Nombre *
OTCMTR	OTCMTR	OTC MIR
Ubicación *	Email para informe CNV624	
Argentina		
Descripción		

Luego, crear la cuenta desde la pantalla “Cuentas > Cuentas > Administración de cuentas”:

- ID: OTCMTR.
- Tipo de cuenta: Mercado.
- Denominación: OTC MtR.
- Estado: Alta.

[OTCMTR] OTC MIR

Todo

- Datos principales
- Legajo (1)
- Disposiciones generales (0)
- Administrador (0)
- Aranceles de negociación (0)
- Aranceles generales (0)
- Persona relacionada (0)
- Uso de firma (0)
- Medio de comunicación (0)
- Domicilio urbano (0)
- Domicilio simple (0)
- Domicilio rural (0)
- Cuenta bancaria (0)
- Subcuenta (0)
- Subcuenta alterna (0)
- Subcuenta en Caja de Valores (0)
- Subcuenta en Caja de Valores (externa) (0)
- Subcuenta en Argentina Clearing (0)

Datos principales

ID * OTCMTR Tipo de cuenta * Mercado Cartera Categoría Clase de cuenta

Denominación * OTC MIR Alias

Titular Estado * Alta

Notas

Datos importados durante migración, por favor complete el titular

Legajo de cuenta

Fecha de alta * 17/07/2023 14:20:13 Fecha de actualización 17/07/2023 14:20:13 Fecha de baja Cartera propia (CNV 2013 - Tít. VI Cap. V Art.6)

Responsable Aprobado por

Crear desde la pantalla “Cuentas > Cuentas > Administración de cuentas” las cuentas de tipo “Mercado” que serán la contraparte de los movimientos de OTC registrados para un cliente, es decir, las cuentas “Registración OTC” de ACSA.

Debe contener los siguientes datos:

- Tipo: Mercado.
- ID y Denominación: Se sugiere completar con un código y nombre que haga referencia a que se trata de una cuenta de “Registración OTC” específica.
- Titular: Matba-Rofex S.A.
- Subcuenta: Uso GRAL. **¡IMPORTANTE! Marcar tilde “Usar esquema de conciliación”.**
- Subcuenta en Argentina Clearing: Uso REG-OTC. En los campos “Número” y “CCL” colocar el número de la cuenta de “Registración OTC”.

Nuevo

Todo

Datos principales

Legajo (1)

Disposiciones generales (0)

Administrador (0)

Aranceles de negociación (0)

Aranceles generales (0)

Persona relacionada (0)

Uso de firma (0)

Medio de comunicación (0)

Domicilio urbano (0)

Domicilio simple (0)

Domicilio rural (0)

Cuenta bancaria (0)

Subcuenta (1)

Subcuenta alterna (0)

Subcuenta en Caja de Valores (0)

Subcuenta en Caja de Valores (externa) (0)

Datos principales

ID *

OTCMTR-X

Tipo de cuenta *

Mercado

Cartera

Categoría

Clase de cuenta

Denominación *

Registración OTC - Cuenta MTR X

Alias

Titular

Estado *

Alta

Notas

Legajo de cuenta

Fecha de alta *

17/07/2023 14:22:55

Fecha de actualización

17/07/2023 14:22:55

Fecha de baja

Cartera propia (CNV 2013 - Tít. VI Cap. V Art.6)

Responsable

Aprobado por

Nuevo

Todo

Datos principales

Legajo (1)

Disposiciones generales (0)

Administrador (0)

Aranceles de negociación (0)

Aranceles generales (0)

Persona relacionada (0)

Uso de firma (0)

Medio de comunicación (0)

Domicilio urbano (0)

Domicilio simple (0)

Domicilio rural (0)

Cuenta bancaria (0)

Subcuenta (1)

Subcuenta alterna (0)

Subcuenta en Caja de Valores (0)

Subcuenta en Caja de Valores (externa) (0)

Subcuenta en Argentina Clearing (1)

Subcuenta en MAE (0)

Subcuenta en MATba (0)

Legajo de cuenta

Fecha de alta *

17/07/2023 14:22:55

Fecha de actualización

17/07/2023 14:22:55

Fecha de baja

Cartera propia (CNV 2013 - Tít. VI Cap. V Art.6)

Responsable

Aprobado por

Subcuenta

Uso *

GRAL

Uso esquema de conciliación

Eliminar

Descripción

Subcuentas en Argentina Clearing

Uso *

REG-OTC

Número *

1111

Cuenta CCL *

1111

Cuenta principal

DMA (RIMA)

Eliminar

Descripción

Nota: Según definiciones de Argentina Clearing, existe una cuenta de “Registración OTC” por cada comitente que opere en el segmento OTC.

