



PrimaryDMA

Guía de Usuario Broker

v1.6.0



Contenido

[Introducción](#)

[Beneficios](#)

[Controles](#)

[Control de riesgo pre-trade](#)

[Parametrización de cálculos](#)

[Validaciones](#)

[De Saldos](#)

[De Tenencia de Moneda](#)

[De Stock](#)

[Especificación de errores por el rechazo de una orden](#)

[Consideraciones del cálculo](#)

[Pantalla de inicio](#)

[Gestión del riesgo](#)

[Resumen de cuenta](#)

[Monitor de cuentas](#)

[Crédito](#)

[Reportes](#)

[Posición](#)

[Órdenes](#)

[Operaciones del día](#)

[Evaluación de stock](#)

[Opciones Cubiertas Merval](#)

[Exportación de Reportes](#)

[Gestión de datos](#)

[Importación](#)

[Datos importados](#)

[Administración de parámetros por cuenta](#)



[Administración de parámetros por defecto para cuentas](#)

[Nueva Pantalla de configuración de cuentas](#)

[Modificación múltiple](#)

[Información de mercado](#)

[Márgenes](#)

[Monedas](#)

[Ajustes](#)

[ANEXOS](#)

[Cálculos del precio de mercado](#)

[Anexo II: Formato de importación - Saldo líquido](#)

[Anexo III: Formato de importación - Posición](#)

[Anexo IV: Formato de importación - Otras garantías](#)

[Anexo V: Formato de importación - Crédito](#)

[Anexo VI: Exportación de datos desde BackOffice PRO](#)

[Anexo VII: Validaciones aplicables a las importaciones](#)

1. Introducción

Primary DMA permite a los agentes de los distintos mercados ofrecer a sus clientes la posibilidad de imputar sus propias órdenes de negociación de manera directa, incrementando así la rapidez y efectividad.

Beneficios

Proveer acceso directo al mercado implica, entre otras cosas, que el bróker se encuentre expuesto a riesgos de crédito. Por ello, PMY DMA dispone de controles de órdenes pre-trade, tratándose de controles de riesgo puestos en funcionamiento para evitar la ejecución de una operación por un cliente más allá de los límites de negociación autorizados y de sus tenencias. Una vez que el cliente alcanzó estos límites, sólo estarán permitidas las operaciones que reduzcan el riesgo.

El objetivo de la plataforma es incorporar estos controles de riesgo pre-trade a nivel bróker para prevenir situaciones donde el cliente, el bróker y/o el mercado puedan ser afectados adversamente por negligencia o intencionalidad de quien acceda directamente al mercado.

Cabe agregar que los bróker se benefician enormemente con la estandarización de los controles de administración del riesgo. Cuanto mayor sea la estandarización de los controles de riesgo, mayor será la eficiencia y efectividad con la que los mismos controlen y administren los riesgos asociados con los clientes de acceso directo.

A su vez, como herramienta para la mitigación de riesgos en caso de falla en el sistema de DMA, el bróker cuenta con su propia plataforma de negociación, mediante la cual tendrá acceso en tiempo real a la información sobre órdenes pendientes y ejecutadas, pudiendo ingresar/cancelar órdenes que pasarán o no por los controles de riesgo dependiendo de la plataforma utilizada.

Controles

Los controles de crédito/capital realizados por PMY DMA están relacionados a los controles de posición dado que los mismos son aplicados para evaluar la potencial obligación de liquidación en la que un cliente pueda incurrir al ejecutarse la orden. Los umbrales en los controles de crédito son específicos a un cliente dado. Los controles de administración de riesgo financiero y los procesos de supervisión deben incluir aquellos razonablemente diseñados para prevenir el ingreso de órdenes que excedan los umbrales predefinidos de crédito y capital.

Para el caso de futuros, los controles son realizados en un proceso de cálculo de márgenes incrementales teniendo en cuenta las posiciones de diferentes vencimientos para los contratos del mismo producto.

2. Control de riesgo pre-trade

El sistema ha sido diseñado para manejar una cartera mixta en una única cuenta. Por lo tanto se hará un cálculo automático de la capacidad de pago de instrumentos que implican egreso de fondos y la cobertura de garantías cuando el cliente opere instrumentos que impliquen colateral.

2.1 Parametrización de cálculos

Los controles de riesgo se realizan conforme las parametrizaciones definidas por el Administrador de la herramienta.

Actualmente, los conceptos a calcular por cada tipo de instrumento son los siguientes:

Instrumento	Portfoli o	Movimient o	Diferencias	Márgenes	Stock	Tenencia Moneda
<i>Futuro</i>			Sí	Sí		
<i>Acción</i>	Sí	Sí			Sí	
<i>Título</i>	Sí	Sí			Sí	Sí/No*
<i>Cedear</i>	Sí	Sí			Sí	
<i>Opciones Call futuros</i>		Sí	Sí	Sí		
<i>Opciones Put futuros</i>		Sí	Sí	Sí		
<i>Opciones Call títulos valores</i>	Sí	Sí			Sí	
<i>Opciones Put títulos valores</i>	Sí	Sí			Sí	

* dependiendo si el bono requiere tenencia de moneda para poder operarlo, este parámetro se calculará o no.

2.2 Validaciones

2.2.1 De Saldos

Cada vez que se pretenda ingresar una orden, el módulo de riesgo simulará los saldos del Resumen de Cuenta resultantes de incluir dicha orden y lo hará conforme los parámetros de cálculo definidos para el instrumento. La plataforma dará curso a la orden si existe saldo suficiente en el Disponible para Operar y en el Reporte de Garantías, de lo contrario se entiende que la cuenta no goza con la capacidad requerida para afrontar el negocio y la orden será rechazada.

2.2.2 De Tenencia de Moneda

Si el instrumento que se desea operar requiere cálculo de Tenencia de Moneda, además de la validación de saldos, se controlará que por cada orden de compra a ingresar se posea la moneda requerida.

2.2.3 De Stock

Si el instrumento que se desea operar requiere cálculo de Stock, además de la validación de saldos, se controlará que por cada orden de venta a ingresar se posea el stock requerido.

2.2.4 Especificación de errores por el rechazo de una orden

Cada vez que una orden sea rechazada, DMA detallará los motivos para poder ser expuestos en las plataformas de negociación que utilicen los clientes. Los posibles mensajes son:

1. Saldo insuficiente.
2. Stock insuficiente. Cantidad disponible para venta de {Instrumento} - {Plazo} = XX
3. Instrumento {Instrumento} - {Plazo} sin márgenes definidos.
4. No se encontró parametrización de cálculo para el instrumento {Instrumento} - {Plazo}
5. No existe el instrumento {Instrumento} - {Plazo}.

2.3 Consideraciones del cálculo

Diferencias

Se toma el precio ajuste para la posición inicial y el precio de la operación para las operaciones ejecutadas durante la rueda, luego se compara con el precio de mercado . Las órdenes pendientes no son tomadas en cuenta.

Movimientos

Se utiliza precio de la operación para las operaciones ejecutadas durante la rueda y para las órdenes pendientes.

