



Recomendaciones

Registro OTC MtR

Agosto 2024

MatbaRofex



Argentina Clearing

Índice

1. RESUMEN	3
2. CLIENTES OTC MtR	3
3. OPERACIONES OTC MtR	5
4. IMPUESTOS SOBRE OPERACIONES OTC MTR	13
5. INTEGRACIONES PARA OPERACIONES OTC MTR	14
6. MiPortafolio	16

Matba Rofex S.A. - Mercado registrado ante CNV - Matrícula N° 13

Rosario: Paraguay 777 Piso 15, S2000CVO, Argentina | Tel.: +54 341 530 2900

CABA: Maipú 1300 Piso 2, C1006ACT, Argentina | Tel.: +54 11 4311 4716

www.matbarofex.com.ar

1. RESUMEN

Las siguientes recomendaciones aplican íntegramente para cuando el ALyC registra en su sistema de Back Office las operaciones OTC MtR (operaciones, productos y clientes).

En el caso de no poder registrar las mismas en su sistema, recomendamos analizar cada caso en particular y abstenerse de avanzar con el proceso en caso de duda.

2. CLIENTES OTC MtR

2.1. ¿Quiénes pueden ser parte de una operación OTC MtR?

En una operación OTC MtR habrá siempre dos partes:

- Una que deberá haber registrado una operación de Futuro u Opción que dé origen a la operación OTC MtR. Esta parte deberá tener una cuenta de registro ante ACyRSA y cumplir todos los requisitos exigidos para operar futuros y opciones. El ALyC para cartera propia o un cliente del mismo puede cumplir este rol.
- Otra parte que será la contraparte de la operación OTC MtR, y deberá tener una cuenta de registro ante ACyRSA.

A los efectos de las siguientes recomendaciones, ambas partes serán denominadas genéricamente "clientes".

2.2. Siendo el ALyC Registrante OTC MtR, ¿debo dar de alta en el sistema de Back Office ambos clientes de la operatoria OTC MtR? De igual manera, ¿debo darlos de alta en ACyRSA?

Nuestra sugerencia es que deben darse de alta ambos clientes en el sistema de Back Office. A su vez, es necesario dar de alta las cuentas de registro de ambos clientes en Argentina Clearing por los medios habituales de alta de cuenta en la extranet. No podrá participar en una operación OTC MtR un cliente que no tenga su respectiva cuenta de registro en ACyRSA.

2.3. Si uno de mis clientes sólo registra operaciones OTC MtR, no realizando otro tipo de operaciones en el Mercado de Capitales (en éste u otros mercados), ¿es necesario firmar un convenio de apertura de cuenta comitente?, ¿se debe tener documentación respecto al legajo PLAFT?

Para aquellos clientes que registran exclusivamente operaciones OTC MtR, no es obligatorio tener un convenio apertura comitente ni tampoco tener un legajo PLAFT.

2.4. ¿Qué documentación mínima debería pedir para el alta ante ACyRSA una cuenta de registro de un cliente OTC MtR?

Para dar de alta ambos clientes por el ALyC, los mismos deben otorgar un mandato al estilo del [modelo propuesto](#) (para clientes) , o bien, para el caso de que una de las partes sea el ALyC registrante, su cliente puede firmar un mandato al estilo de este [modelo propuesto](#) (cartera propia). Dicho documento no deberá entregarse a ACyRSA, sino que deberá ser conservado por el ALyC.

2.5. ¿Deben los clientes OTC MtR firmar alguna documentación adicional entre ellos?

No es necesario. Sin embargo, las partes podrán acordar cláusulas particulares adicionales del negocio, respetando los principios de los TÉRMINOS Y CONDICIONES PARA LA REGISTRACIÓN DE OPERACIONES OTC MTR. Dichas cláusulas podrán ser agregadas en el mandato o en documentación separada.

2.6. ¿Cómo demuestro que el cliente directo y/o indirecto me solicitó registrar operaciones OTC MtR?, ¿de qué manera le informo al cliente las operaciones OTC MtR registradas?