Crear las siguientes cuentas contables para cada cuenta de “Registración OTC” en la pantalla “Contabilidad > Configuración > Administración de cuentas”. El “Código” y “Padre” dependerá de lo estipulado por el agente en su plan de cuentas:

- GRAL
- GRAL.C
- GRAL.I
- GRAL.E

Contabilidad > Configuración > Administración de cuentas

Cuentas contables

Código: 101030200025 Nombre: REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL Padre: [Redacted]

Código de exportación: Contable: ☒ Obsoleta: ☐ Saldo normal: ☐ DEUDOR

Monetaria: ☐ Cuenta de ajuste: ☐

Descripción:

Nombre: REGISTRA Filtros de búsqueda

CÓDIGO	NIVEL	NOMBRE	CONTABLE	OBSOLETA	MONETARIA	CUENTA DE AJUSTE	SALDO NORMAL	CÓDIGO DE EXPORTACIÓN	PADRE
101030200025	4	REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL	Si	No	No	No	DEUDOR		[Redacted]
602020000010	3	REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL C	Si	No	No	No	DEUDOR		[Redacted]
602020000011	3	REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL I	Si	No	No	No	DEUDOR		[Redacted]

Vincular desde la pantalla “Operaciones > Configuración > Parámetros contabilidad” las cuentas de “Registración OTC” de tipo “Mercado” con sus respectivas cuentas contables. De este modo el sistema podrá registrar los movimientos en las cuentas contables correspondientes:

Operaciones > Configuración > Parámetros contabilidad

Parámetros contables

Parte: Mercado Concepto: * Uso: GRAL Cuenta: [OTCMTR-X] Registración OTC - Cuenta MIR X

Uso diferido: ☐ Documentación: ☐ Tipo arancel: Cuenta contable: [101030200025] REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL

Cuenta: OTCMTR-X Filtros de búsqueda

PARTE	CONCEPTO	CUENTA	USO	USO DIFERIDO	DOCUMENTACIÓN	TIPO ARANCEL	CUENTA CONTABLE
Mercado	*	[OTCMTR-X] R GRAL	GRAL	No	No		[101030200025] REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL
Mercado	*	[OTCMTR-X] R GRAL C	GRAL C	No	No		[602020000010] REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL C
Mercado	*	[OTCMTR-X] R GRAL I	GRAL I	No	No		[602020000011] REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL I
Mercado	*	[OTCMTR-X] R GRAL E	GRAL E	No	No		[602020000012] REGISTRACION OTC - Cuenta X GRAL E

Revisar que esté correctamente creado en la pantalla “Dominios > Comercial > Administración de lugares” el lugar “OTCMTR”. En caso contrario, crearlo o editarlo con los siguientes datos:

Lugares

Código: OTCMTR Nombre: OTC Mtr

Tipo: OTRO Contraparte principal: [OTCMTR] OTC Mtr

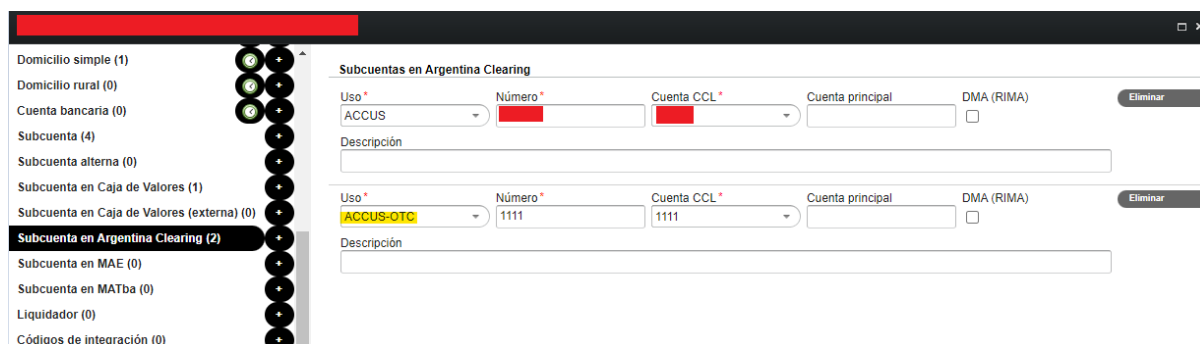
País: [ARG] Argentina

Contrapartes secundarias:

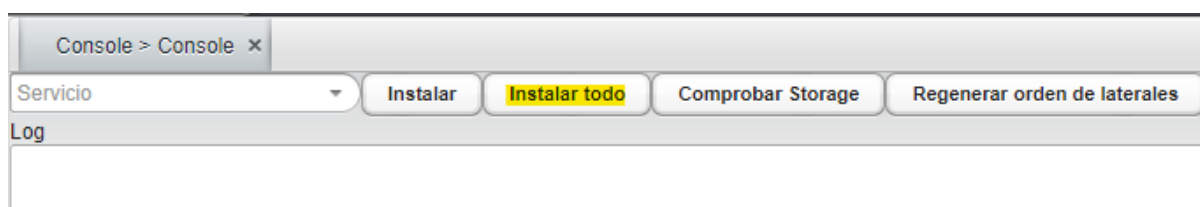
[OTCMTR- [Redacted] Registración OTC - Cuenta Mtr [Redacted] x [OTCMTR- [Redacted] Registración OTC - Cuenta Mtr [Redacted] x

¡IMPORTANTE! en el campo “Contrapartes secundarias” se deben colocar todas las cuentas de “Registración OTC” creadas previamente que intervendrán en la rueda OTC.

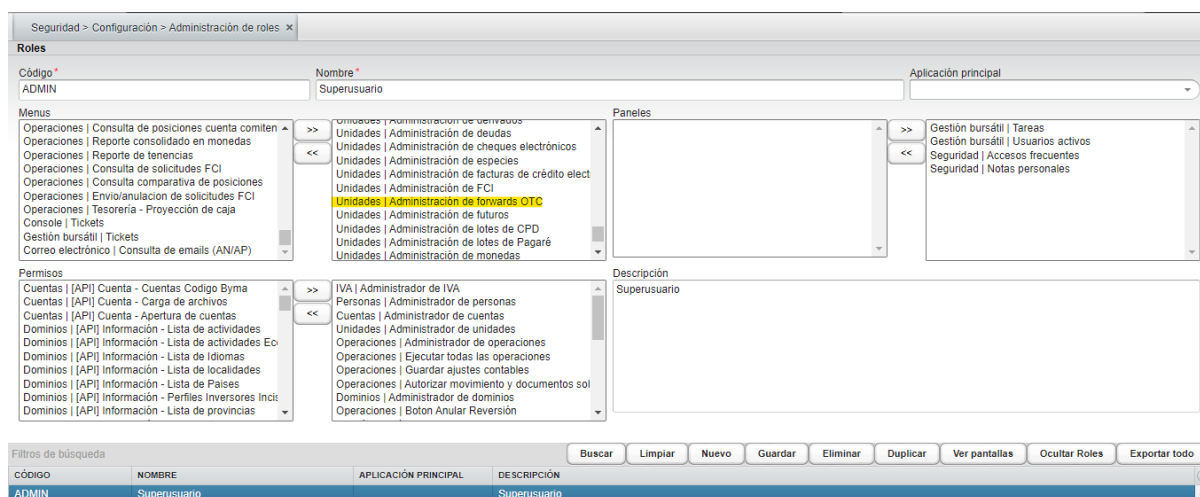
Crear una “Subcuenta en Argentina Clearing” con uso ACCUS-OTC en las cuentas comitentes que registrarán operaciones en la rueda OTC. El “Número” corresponderá a su código de identificación en ACSA, y el campo “Cuenta CCL” es la cuenta de “Registración OTC” que actúa como contraparte de las operaciones (creada en los pasos anteriores):