Portfolio

Considera precio de mercado para posición inicial, operaciones ejecutadas durante la rueda y órdenes pendientes.

Márgenes

Se utiliza un método incremental teniendo en cuenta las posiciones de diferentes vencimientos para contratos del mismo producto (Por ej: Dólar Marzo, Abril, Mayo, etc)

El cálculo de márgenes que realiza el motor de riesgo pre-trade de PMY DMA para cada cuenta es el siguiente:

Margen Cuenta

Total de márgenes de las distintas órdenes
+
Total de márgenes de los distintos productos
+
Total de cargo spread de los distintos productos

Dónde:

Margen orden:

Cantidad orden * Margen Instrumento del cual se ingresó la orden

Margen producto:

Valor Absoluto (Cantidad Compras (1) – Cantidad Ventas (2)) * Margen Promedio Ponderado de la cartera

Cargo Spread Producto:

Mínimo (Cantidad Compras (2), Cantidad Ventas (2)) * %Spread * Margen Promedio Ponderado de la cartera

(1) Cantidad Compras = Cantidad de Instrumentos Comprados del mismo Producto * Tamaño del Instrumento * Delta

(2) Cantidad Ventas= Cantidad de Instrumentos Vendidos del mismo Producto * Tamaño del Instrumento * Delta

Para consultar los distintos parámetros utilizados para realizar los cálculos nos debemos dirigir a Información de Mercado > Márgenes

Stock

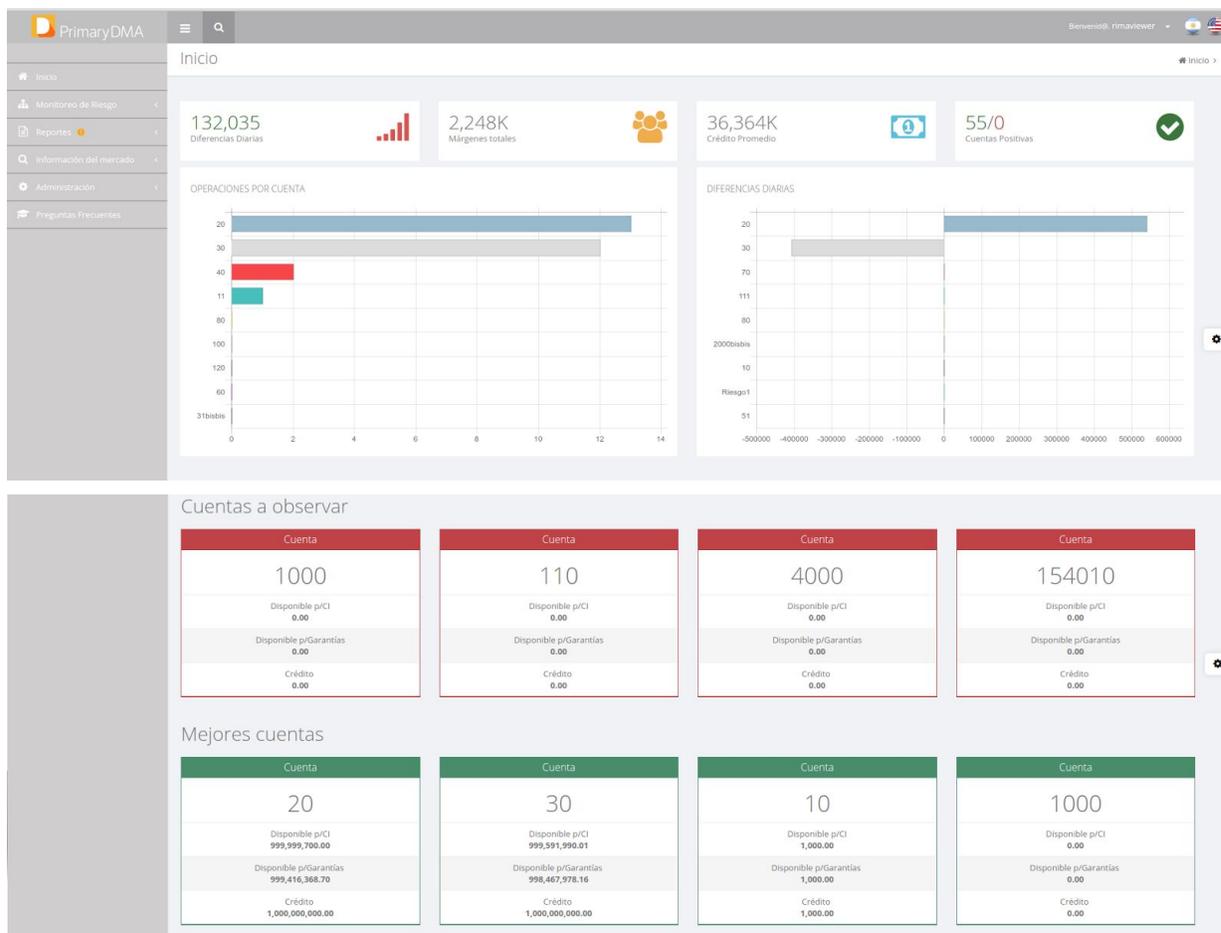
Se calcula tomando posición inicial, operaciones ejecutadas durante la rueda y órdenes de venta pendientes.

Tenencia de Moneda

Se calcula tomando la tenencia inicial, operaciones ejecutadas sobre la rueda y órdenes de compra pendientes.

3. Pantalla de inicio

Al ingresar a la aplicación el Bróker podrá acceder a la pantalla de inicio que se muestra a continuación:



En la parte superior izquierda de la pantalla podemos observar las siguientes opciones de menú: Monitoreo del Riesgo, a través del cual podemos acceder al Resumen de Cuenta, al Monitor de Cuentas y al Crédito; Reportes, a través del cual podemos acceder al Reporte de Posiciones, Reporte de Operaciones del Día y al Reporte de Evaluación de Stock; Gestión de Datos, a través del cual podemos acceder a las pantallas de Importación y de Datos Importados; Información de Mercado, donde podremos observar los Márgenes, Monedas y Ajustes; y por último, la opción de Preguntas Frecuentes donde podemos observar distintas preguntas útiles para el usuario.

Podemos observar el botón de menú  a través del cual podemos comprimir las opciones de menú y de esa forma tener mayor visibilidad de la pantalla y también el botón de búsqueda rápida

 mediante el cual accedemos rápidamente al resumen de cuenta de alguna cuenta deseada.

En la parte superior de la pantalla podemos observar:

- Diferencias diarias: neto de diferencias diarias para todas las cuentas del Bróker.
- Márgenes Totales: suma de todos los márgenes requeridos de todas las cuentas del Bróker.
- Crédito Promedio: crédito promedio otorgado por el Bróker a sus comitentes.
- Cuentas Positivas: muestra la cantidad de cuentas positivas y negativas del Bróker.
- En el centro de la pantalla podremos observar dos gráficos, mostrando las diez cuentas que más operaron en el día y las diez que más diferencias diarias tienen.
- Al final de la pantalla podremos observar las cuatro peores y cuatro mejores cuentas desde el punto de vista del saldo disponible para operar. Además haciendo clic sobre cada cuenta podemos acceder al “Resumen de Cuenta” de la misma.
- Por último, en el margen superior derecho, a través del botón  el sistema cuenta con la posibilidad de cambiar al idioma inglés.