El mandato firmado entre las partes, más la documentación adicional definida por el ALyC (en caso de existir), son los documentos que demuestran la relación con el ALyC registrante.

El ALyC puede informar al cliente mediante el acceso a su extranet y/o envío de las operaciones registradas al mail declarado por las partes, solicitando confirmación de las mismas.

Adicionalmente, ACyRSA enviará a los emails declarados para las partes de la operación OTC, un detalle de la operación registrada.

RECOMENDACIÓN: el ALyC Registrante debe extremar los recaudos para que las direcciones de email efectivamente utilizadas, coincidan con las declaradas ante ACyRSA en la apertura de cuenta de registro y en el mandato firmado entre las partes.

2.7. ¿Qué información puede llegar a solicitarme la auditoría de Matba Rofex?

En instancias de la auditoría anual, se podrá validar a través de un muestreo de operaciones OTC la copia del acuerdo bilateral (mandato) entre los clientes donde solicitan registrar operaciones OTC en el Mercado a través del ALyC Registrante OTC (allí también se detallan los derechos y obligaciones de las partes más las cláusulas adicionales acordadas entre las partes, en caso de corresponder).

3. OPERACIONES OTC MtR

3.1. ¿Dónde veo la relación que existe entre la operación de futuro original y la operación de OTC? ¿Se puede consumir por API esta relación?


Esta información aún no se encuentra disponible. Está planificado incorporar un nuevo método en API BO.

3.2. ¿Cómo debe el ALyC registrar una operación OTC ante Argentina Clearing?

El ALyC debe registrar las operaciones OTC en AP5 ingresando al Módulo Operaciones - Registro OTC MtR a partir de operaciones de futuros y opciones negociadas en Matba Rofex y de acuerdo con la Guía de Producto - Registro OTC MTR.

3.3. ¿Qué comprobante genera ACyRSA de la registraci3n OTC?

El comprobante se visualiza en el men3 de Registro OTC Mtr.



Argentina Clearing

Argentina Clearing y Registro S.A. - Paraguay 777 Piso 15 - 2000, Rosario
CUIT: 30-71647295-3 I.V.A. Responsable Inscripto, Ing. Brutos Exento.

MatbaRofex

Operaciones OTC

3828
06/08/2024 17:41:48

XXXXXXXX S.A.
Identificaci3n de la cuenta: CUIT 1234567890 - AAAAAAAAAA COOP.

Instrucci3n para las cuentas:

Cuenta C3digo	Cuenta Descripci3n	Fecha Concerciaci3n
249671	OTC-BBBBBBBBBB COOP. LTDA	06/08/2024

Informamos a uds. que se a recibido una solicitud de registro de las siguientes operaciones realizadas en forma bilateral:


Boleta FyO	Lado OTC Cuenta	Contrato	Cuenta Contraparte c3digo	Cuenta Contraparte CUIT	Cuenta Contraparte Descripci3n	Precio Otc	Cantidad	Lado OTC Cuenta Contraparte	Fecha Vencimiento	Obs
28394564	Compra	OTC - SOJ.ROS/MAY25	249294	99876543210	CCCCCCCC COOP. LTDA	282,60	1	Venta	23/05/2025	

Se deja constancia que la/s instrucci3n/es referidas en el cuadro precedente son recibidas por Argentina Clearing y Registro S.A. (ACyRSA), en el marco del Aviso N3 2, el Instructivo de Registro OTC Mtr, los T3rminos y Condiciones para la Registraci3n de Operaciones OTC MR Agro y Monedas y dem3s Normas Internas de ACyRSA, documentos que el Participante declara haber leído y aceptado.

A su vez, cuando se cancelan las Operaciones OTC o se registra una prima de Opciones OTC, se generan comprobantes de resultados a nivel de cliente que pueden descargarse desde AP5 - Comprobantes - Liquidaciones.