Ingresar a la pantalla “Console > Console” y hacer clic en “Instalar todo”. Esto instalará las funcionalidades y menús necesarios para terminar la configuración de la rueda OTC MtR:



Asignar desde la pantalla “Seguridad > Configuración > Administración de roles” el “Menú” o pantalla “Unidades | Administración de forwards OTC” al rol correspondiente al alta de instrumentos. Esta pantalla permitirá a los usuarios que asuman un determinado rol crear o editar los Forwards OTC. En el siguiente paso se mostrará cómo crear tanto los Forwards como las Opciones OTC:



Nota: es necesario cerrar sesión en el sistema y volver a ingresar para que los cambios se apliquen.

Crear las especies que se operarán en la rueda OTC. Para ello utilizar las pantallas:

- Para crear Forwards OTC: Unidades > Configuración > Administración de forwards OTC
- Para crear Opciones OTC: Unidades > Configuración > Administración de derivados

Ejemplo de creación de Forward OTC:

Nuevo

Todo

Datos principales

Código adicional

Atributo

Guardar

Añadir código Borsar

Datos principales

Código *
OTC - SOJ.ROS/MAY23

Moneda de liquidación *
USD

Vencimiento *
22/05/2023

Lote *
1,00

Expresión *
1

Unidad de medida
tt

Vigente
☒

Suspendida
☐

Código interno

Descripción

Observaciones

Ejemplo de creación de Opción OTC (para crear la opción, previamente se debe cargar el Forward ya que se indica en el campo "Subyacente"):

[OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C]

Todo

Datos principales

Código adicional (0)

Atributo (0)

Guardar

Añadir código Borsar

Datos principales

Código *
OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C

Clase *
CALL

Moneda de cotización
USD

Subyacente *
[OTC - SOJ.ROS/MAY23]

Código interno

Vigente
☒

Vencimiento *
21/04/2023

Lote *
1,00

Precio de ejercicio *
412,00

Suspendida
☐

Descripción

Observaciones

Por último, crear los aranceles correspondientes a las operaciones por Forwards y Opciones OTC desde la pantalla "Gestión bursátil > Configuración > Aranceles de negociación base". Por ejemplo:

Arancel bursátil

Agente

Operatoria *
OTCMTR / Rueda OTC / NDF OTC

Cuenta o grupo

Clase

Título o emisor

Parte

Situación

Condición

Concepto *
Arancel

Descripción

Tipo de arancel *
Porcentaje

Modo de cobro *
Importe en moneda o

Detraer recuperos
☐

IVA % *
21

Arancel *
1,00

Mínimo *
0

Tope

Arancel bursátil

Agente

Operatoria *
OTCMTR / Rueda OTC / Opciones OTC

Cuenta o grupo

Clase

Título o emisor

Parte

Situación

Condición

Concepto *
Arancel

Descripción

Tipo de arancel *
Porcentaje

Modo de cobro *
Todo en moneda orig

Detraer recuperos
☐

IVA % *
21

Arancel *
1,00

Mínimo *
0

Tope

Registro de rueda OTC

Se deben importar las operaciones de compra/venta concertadas desde la pantalla "Gestión bursátil > Negociación > Negociación de órdenes".

Las órdenes se importan desde el botón "Importar > ROFX - APIBO - [ROFX1111]" (donde el número 1111 cambiará según el Agente).

La única observación en este paso se da al momento de la importación, donde el Agente puede optar por importar o no las órdenes del mercado "OTCMTR" mediante el uso de la casilla correspondiente:

ROFX-APIBO - [ROFX11] MATBA ROFEX S.A. - CCL (Operaciones de Terceros)

17/07/2023 ☒ ROFEX ☒ MERVAL ☒ MAE ☒ MATBA ☒ OTCMTR ☒ FCI ☒ Importar transitorias

Presione "Importar" para seleccionar el archivo a procesar.