4. Gestión del riesgo

4.1 Resumen de cuenta

Mediante esta pantalla, el Bróker puede monitorear el estado de cuenta de un cliente específico. Accedemos a través de [Monitoreo del Riesgo > Resumen de Cuenta](#)

El Resumen de Cuenta consta de dos secciones, Reporte de Cuenta y Reporte de Garantías, donde se divide la información del cliente en un estado sobre valores líquidos y otro específico para el análisis de garantías. A su vez, el Reporte de Cuenta se expone en distintos plazos. Haciendo clic sobre el plazo deseado (CI, 24hs, 48hs, 72hs) se calcularán las grillas al plazo seleccionado.

Resumen de Cuenta 9997
Fecha de Última Actualización 18/01/2017 11:49:58

Resumen de Cuenta

CI

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

24hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

48hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

72hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

Tenencia de monedas

Reporte de Cuenta CI

	Valor de la cuenta	Disponible p/Operar
Saldo Líquido	0.00	0.00
Crédito +	1,000,000.00	1,000,000.00
Movimientos	0.00	0.00
Portfolio	0.00	0.00
Diferencias Diarias	0.00	0.00
	1,000,000.00	1,000,000.00

Reporte de Garantías

	Disponible p/Garantías
Valor de la cuenta 0 Hs.	1,000,000.00
Otras garantías	0.00
No disponible para garantías	-
Márgenes	0.00
	1,000,000.00

Ir a...

Actualizar ↻



4.1.1 Resumen de cuenta

El Reporte de Cuenta mide la capacidad financiera del cliente para afrontar pagos líquidos derivados de las operaciones. El análisis se realiza para todos los plazos de negociación disponible.

Saldo Líquido:

Valor corriente de los fondos líquidos de las distintas monedas multiplicadas por la cotización correspondiente, teniendo en cuenta el plazo indicado.

Crédito:

Financiación otorgada por el Bróker para operar durante la rueda. Ver sección Crédito.

Diferencias:

Ganancias y pérdidas diarias no realizadas de las posiciones abiertas de futuros.

Movimientos:

Total de flujos de efectivo producidos por las operaciones ejecutadas durante la rueda y órdenes pendientes hasta el plazo indicado más los egresos netos de plazos posteriores, sin incluir comisiones y tasas.

Portfolio:

Valuación de cada activo en cartera (primas, acciones, bonos y otros productos que se negocien en la plataforma y no estén afectados como colateral) al plazo indicado más las compras netas concertadas para plazos posteriores.

Valor de la Cuenta:

Sumatoria de los conceptos anteriores al plazo indicado.

Disponible para Operar:

Valor utilizable como efectivo para el cumplimiento de la liquidación de operaciones. Surgirá de aplicar un factor específico a cada uno de los conceptos que componen el resumen de cuenta. Los factores definidos actualmente son los siguientes:

- Saldo Líquido 100%
- Crédito 100%
- Movimiento 100%
- Portfolio 0%
- Diferencias positivas 0%
- Diferencias negativas 100%

4.1.1.1 Agregado rápido de crédito

Además, desde esta pantalla se permite agregar/quitar crédito para la cuenta seleccionada (siempre en la moneda default del sistema ARS).

IMPORTANTE: El valor ingresado se suma o se resta(en caso de que sea negativo) del crédito actual.



4.1.2 Reporte de Garantías

El Reporte de Garantías evalúa la disponibilidad del cliente para cubrir garantías requeridas por las operaciones.

Valor de la cuenta:

Sumatoria del resumen de cuenta correspondiente al plazo contado inmediato, admitiendo la posibilidad de utilizar los distintos conceptos que integran el resumen de cuenta para cubrir márgenes.

Otras Garantías:

Valor de los activos depositados en garantía.

Márgenes:

Importe utilizado como garantía por las operaciones que requieren colateral y se encuentran abiertas.

Disponible para Garantías:

Total disponible para utilizar como colateral, considerando valor de la cuenta, garantías constituidas y márgenes aplicados.

4.1.3 Tenencia de Moneda

Dentro del Resumen de cuenta podemos observar una pestaña de Tenencia de Moneda, haciendo clic sobre dicha opción podemos observar la disponibilidad de las distintas monedas que posee la cuenta en los distintos plazos.

Es importante destacar que sólo aparecerán aquellas monedas sobre las cuales el comitente posee saldo, de lo contrario no se observará el registro.

Modelo 1: La cuenta tiene saldo en las siguientes monedas: ARS, U\$S, USD C y USD D.

20 Actualizar

Resumen de Cuenta 20 Fecha de Última Actualización 29/04/2016 12:20:15

Resumen de Cuenta Tenencia de monedas

Moneda	CI	24hs	48hs	72hs
ARS	1,000.00	0.00	0.00	0.00
U\$S	100.00	0.00	0.00	0.00
USD C	1,000.00	1,000.00	1,000.00	1,000.00
USD D	1,000.00	1,000.00	1,000.00	1,000.00

Modelo 2: La cuenta tiene saldo en las siguientes monedas: ARS, U\$S y USD D.

20 Actualizar

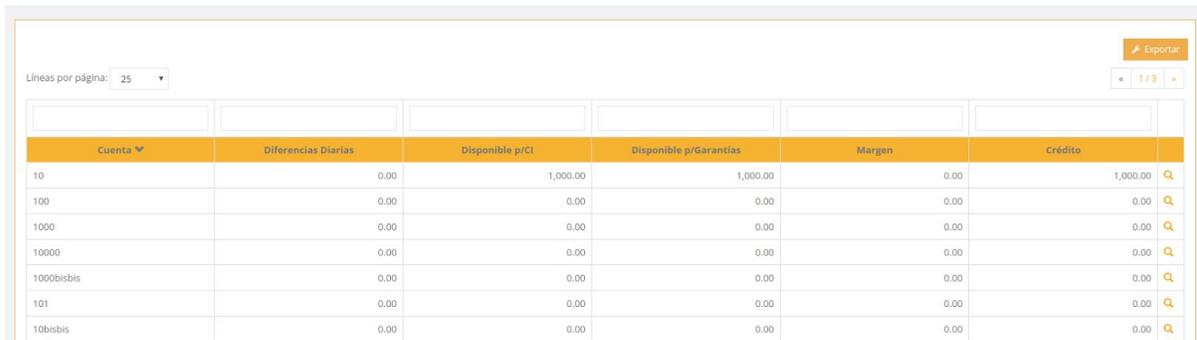
Resumen de Cuenta 20 Fecha de Última Actualización 29/04/2016 12:31:41

Resumen de Cuenta Tenencia de monedas

Moneda	CI	24hs	48hs	72hs
ARS	1,000.00	0.00	0.00	0.00
U\$S	100.00	0.00	0.00	0.00
USD D	1,000.00	1,000.00	1,000.00	1,000.00

4.2 Monitor de cuentas

En el Monitor de Cuentas se visualizan con facilidad y de manera actualizada (recálculo cada 5 segundos) los saldos de contado inmediato de todas las cuentas DMA asociadas al usuario y a su vez podemos observar las diferencias diarias que presenta la cuenta. A través del campo en blanco ubicado sobre el registro superior de las columnas, podemos buscar una cuenta en particular.