Se recuerda que la informaci3n correspondiente a los resultados y primas puede tambi3n descargarse por API (MayorContable MT940) .

Modelo del mismo:

 Argentina Clearing Argentina Clearing y Registro S.A Paraguay 777 Piso 15 2000 - Rosario Tel.: +54 (341) 5302900 - Fax: +54 (341) 5302976 www.argentinaclearing.com.ar Responsable Inscripto		X Código N°	Liquidación N° 0000-00001352 Fecha: 05/08/2024 Cuit: 30-71647295-3 Inicio de Actividades: 01/08/2019		
COOPERATIVA XXXX CUIT: 1234567890 IVA: Inscripto Forma de Pago: Cuenta Corriente					
Fecha de Liquidación: 05/08/2024					
Fecha	Comitente	Detalle	Cantidad	Precio	Importe en Dó M
5/8/2024	193060	Primas OTC 2024/08/05	1,00	1,00	1.000,00
Los valores positivos son debitados y los negativos acreditados en la Cuenta de Registración OTC			SubTotal:		1.000,00
			I.V.A.		0,00
			Total:		1.000,00

3.4. ¿Debe el ALyC Registrante hacer un boleto por las operaciones OTC registradas en ACyRSA/MtR?, ¿qué formalidades debería tener dicho boleto?

Se sugiere generar boletos para estas operaciones. En caso de hacerlo deberá agregarse el siguiente disclaimer a las mismas:

“Aviso 2 ACyRSA: cualquiera de las partes de un contrato podrá solicitar la expedición de una constancia en el que se detalle que, en cumplimiento de lo previsto en el artículo 10 bis de la Sección V del Capítulo V del Título VI de las Normas de la CNV (TO 2013), y a los fines dispuestos en los artículos 2° y 35 inc. f) de la Ley N° 26.831 y modificatorias y en el artículo 189 inc. c) de la Ley N° 27.440, el contrato ha sido registrado ante esta entidad, la que será prueba suficiente de la registración del contrato a los efectos previstos en el inc. c) del artículo 189 de la Ley N° 27.440.”

“La actuación de Argentina Clearing y Registro S.A. se limita exclusivamente al ofrecimiento del servicio de Registro y Valuación.”

3.5. ¿Dicho boleto debe impactar en el “Libro de Operaciones” donde se lleva toda la operatoria del Agente?

Sí. Se sugiere impactar las operaciones en el Libro de Operaciones:

Libro de Operaciones - Fecha de Consulta:27/04/2023											
Página 1 de 1 (4 elementos)										Tamaño de página: 50	
Introduzca el texto a buscar...										Buscar	
Origen	Hora	Boleta	Lado	Cantidad	Tipo	Instrumento	Precio	Contraparte de Liquidación	Valor Efectivo	Derechos	
OTC	14:26:42	23329820	Compra	100,0000000000	NDF OTC	OTC - SOJ.ROS/MAY23	389,0000000000		38900,0000	0.972500	
OTC	14:26:42	23329821	Venta	100,0000000000	NDF OTC	OTC - SOJ.ROS/MAY23	389,0000000000		38900,0000	0.972500	
OTC	14:41:34	23330592	Venta	100,0000000000	NDF OTC	OTC - MAI.ROS/JUL23	225,0000000000		22500,0000	0.562500	
OTC	14:41:34	23330593	Compra	100,0000000000	NDF OTC	OTC - MAI.ROS/JUL23	225,0000000000		22500,0000	0.562500	

3.6. ¿Qué movimientos contables sobre las operaciones OTC debería realizar el ALyC Registrante?