Las órdenes importadas lucen de esta manera, y se liquidarán como es habitual:
Forwards OTC:

Nº	MERCADO	SEGMENTO	SESIÓN	INSTRUMENTO	CONDICIÓN	OPERADOR	PARTES	LIQUID./C/PTE.	CUENTA	CANTIDAD	PRECIO	FECHA	ID
1	[OTCMTR] O1	Rueda OTC	NDF OTC	[OTC - MAI.ROS/JUL23]	USDL	[admin] Admin	Compra	[OTCMTR] [REDACTED] Rej	[REDACTED]	100,00 / 100,00	225,00	14.41.34 (1/3)	23330593
				[OTC - MAI.ROS/JUL23]				[ACSA] Argentina Clear		100,00	225,00	14.41.34 (1/3)	23330593
2	[OTCMTR] O1	Rueda OTC	NDF OTC	[OTC - SOJ.ROS/MAY23]	USDL	[admin] Admin	Venta	[OTCMTR] [REDACTED] Rej	[REDACTED]	100,00 / 100,00	389,00	14.26.42 (1/3)	23329821
				[OTC - SOJ.ROS/MAY23]				[ACSA] Argentina Clear		100,00	389,00	14.26.42 (1/3)	23329821

Opciones OTC:

Nº	MERCADO	SEGMENTO	SESIÓN	INSTRUMENTO	CONDICIÓN	OPERADOR	PARTES	LIQUID./C/PTE.	CUENTA	CANTIDAD	PRECIO	FECHA	ID
1	[OTCMTR] O1	Rueda OTC	Opciones OTC	[OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C]	USDL	[admin] Admin	Venta	[OTCMTR] [REDACTED] Rej	[REDACTED]	100,00 / 100,00	4,50	17.16.14 (2/3)	23343168
				[OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C]				[ACSA] Argentina Clear		100,00	4,50	17.16.14 (2/3)	23343168
2	[OTCMTR] O1	Rueda OTC	Opciones OTC	[OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C]	USDL	[admin] Admin	Compra	[OTCMTR] [REDACTED] Rej	[REDACTED]	100,00 / 100,00	4,50	17.16.14 (2/3)	23343169
				[OTC - SOJ.ROS/MAY23 412 C]				[ACSA] Argentina Clear		100,00	4,50	17.16.14 (2/3)	23343169

Las caídas por vencimiento se importarán también como órdenes.

Por otro lado, al igual que se marca en la rutina Matba-Rofex, deben correrse a diario las siguientes operaciones desde "Operaciones > Operaciones > Ejecución de operaciones":

- [Masiva] Liquidación de cancelaciones ROFEX v/ACSA 1.0: Este proceso registrará las cancelaciones ocurridas en el mundo OTC MtR. En el campo "Lugar" dejar el valor "ROFX", al momento de importar las cancelaciones de este mercado se importarán también las cancelaciones de la rueda OTC:

[Masiva] Liquidación de cancelaciones ROFEX v/ACSA 1.0

Liquidación de cancelaciones ROFEX

Desde* 17/07/2023 Hasta* 17/07/2023 Lugar* [ROFX] MATBA ROFEX S.A.

- [Cuenta] Registrar movimientos de ACSA 1.0: Con este proceso se importarán y registrarán en el sistema los movimientos contables provenientes desde ApiBO. En el caso del mundo OTC, las minutas correspondientes a los mismos son:
 - 92: Primas OTC
 - 93: Resultado Futuros OTC
 - 94: Resultado Opciones OTC

Finalmente, realizar los siguientes controles al finalizar cada día en que se hayan registrado operaciones o movimientos en la rueda OTC MtR:

- Pantalla "Operaciones > Controles > Control de posiciones ACSA": sirve para corroborar que las posiciones en NDF OTC y Opciones OTC registradas en **Hígyrus** sean iguales a las de Matba-Rofex.
- Pantalla "Operaciones > Consultas > Consolidados diarios": empleando el filtro "Extracto" con valor "GRAL.C". Al igual que en Matba-Rofex, el recuento en valor cero nos hará entender que se registraron correctamente todas las operaciones.