Cuenta	Diferencias Diarias	Disponible p/CI	Disponible p/Garantías	Margen	Crédito
10	0.00	1,000.00	1,000.00	0.00	1,000.00
100	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
10000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1000bisbis	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
101	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
10bisbis	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

A través del botón  “Ver Resumen” en el Monitor de Cuentas podemos acceder rápidamente al Resumen de Cuenta correspondiente, abriéndose por defecto el plazo CI.

Resumen de Cuenta 9997 Fecha de Última Actualización 18/01/2017 11:49:58

Resumen de Cuenta

CI

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

24hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

48hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

72hs

1,000,000.00

100.00%

Disponible p/Operar

1,000,000.00

Reporte de Cuenta CI

	Valor de la cuenta	Disponible p/Operar
Saldo Líquido	0.00	0.00
Crédito	1,000,000.00	1,000,000.00
Movimientos	0.00	0.00
Portfolio	0.00	0.00
Diferencias Diarias	0.00	0.00
Total	1,000,000.00	1,000,000.00

Reporte de Garantías

	Disponible p/Garantías
Valor de la cuenta 0 Hs.	1,000,000.00
Otras garantías	0.00
No disponible para garantías	-
Márgenes	0.00
Total	1,000,000.00

Ir a... Actualizar

4.2.1 Crédito

Podrá asignarse un crédito diario mediante el botón  "Editar Crédito" de la pantalla Monitor de Cuentas. Al hacer clic sobre la opción, se abrirá una pantalla como la que se muestra a continuación, donde ingresamos el valor deseado en el campo indicado para la/s moneda/s que se quiera ingresar crédito y, luego haciendo clic en Actualizar, confirmaremos la modificación. El crédito se verá automáticamente reflejado en los saldos de las cuentas. Haciendo clic en el símbolo + o – le estaremos modificando el crédito de a miles. Es importante destacar que también podremos ingresar Crédito al cliente a través de [Monitoreo de Riesgo > Crédito](#)

Es importante destacar que el crédito ingresado para cada moneda será multiplicado por la cotización que corresponda.

Monitor de Cuentas

[Inicio](#) > [Monitoreo de Riesgo](#) > [Monitor de Cuentas](#)

Editar Crédito: 20
↶ Volver

ARS ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 1.00
ARS BCRA ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 1.00
EUR ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 16.15
US\$ ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 15.00
USD C ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 14.50
USD D ⓘ	-	<input type="text" value="1000"/>	+	Cotización: 14.50
USD G ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 14.50
USD R ⓘ	-	<input type="text" value="0"/>	+	Cotización: 14.31
Total (en ARS)		<input type="text" value="14500"/>	Fecha de última cotización 29/04/2016 12:55:02	

Actualizar

5. Reportes

5.1 Posición

A través de la opción [Reporte > Posición](#) accedemos a la cartera de cada cuenta, expuesta de manera resumida y actualizada al momento de la consulta tal como se muestra a continuación (haciendo clic en la pestaña de “posición detalle” encontraremos la información con mayor nivel de datos)

Posición Resumen

20
Actualizar

Posición Detallada: 20
29/04/2016 14:53:51

Resumen
Posición Detallada

Instrumento	Posición Inicial	Posición Rueda	Posición Actual	PPP p/ Dif Diaria	Precio de Mercado	Diferencia Diaria \$	Valor de Mercado \$
Futuros							
DLR082016	1,000	0	1,000				
Acciones							
TS	-500	0	-500		1.3900		-695.00

Concepto	Descripción
Posición Inicial	Cantidad de contratos al inicio del día informados desde el Backoffice mediante importación de Posición.
Posición Rueda	Cantidad de contratos operados durante la rueda.
Posición Actual	Cantidad de contratos totales, sumando Posición Inicial y Posición Rueda.
PPP p/Dif	Precio Promedio Ponderado utilizado para el cálculo de diferencias. Para la posición inicial se considera el precio de ajuste del día anterior y para las operaciones del día el precio al cual se ejecutaron las mismas. La posición comprada y vendida poseen distintos PPP.
Precio de Mercado	Precio utilizado para calcular las diferencias diarias y valorar las tenencias de títulos.
Diferencia Diaria	Diferencia diaria calculada en moneda de liquidación del instrumento.
Valor de Mercado \$	Valuación expresada en pesos de los instrumentos que no calculan diferencias.

Posición Detallada

Concepto	Descripción
Posición Inicial	Cantidad de contratos al inicio del día informados desde el Backoffice mediante importación de Posición.
Posición Rueda	Cantidad de contratos operados durante la rueda.
Posición Actual	Cantidad de contratos totales, sumando Posición Inicial y Posición Rueda.
PPP p/Dif	Precio Promedio Ponderado utilizado para el cálculo de diferencias. Para la posición inicial se considera el precio de ajuste del día anterior y para las operaciones del día el precio al cual se ejecutaron las mismas. La posición comprada y vendida poseen distintos PPP.
Precio de Mercado	Precio utilizado para calcular las diferencias diarias y valorar las tenencias de títulos.
Diferencia Diaria	Diferencia diaria calculada en moneda de liquidación del instrumento.
Moneda	Moneda de liquidación del instrumento.
Cotización Moneda	Cotización utilizada para unificar los valores expresados en las distintas monedas.
Diferencia Diaria \$	Diferencia diaria expresada en pesos conforme Cotización Moneda.
Valor de Mercado \$	Valuación expresada en pesos de los instrumentos que no calculan diferencias.
Compra/Venta	Detalle de los instrumentos que calculan diferencias diarias segregando por posición comprada y vendida.
Cl/24hs/48hs/72hs	Detalle de los instrumentos negociados a distintos plazos que no calculan diferencias. La posición se segrega conforme los plazos de liquidación Cl, 24hs, 48hs. y 72hs.

Resumen

Posición Detallada

Instrumento	Posición Inicial	Posición Rueda	Posición Actual	PPP p/ Dif Diaria	Precio de Mercado	Diferencias Diarias	Moneda	Cotización Moneda	Diferencia Diaria \$	Valor de Mercado \$
Futuros										
DLR082016	1,000	0	1,000			1,715,000.00	ARS	1.00		
Compra	1000	0	1000	16.8900	18.6050	1,715,000.00	ARS	1.00	1,715,000.00	
Venta	0	0	0	0.0000	18.6050	0.00	ARS	1.00	0.00	
Acciones										
TS	-500	0	-500		1.3900		ARS	1.00		-695.00
72hs	-500	0	-500							
									1,715,000.00	-695.00

5.2 Órdenes

A través de la opción [Reportes > Órdenes](#) se tiene acceso a un reporte de ordenes para la cuenta seleccionada. Se pueden visualizar de dos maneras: en forma desagregada (cada una por separado) en la solapa “Detallado” y en forma resumida por instrumento en la solapa “Resumido”.