Respecto a las cuentas contables para registro de OTC, en ACyRSA existen tres y todas serán registradas por cada cuenta de registro de clientes (no están agrupadas por el concepto de propia o tercero):

- **Cuenta Resultado OTC:** los débitos significan ganancias y los créditos pérdidas. Su contrapartida es la “Cuenta Registración OTC”, y es también por cada uno de los clientes. Representa la acumulación de los resultados OTC históricos.
- **Cuenta Prima OTC:** su contrapartida es la “Cuenta Registración OTC” o “Cuenta Resultado OTC”. Las primas OTC debitadas o acreditadas en la cuenta **Registración OTC** tienen como contrapartida dicha cuenta (partida doble), y es también por cada uno de los clientes. Representa el valor de las primas compradas y vendidas de operaciones OTC no canceladas aún a la fecha de consulta saldo.
- **Cuenta Registración OTC:** se registran los débitos o créditos inversos a los resultados y primas de cada uno de los clientes. Representa una cuenta “acumulativa” cuyo saldo será el inverso de la suma de “Resultado OTC” + “Prima OTC”. Podría en el sistema de Back Office dársele un tratamiento contable similar a una cuenta corriente comitente.

Ejemplo: **caso nueva operación opción OTC.**

Se contabiliza la prima de la opción OTC en la subcuenta administrativa **Registración OTC** y **Primas OTC** (Ej.1):

Ejemplo 1			
Agente A- Cliente 1 - Compra 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 a prima 2 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Registración OTC cliente 1	Concertación opción OTC	200 u\$s	
Primas OTC cliente 1	Concertación opción OTC		200 u\$s
Agente A - Cliente 2 - Vende 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 a prima 2 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Registración OTC cliente 2	Concertación opción OTC		200 u\$s
Primas OTC cliente 2	Concertación opción OTC	200 u\$s	

Ejemplo: caso Caída al vencimiento.

Partiendo del resultado de la cancelación del proceso anterior, el resultado se contabiliza en las subcuentas administrativas “**Registración OTC**”, “**Resultado OTC**” (Ej.2)

Ejemplo 2			
Agente A - Cliente 1 - Compra 100 tons NDF OTC Soja Mayo 23 320 u\$s, precio ajuste del futuro 330 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC cliente 1	Cancelación por vto OTC	1.000 u\$s	
Registración OTC cliente 1	Cancelación por vto OTC		1.000 u\$s
Agente A - Cliente 2 - Vende 100 tons NDF OTC Soja Mayo 23 320 u\$s, precio ajuste del futuro 330 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC cliente 2	Cancelación por vto OTC		1.000 u\$s
Registración OTC cliente 2	Cancelación por vto OTC	1.000 u\$s	

Opciones OTC (por caída)

Partiendo de la cancelación de la opción OTC, se contabiliza el resultado que es igual al monto de la prima OTC, en las subcuentas administrativas “**Primas OTC**” (crédito de la prima, si corresponde a una venta o al débito de la prima, si corresponde a una compra), y “**Resultado OTC**”. (Ej. 3).

Ejemplo 3			
Agente A - Cliente 1 - Compra 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 a prima 2 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC Cliente 1	Cancelación de Primas OTC		200 u\$s
Primas OTC Cliente 1	Cancelación de Primas OTC	200 u\$s	
Agente A - Cliente 2 - Vende 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 a prima 2 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC Cliente 2	Cancelación de Primas OTC	200 u\$s	
Primas OTC Cliente 2	Cancelación de Primas OTC		200 u\$s

Partiendo de la cancelación del NDF OTC que se generó producto del ejercicio de la opción, contabilizar el resultado en las subcuentas administrativas “**Registración OTC**” y “**Resultado OTC**”. (Ej. 4).

En caso de ser ejercible:

Ejemplo 4			
Agente A - Cliente 1 - Compra 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 320 u\$s a prima 2 u\$s , precio ajuste del futuro 330 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC Cliente 1	Cancelación Ejercicio OTC	1.000 u\$s	
Registración OTC Cliente 1	Cancelación Ejercicio OTC		1.000 u\$s
Agente A - Cliente 2 - Vende 100 tons Opción OTC Soja Mayo 23 320 u\$s a prima 2 u\$s , precio ajuste del futuro 330 u\$s			
Cuenta Contable	Descripción	Debe	Haber
Resultado OTC Cliente 2	Cancelación Ejercicio OTC		1.000 u\$s
Registración OTC Cliente 2	Cancelación Ejercicio OTC	1.000 u\$s	

3.7. ¿Cómo trato los derechos de registro generados por ACyRSA?

ACyRSA genera un devengamiento diario de los derechos de registro generados por MtR.

Comisiones y Bonificaciones - Fecha de Consulta: 14/04/2023										
Página 1 de 1 (8 elementos)										Tamaño de
Introduzca el texto a buscar...										Buscar
Fecha	Entidad	Código Cuenta	Producto	Detalle	Cantidad	Importe	Moneda	Cotizacion	Total	Cuenta
01/03/2023	ACYRSA	111111	SOJ OTC	Derechos de Clearing SOJ OTC OTC - TC: 197.560	1,000000	0,972500	Dólar Ref. CA3500	197,560000	192,127100	COOPERATIVA ABC
01/03/2023	ACYRSA	111111	SOJ OTC	Derechos de Clearing SOJ OTC OTC - TC: 197.560	1,000000	0,972500	Dólar Ref. CA3500	197,560000	192,127100	COOPERATIVA ABC
01/03/2023	ACYRSA	111111	MAI OTC	Derechos de Clearing MAI OTC OTC - TC: 197.560	1,000000	0,562500	Dólar Ref. CA3500	197,560000	111,127500	COOPERATIVA ABC
01/03/2023	ACYRSA	111111	MAI OTC	Derechos de Clearing MAI OTC OTC - TC: 197.560	1,000000	0,562500	Dólar Ref. CA3500	197,560000	111,127500	COOPERATIVA ABC

La facturación de los mismos se realiza a fin de mes en conjunto con el resto de los derechos de registro que cobra MtR por operatoria de futuros y opciones al participante. La facturación será hecha por Matba Rofex.

Dichos derechos, se informan a través de AP5 → “Comprobantes \ Comisiones y Bonificaciones”.

Para más información, remitirse a la [Guía de Producto Registro OTC MtR](#).

3.8. ¿Puedo cancelar anticipadamente una operación OTC?, ¿de qué forma lo hago?. ¿A qué precio debería cancelarse?. ¿Tiene relación con algún precio, por ejemplo, ajuste del día anterior, precios del día?

Si, se puede cancelar anticipadamente una operación OTC. Para ello, se debe realizar la instrucción a través de AP5 → “Instrucciones \ Operaciones \ Canceladas Manuales \ OTC”.

Para cancelar anticipadamente una operación de OTC, **debe tener una operación de futuro registrada dentro de los 2 días hábiles y proceder a registrar una operación inversa OTC**. De esta manera se pueden realizar las cancelaciones de las operaciones OTC (sigue la regla de ingresan 2 operaciones -compra y venta- y se cancelan las mismas 2 operaciones -compra y venta-). Así la operación OTC se cancelará al precio realizado de la operación inversa.

Por otro lado, el contrato de futuro se cancelará con la regla de cancelación que tenga la cuenta de registro de forma habitual.

3.9. ¿En el caso de que cancele al vencimiento por caída, requiere también tener un contrato de futuro para que se concrete la cancelación anticipada?

No. Para la cancelación al vencimiento no es necesario tener en el porfolio o registrada dentro de los 2 días, una operación de futuro u opción. En este caso, la operación OTC se cancelará automáticamente.

Para realizar la cancelación, se realizará una operación interna inversa de OTC, al precio de referencia del día (precio de ajuste del futuro) y esta operación se cancela contra el OTC al precio original.

Ejemplo: si el NDF se hizo sobre un futuro a 352 y el futuro el día de la caída tuvo como precio de ajuste 355, entonces el resultado de la caída sería de +3 u\$s para el comprador de la operación OTC y -3 u\$s para el vendedor de la operación OTC.

3.10. Si en una misma cuenta registra operaciones de Futuros y Opciones y de OTC, ¿qué opciones tengo para la cancelación?