Detallado

Órdenes Inicio > Reportes > Órdenes

Cuenta Actualizar 

Órdenes de la cuenta 30

Detallado
Resumen
Exportar 

Hora ▲	Tipo de Instrumento	Instrumento	Plazo de liquidación	Lado	Precio	Cantidad
15:42:14	Futuro	DLR032017		Venta	17.3160	5.00
15:42:13	Futuro	DLR032017		Venta	17.8650	130.00
15:42:13	Futuro	DLR032017		Venta	19.8710	125.00
15:42:11	Futuro	DLR032017		Venta	12.0720	35.00
15:42:10	Futuro	DLR032017		Venta	19.7430	75.00

Resumido

Órdenes de la cuenta 30

Detallado
Resumen
Exportar 

Instrumento	Plazo de liquidación	Total de compra por instrumento	PPP de compra	Total de venta por instrumento	PPP de Venta
DLR032017		0.00	0.00	370.00	18.37

Ir a...

5.3 Operaciones del día

A través de la opción [Reportes > Operaciones del Día](#) tenemos la posibilidad de observar todas las operaciones realizadas (*) en el día para la cuenta seleccionada y actualizadas al momento de la consulta.

Actualizar

Operaciones: 100

Exportar

Hora	Tipo de Instrumento	Instrumento	Plazo de liquidación	Lado	Precio	Cantidad
15:45:21	Título	AA17D	72hs	Venta	15.6700	2.00
15:43:43	Título	AA17D	72hs	Compra	15.0000	1.00
15:36:17	Título	AA17	CI	Compra	15.0000	1.00

**Destacamos que son operaciones Ejecutadas y no órdenes en pantalla.*

Descripción de las columnas del reporte Operaciones del Día:

Concepto	Descripción
Hora	Precisa la hora en que se realizó la operación.
Tipo de Instrumento	Precisa cuál es el tipo de instrumento operado (Acción, Futuro, Título, etc.)
Instrumento	Muestra el símbolo del instrumento operado.
Plazo de Liquidación	Detalla el plazo en que se operaron los instrumentos.
Lado	Lado de la operación (Compra/Venta)
Precio	Muestra el precio en pesos al que se operaron los activo.
Cantidad	Muestra la cantidad de activos comprados/vendidos.

5.4 Evaluación de stock

A través de [Reportes > Evaluación de Stock](#) podemos observar el estado del stock de un producto para una cuenta en particular. Cuando hablamos de “estado de stock” estamos haciendo referencia a la posición inicial del comitente, más las órdenes de venta pendientes en pantalla, más las órdenes ejecutadas durante la rueda; en consecuencia el *Total* será el resultante de estos conceptos.

Se debe ingresar número de cuenta y sigla de la especie para realizar la búsqueda, de esta forma accedemos a un *Reporte de Evaluación de Stock* resumido como el que se muestra a continuación (haciendo clic en Detallado se muestra la información con mayor nivel de detalle)

Reporte de Evaluación de Stock

Inicio > Reportes > Reporte de Evaluación de Stock

05

AA17

Actualizar

Reporte de stock: 05 - AA17

Resumido

Detallado

Exportar

Instrumento	Plazo de liquidación	Stock
AA17	CI	44
AA17	24hs	430
AA17	48hs	0
AA17	72hs	-24
	Total	450

Descripción de las columnas del reporte de *Stock Resumen*:

Concepto	Descripción
Instrumento	Precisa el instrumento operado (comprado/vendido)
Plazo de Liquidación	Detalla el plazo en el que fue negociado el instrumento.
Stock	Refleja la cantidad operada.

Reporte Detallado:

Reporte de stock: 05 - AA17

Resumido Detallado

[Exportar](#)

Instrumento	Plazo de liquidación	Stock
AA17	Cl	44
AA17	Cl	44
AA17C	Cl	0
AA17D	Cl	0
AA17	24hs	430
AA17	24hs	430
AA17C	24hs	0
AA17D	24hs	0
AA17	48hs	0
AA17	48hs	0
AA17C	48hs	0
AA17D	48hs	0
AA17	72hs	-24
AA17	72hs	-24
AA17C	72hs	0
AA17D	72hs	0
	Total	450

Descripción de las columnas del reporte de *Stock Detallado*:

Concepto	Descripción
Instrumento	Precisa el instrumento operado (comprado/vendido)
Plazo de Liquidación	Detalla el plazo en el que fue negociado el instrumento.
Stock	Refleja la cantidad operada.

5.5 Opciones Cubiertas MERVAL

A través de [Reportes > Opciones Cubiertas Merval](#) podemos observar un reporte de opciones cubiertas Merval. El mismo detalla la cantidad de títulos que el sistema envía automáticamente a Argentina Clearing para que esta última informe a Merval la cobertura por el lanzamiento de opciones call sobre títulos valores.

Para realizar la consulta debemos ingresar el número de cuenta y el activo subyacente, tal como se muestra a continuación:

Reporte de Opciones Cubiertas Merval Inicio > Reportes > Reporte de Opciones Cubiertas Merval

05 GGAL Actualizar

Reporte de Opciones Cubiertas Merval: 05 - GGAL Exportar

Instrumento	Plazo de liquidación	Descubierto	Cubierto	Stock Total
GGAL	CI	0	0	100
GGAL	24hs	0	0	100
GGAL	48hs	0	0	0
GGAL	72hs	0	0	0
GFGC46.0AG		0	0	0
GFGC48.0AG	24hs	0	0	100
GFGC48.0OC	24hs	0	0	0
GFGC49885G	24hs	-100	-100	-200
GFGC54885G	24hs	0	0	0
Cantidad de títulos a enviar			-100	

Al pie de la tabla el sistema indicará la cantidad de títulos como consecuencia del lanzamiento de opciones.

Descripción de las columnas del reporte de *Reporte de Opciones Cubiertas Merval*:

Concepto	Descripción
Instrumento	Precisa el Instrumento en particular.
Plazo de Liquidación	Detalla el plazo en el que fue negociado el instrumento.
Descubierto	Es la cantidad que no tiene activos los respalden.
Cubierto	Es la cantidad que tiene activos para cobertura.
Stock Total	Muestra el Stock por contrato.

5.6 Exportación de Reportes

Es importante destacar que en todos los reportes citados encontramos un botón de exportación, a través del cual podemos exportar la información contenida en el reporte al formato deseado. Haciendo clic en el botón se despliegan las opciones de exportación, tal como se muestra a continuación:



Exportar

- Exportar a Excel
- Exportar a PDF
- Exportar a CSV

0

n

6. Gestión de datos

6.1 Importación

Toda la información administrada por el área de back-office del Bróker que hace posible el control de riesgo pre-trade de la sección 2, se ingresa mediante la pantalla Importación.