Las operaciones OTC están configuradas para ser canceladas manualmente en forma anticipada o automáticamente al vencimiento. Por su parte los futuros dependerán de la configuración del método de cancelación que tenga la cuenta de registro (cancelación manual más no cancela, manual más cancela o cancelación automática).

Si se quiere en una misma cuenta tener sincronizadas las carteras de futuros y opciones con la cartera OTC, sugerimos tener una cuenta donde se registren los futuros, parametrizada con el método de cancelación manual.

3.11. Si quiero ir a la entrega con una operación OTC de productos agropecuarios, ¿qué debo hacer?

Las operaciones OTC de productos Agropecuarios no pueden ir al proceso de entrega física. Sin embargo, existe un procedimiento para poder cancelar la operación OTC y simultáneamente abrir un Futuro que sí podrá entrar en el procedimiento de entrega física.

Eso se realiza desde AP5 - Operaciones - OTC MtR - IRCF OTR MTR Agro

Esta acción implica el pedido de registración de futuros asociados a las operaciones OTC que se quieren pasar desde ese ámbito al de mercado de capitales. Una vez generados los futuros, el ALyC puede presentar la oferta de entrega sobre los mismos. Que el comitente que registra un OTC, genere futuros, implica que el mismo debe estar habilitado según los requerimientos de apertura de cuenta comitente para Mercado de Capitales.

MatbaRofex
Argentina Clearing

Solicitud de Registro de Operaciones IRCF (OTC MtR Agro)

ORIGEN: OTC MTR Agro
DESTINO: FUTUROS

Razón Social Agente

Seleccione la Posición OTC

Seleccione
▼

Posición OTC

Precio Referencia Futuro asociado

Contrato 1

Nro. Cuenta Registro Comprador	Nro. Boleta Comprador	Nro. Cuenta Registro Vendedor	Nro. Boleta Vendedor	Tonelaje	Precio Original
<small>Código cta de Registro</small>		<small>Código cta de Registro</small>			

Contrato 2

Nro. Cuenta Registro Comprador	Nro. Boleta Comprador	Nro. Cuenta Registro Vendedor	Nro. Boleta Vendedor	Tonelaje	Precio Original
<small>Código cta de Registro</small>		<small>Código cta de Registro</small>			

Con esta información, Argentina Clearing disponibilizará las operaciones para poder presentar las correspondientes ofertas de entrega.

Una vez disponibilizadas las operaciones OTC de productos agropecuarios, el Agente/Participante OTC deberá realizar la instrucción de cancelación manual de las operaciones OTC de productos agropecuarios, o aguardar hasta su vencimiento para que las mismas sean canceladas.

4. IMPUESTOS SOBRE OPERACIONES OTC MTR

4.1. ¿En nombre de quién sale la retención de ganancias?

A los efectos de determinar el monto imponible para la retención de ganancias de cada cliente, los resultados generados por las operaciones OTC registradas se agregan a los resultados de Futuros y Opciones. Dicha retención se genera en nombre del cliente.

4.2. ¿De dónde se debita la retención de ganancias?

Se debita de la cuenta de Compensación y Liquidación del ALyC.

4.3. En caso de que la operación de Futuro se cancele antes que la operación OTC o viceversa, ¿cómo funcionaría la retención?

El monto imponible de las retenciones es la suma de los resultados acumulados durante el mes en las cuentas contables de resultados de futuros y resultados por las cancelaciones de las operaciones OTC. Por ende, si se realizó una cancelación anticipada de una operación OTC, la misma se verá reflejada en la cuenta contable de resultados OTC.

4.4. En un escenario donde no haya relación con el cliente en cuanto a movimientos de fondos, ni tenga una cuenta corriente abierta, ¿cómo trasladará el Agente/Participante OTC MtR ese costo si la retención se realiza en nombre del cliente?

El ALyC podría debitar ese monto deduciéndolo del cliente directo que registre operaciones OTC en su cuenta corriente (que a su vez opera futuros y opciones con el ALyC y tiene una cuenta comitente abierta en mercado de capitales con el mismo), para que éste último liquide con el cliente final el monto correspondiente a la retención. El comprobante de retención de ganancias realizado por Argentina Clearing al cliente final podrá ser descargada desde AP5 - Comprobantes - Retenciones

Para más información, remitirse a la [Guía de Producto - Registro OTC MtR](#).

5. INTEGRACIONES PARA OPERACIONES OTC MTR

5.1. ¿Cómo debo parametrizar en mi sistema de Back Office este nuevo producto OTC?

De acuerdo con el relevamiento que hemos hecho de diferentes proveedores de sistemas de Back Office, las alternativas serían las siguientes (dependiendo del sistema de BO y las decisión del Agente):

1. Parametrizarse como un “tipo de rueda/segmento” nuevo debajo de MERCADO MTR.

Algunos sistemas de BO tienen la posibilidad de parametrizar diferentes mercados (por ejemplo Matba Rofex, ByMA, MAE y MAV). Posteriormente, debajo de cada Mercado se

Matba Rofex S.A. - Mercado registrado ante CNV - Matrícula N° 13

Rosario: Paraguay 777 Piso 15, S2000CVO, Argentina | Tel.: +54 341 530 2900

CABA: Maipú 1300 Piso 2, C1006ACT, Argentina | Tel.: +54 11 4311 4716

www.matbarofex.com.ar

parametrizan diferentes “ruedas/segmentos”. En este caso, se podría parametrizar una nueva “rueda/segmento” denominada “**Rueda OTC Mtr**”.

2. Parametrizarse como un “nuevo mercado”

En este caso, se podría parametrizar como un “nuevo mercado” denominado “**OTC Mtr**”.

5.2. ¿Cómo se identifican las operaciones de OTC en las APIs de ACyRSA (API BO)? ¿Hay métodos nuevos?

No hay métodos nuevos para estas operaciones. Se informan “valores” diferentes en algunos parámetros, pero dentro de los mismos métodos.

ACyRSA a través de API BO brinda la siguiente información:

- **Lista de instrumentos (SecurityList)**

https://api.anywhereportfolio.com.ar/help/index#!/PreTrade/GetSecurityList_Get

Tipo (SecurityType) :

para Forwards: **NDF OTC**

para Opciones: **Opciones OTC**

Mercado (SecurityExchange): **OTC**

CFI Code:

para NDF OCT: **FCXXNN**

para Opción OTC: **OCAFXN** para Call y **OPAFXN** para put

- **Operaciones (TradeCaptureReport)**

https://api.anywhereportfolio.com.ar/help/index#!/PosTrade/TradeCaptureReport_Get

Mercado (SecurityExchange): **OTC**

Rueda (MarketSegmentID): **Rueda OTC**

Ejecución : (TrdType)

- **Alta OTC:** aplica a nuevas operaciones NDF OTC y Opciones OTC registradas (**código api: 540**).
- **Ejercicio de Opción:** aplica a nuevas operaciones NDF OTC registradas producto de un ejercicio automático de opción OTC dentro del dinero (**código api: 45**).
- **Cancelación:** cuando se cancela un NDF anticipadamente (**código api: 54**).
- **Caída por vencimiento NDF:** aplica a nuevas operaciones inversas de NDF registradas a partir de caída de las mismas al vencimiento (**código api: 29**).
- **Caída por vencimiento opción:** aplica a nuevas operaciones inversas de Opciones OTC registradas a partir de caída de las mismas al vencimiento, estén o no ejercibles (**código api: 29**).