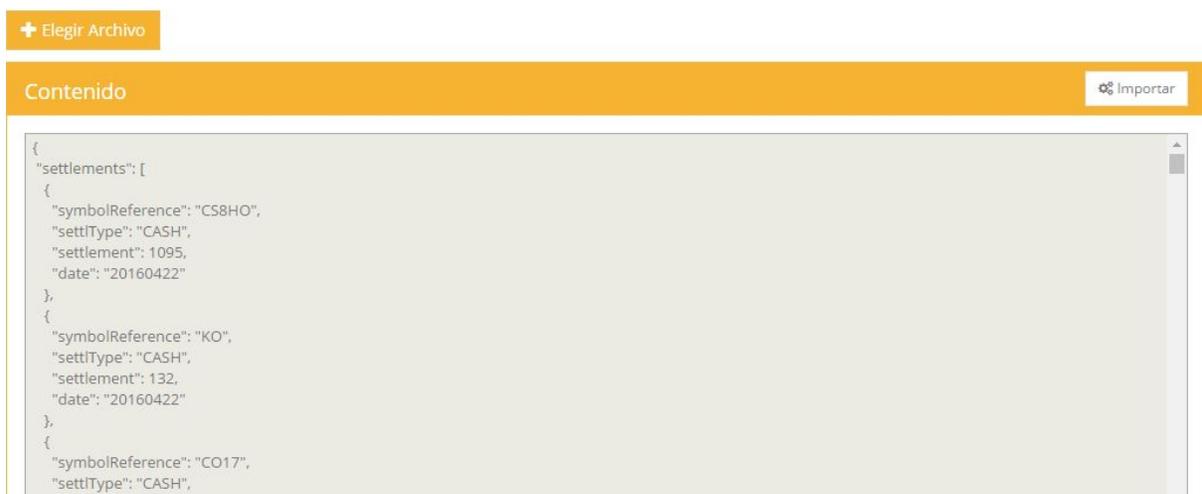
A través de la misma se podrán importar el Saldo Líquido (ver Anexo II), la Posición (ver Anexo III), las Otras Garantías (ver Anexo IV) y el Crédito (ver Anexo V) de todas las cuentas habilitadas para DMA. Dicha información luego es volcada al Resumen de Cuenta (ver Sección 4.1 – Resumen de Cuenta) y al reporte de Posición (ver Sección 5 – Reportes) para realizar las validaciones de saldo y stock correspondientes.

Importante:

Las importaciones realizadas durante el día serán válidas sólo para la rueda en curso, por lo que al día siguiente todos los saldos vuelven a cero. De esta forma el bróker se asegura que DMA contenga únicamente información actualizada para controles de riesgo.

Para realizar este proceso, debemos ir a [Gestión de datos > Importación](#) y hacer clic en la opción “Elegir archivos”, lo cual nos llevará a la pantalla “Abrir” donde deberemos seleccionar el archivo que deseamos subir y luego hacer clic en “Abrir” al pie de la pantalla.

De esta forma se cargará la pantalla con la información contenida en el archivo seleccionado.



The screenshot shows a web interface with a header bar containing a '+ Elegir Archivo' button and an 'Importar' button. Below the header is a 'Contenido' section displaying a JSON array of settlement objects. The JSON data is as follows:

```
{
  "settlements": [
    {
      "symbolReference": "CS8HO",
      "settleType": "CASH",
      "settlement": 1095,
      "date": "20160422"
    },
    {
      "symbolReference": "KO",
      "settleType": "CASH",
      "settlement": 132,
      "date": "20160422"
    },
    {
      "symbolReference": "CO17",
      "settleType": "CASH",

```

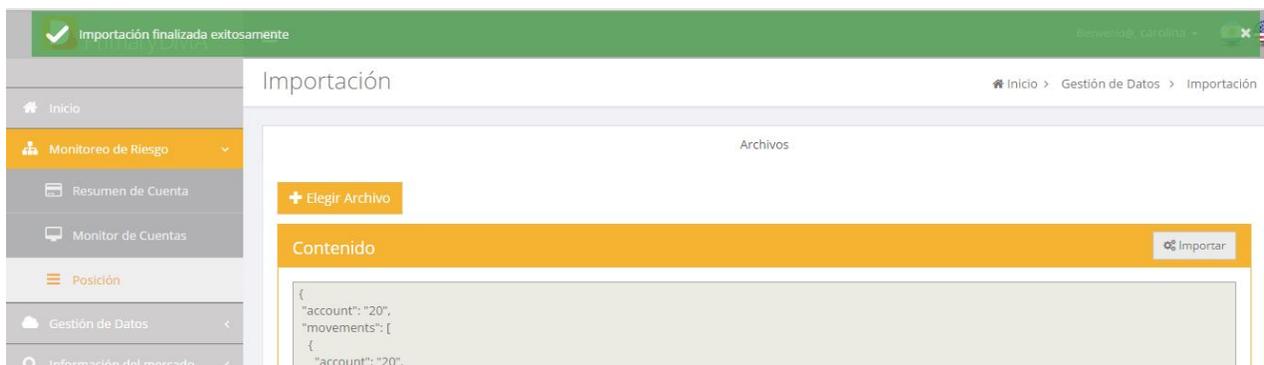
Para finalizar, hacemos clic en el botón “Importar” ubicado en el margen superior derecho de la pantalla.

Si existe algún error en el formato o contenido del archivo este es el momento en el cual el sistema nos lo informará con un mensaje para proceder a editar el JSON.

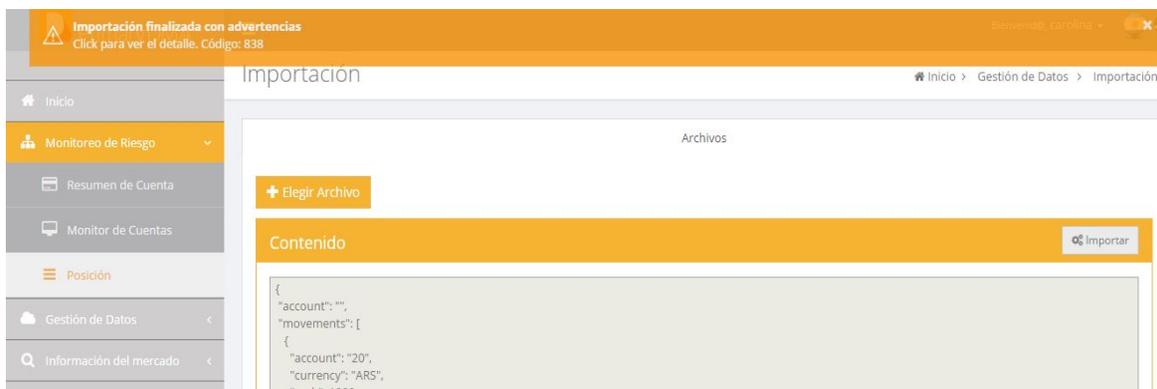
Existen tres tipos de mensajes, los cuales se mostrarán en el margen superior de la pantalla, los mismos son: “Importación finalizada exitosamente”, “Importación finalizada con advertencias” y “Error” (en caso de que el formato no sea válido)

Los mensajes de importación se mostrarán por 10 segundos, luego desaparecerán. Si nos situamos con el cursor sobre el mensaje el mismo no desaparecerá.