- **Reporte de Posiciones (PositionReport)**

https://api.anywhereportfolio.com.ar/help/index#!/PosTrade/GetReportePortfolio_Get

Tipo (SecurityType):

para el Forward: **NDF OTC**

Matba Rofex S.A. - Mercado registrado ante CNV - Matrícula N° 13

Rosario: Paraguay 777 Piso 15, S2000CVO, Argentina | Tel.: +54 341 530 2900

CABA: Maipú 1300 Piso 2, C1006ACT, Argentina | Tel.: +54 11 4311 4716

www.matbarofex.com.ar

para opciones: **Opciones OTC**
 Mercado (SecurityExchange): **OTC**

- **Mayor Contable (MT940)**
https://api.anywhereportfolio.com.ar/help/index#!/PosTrade/GetReporteMayorContable_Get
 Tipo de cuenta (AccountTypeID)
 - **Registración OTC (código api: 50)**
 - **Resultado OTC (código api: 53)**
 - **Primas OTC (código api: 52)**
 Tipo de Concepto ("TransactionType") (código api: 92)
- **Tarifas Devengadas (AccruedFees)**
https://api.anywhereportfolio.com.ar/help/index#!/PosTrade/GetReporteTarifaDevengada_Get
 Ejecución (execType): **OTC**
 Tipo de Rueda (tradingSession): **Rueda OTC**

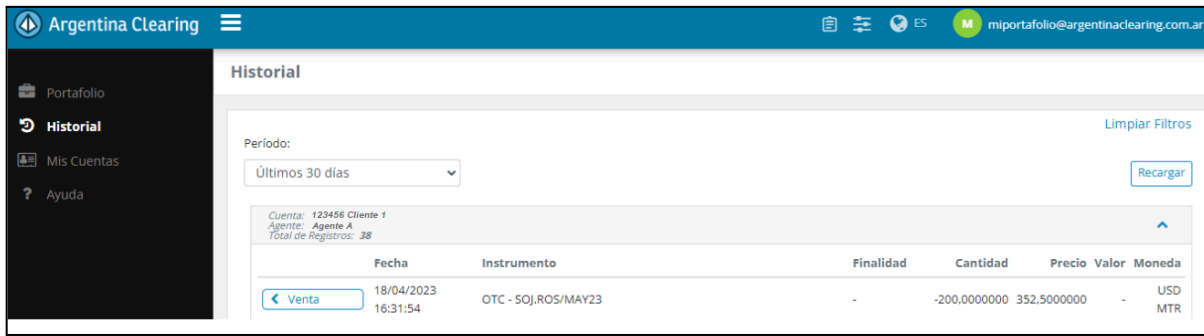
6. MiPortafolio

6.1. ¿Qué información muestra MiPortafolio sobre OTC Mtr a los clientes?

La información de las operaciones OTC registradas por los clientes pueden ser visualizadas por ellos a través de la App [MiPortafolio](#).

CLIENTE 1
 CUIT: 1234567890

Mis Inversiones: 68.381.331.1800000 ARS					
Instrumento	Cantidad	Precio	Valor	Moneda	
▼ Dólar MTR Cuenta: 123456 - Cliente 1 Agente: Agente A Finalidad: Márgenes	314.238,0000000	217,6100000	68.381.331,1800000	ARS	
Saldo:			68.381.331,1800000	ARS	
Diferencias:					
Instrumento	Cantidad	Precio	Precio Ajuste	Diferencia	Moneda
▼ OTC - SOJ.ROS/MAY23 Cuenta: 123456 - Cliente 1 Agente: Agente A	-100,0000000	352,5000000	360,5000000		USD MTR
▼ SOJ.ROS/JUL23 Cuenta: 123456 - Cliente 1 Agente: Agente A	1.500,0000000	393,6666660	379,4000000		USD MTR



Argentina Clearing miportafolio@argentinaclearing.com.ar

Historial Limpiar Filtros

Periodo: Últimos 30 días Recargar

Cuenta: 123456 Cliente 1
 Agente: Agente A
 Total de Registros: 38

Fecha	Instrumento	Finalidad	Cantidad	Precio	Valor	Moneda
18/04/2023 16:31:54	OTC - SOJ.ROS/MAY23	-	-200,000,000	352,500,000	-	USD MTR

Ventana