Modelo 1: Importación realizada con éxito.

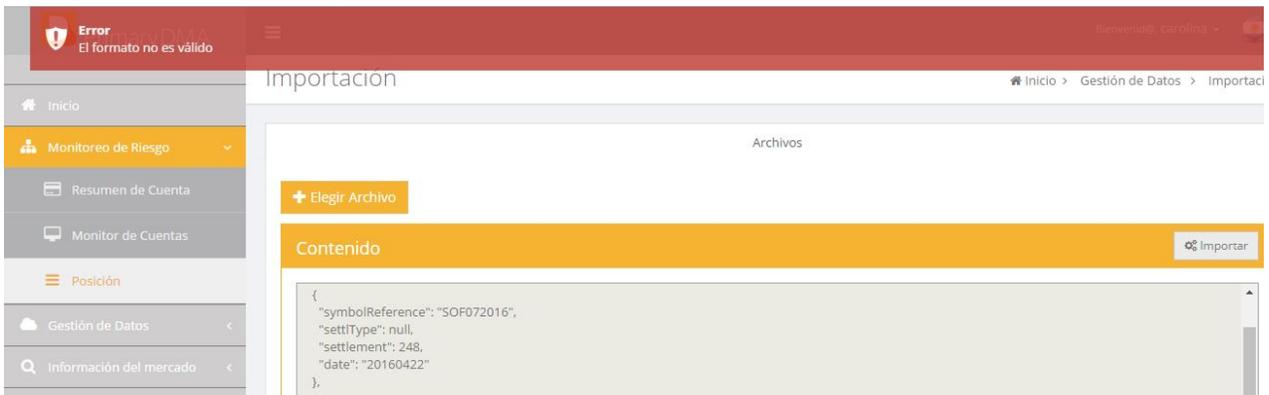


Modelo 2: Importación realizada con Advertencias.



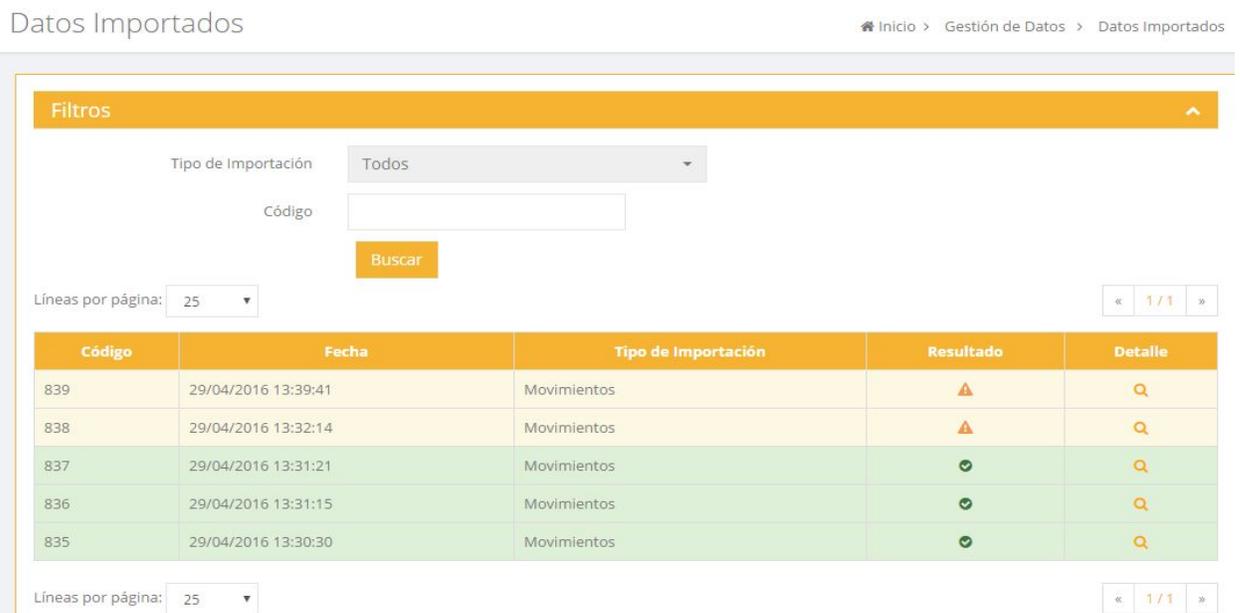
Importante: Tenemos la posibilidad de hacer clic sobre el mensaje que se muestra para acceder directamente a la pantalla de “Datos Importados” y poder ver el detalle de la importación. (Ver punto 6.1 de Importaciones Históricas)

Modelo 3: Error en la importación.



6.2 Datos importados

Para acceder a las importaciones históricas debemos dirigirnos a [Gestión de Datos > Datos Importados](#). La pantalla que permite ver el historial de todas las importaciones realizadas con la posibilidad de acceder a un detalle con los datos de la importación y su resultado.



Código	Fecha	Tipo de Importación	Resultado	Detalle
839	29/04/2016 13:39:41	Movimientos	⚠	🔍
838	29/04/2016 13:32:14	Movimientos	⚠	🔍
837	29/04/2016 13:31:21	Movimientos	✅	🔍
836	29/04/2016 13:31:15	Movimientos	✅	🔍
835	29/04/2016 13:30:30	Movimientos	✅	🔍

Es importante destacar que se puede filtrar por tipo de importación, limitando la búsqueda según su interés.

Cada registro del listado de datos importados cuenta con un detalle. El mismo se accede desde el ícono , y mostrará por defecto los detalles de “Salida”, donde se observarán los ítems exitosos o con advertencias, según corresponda.

A su vez podemos seleccionar la pestaña de “Entrada” en la cual visualizaremos los detalles del archivo importado, para que, en caso de observar algún error, poder corregir el JSON.

A continuación tenemos un ejemplo de los detalles de Salida:

Detalles de Entrada (hacemos clic sobre la pestaña)

Salida
Entrada

✔ Items exitosos
↑

Líneas por página: « 1 / 1 »

Cuenta	Plazo de liquidación	Moneda	Saldo Líquido
20	CASH	ARS	1000

Líneas por página: « 1 / 1 »

⚠ Items con advertencias (no importados)
↑

Cuenta	Plazo de liquidación	Moneda	Saldo Líquido
Tipo de advertencia: Cuenta no definida en el sistema de riesgo			
9999	CASH	ARS	500.5

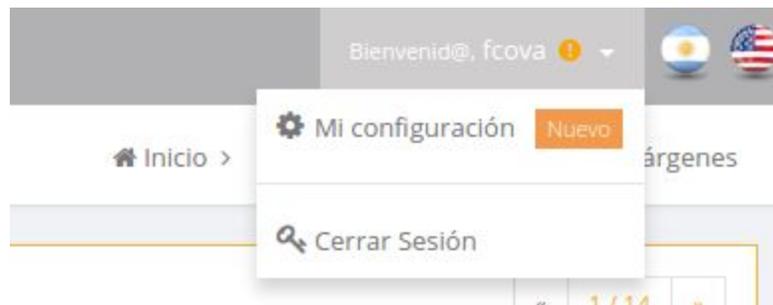
7. Administración de parámetros por cuenta

Permite la administración de parámetros por defecto que se van a aplicar a todas las cuentas al momento del alta en Rima como así también la personalización a nivel cuenta, permitiendo tener excepciones a la configuración por defecto.

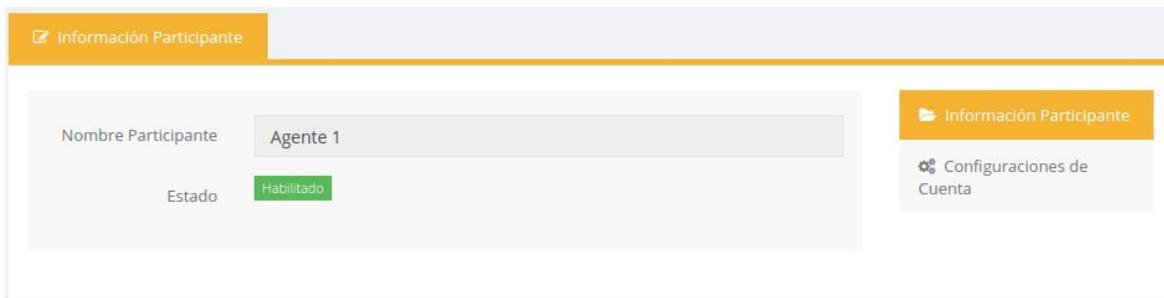
1.1 Administración de parámetros por defecto para cuentas

El participante, tiene la posibilidad de configurar un set de parámetros por defecto, que van a aplicar a todas las cuentas que se den de alta para el participante.

Para acceder a la administración de estos parámetros, hay que ir a la parte superior derecha de la pantalla y hacer click sobre el nombre del usuario:



Se desplegará una lista con una nueva opción, “Mi configuración”.



Una vez dentro de “Mi configuración”, vamos a poder ver los datos del participante con la posibilidad de acceder a “Configuraciones de Cuenta”. En esta pantalla vamos a poder modificar la configuración por defecto que aplica al momento del alta de cuentas dentro de Rima.

Configuraciones de Cuenta

¿Reinicia crédito? No

Factor Margen

Actualizar

Información Participante

Configuraciones de Cuenta

Desde esta pantalla se pueden modificar las configuraciones default para las cuentas nuevas:

- ¿Reinicia crédito?: Si la opción se encuentra en “Si” el crédito ingresado para dicha cuenta vuelve a cero al inicio de cada rueda. Si la opción se encuentra parametrizada como “No” entonces el crédito asignado a la cuenta se mantendrá vigente y la cuenta arrancará la rueda siguiente con el último crédito asignado.
- Factor Margen: El valor ingresado en dicho campo multiplicará el requerimiento de márgenes que se importa por defecto desde ACSA con el fin de poder configurar márgenes distintos. Este campo puede tomar valores mayores a cero hasta 999.

1.2 Nueva Pantalla de configuración de cuentas

Desde esta pantalla es posible acceder a un listado de todas las cuentas para el participante con su respectiva configuración y con la posibilidad de personalizar los valores por cuenta.

Se accede una nueva opción en el menú lateral izquierdo en “Administración -> Cuentas”.

Líneas por página: 25

1 / 1

Editar Seleccionados

Exportar

	Cuenta	¿Reinicia crédito?	Factor Margen	Editar
<input type="checkbox"/>	10	No	1.20	
<input type="checkbox"/>	1000	No	1.00	
<input type="checkbox"/>	1000bisbis	No	1.00	
<input type="checkbox"/>	10bisbis	No	1.00	
<input type="checkbox"/>	11	No	1.00	
<input type="checkbox"/>	11bisbis	No	1.00	
<input type="checkbox"/>	89Ag1	No	1.80	
<input type="checkbox"/>	Riesgo1	No	1.00	

Líneas por página: 25

1 / 1

Desde este listado, se puede acceder a la configuración de la cuenta. Haciendo click en el lápiz (en la columna Editar) se accede a la siguiente pantalla:

Editar Cuenta ✕

Cuenta
10057

¿Reinicia crédito?
 No

Factor Margen
1

Actualizar Cerrar

Desde este pop-up se puede sobrescribir la configuración específica para la cuenta, permitiendo así cambiar el criterio heredado de la configuración del participante.

Modificación múltiple

Se puede realizar una modificación múltiple utilizando el checkbox en la tabla de cuentas. Permitir configurar masivamente el reinicio de las cuentas. De esta forma se podrán seleccionar todas, algunas o simplemente editar una.

Para esto se deberán seleccionar las cuentas cuya configuración se desea modificar y hacer click en el botón “*Editar Seleccionados*”. Para editar una sola continúa como hasta ahora haciendo click en el ícono del lápiz en la fila de la cuenta que se desea editar.

Editar Cuentas Seleccionadas ✕

¿Reinicia crédito?
 SI

Actualizar Cerrar

8. Información de mercado

8.1 Márgenes

Los márgenes por instrumento pueden consultarse a través de [Información de Mercado > Márgenes](#), donde se encuentran listados todos aquellos instrumentos que calculan márgenes y por ende requieren de estos valores para los controles de riesgo. Tener en cuenta que solo se encuentran listados los instrumentos que calculan márgenes y que ya han sido negociados con anterioridad.

Márgenes Inicio > Información del mercado > Márgenes

Líneas por página: 25 « 1 / 1 »

[Exportar](#)

Producto ▼	Instrumento	Tipo de Instrumento	Margen	Factor de conversión	Spread	Delta
AA17	AA17022017	Futuro	120.0000	0.01	60.0000	1.0000
DLR	DLR012017	Futuro	1.6900	1	0.2500	1.0000
DLR	DLR022017	Futuro	1.6900	1	0.2500	1.0000
DLR	DLR042017	Futuro	1.6900	1	0.2500	1.0000
DLR	DLR122016	Futuro	1.6900	1	0.2500	1.0000
DLR	DLR032017	Futuro	1.6900	1	0.2500	1.0000

Líneas por página: 25 « 1 / 1 »

Para los instrumentos que no tengan definido un margen se mostrará un guión en los campos correspondientes. En caso de que se desee negociar un contrato que precisa márgenes, se deberá contactar con el Administrador de la herramienta para que el mismo los defina.

8.2 Monedas

Las cotizaciones de monedas pueden consultarse a través de [Información de Mercado > Monedas](#), donde se encuentran listadas todas las monedas aceptadas por DMA.

Monedas Inicio > Información del mercado > Monedas

Moneda ▼	Descripción	Cotización
ARS	Peso	1.0000
ARS BCRA		1.0000
EUR	Euro	16.1542
U\$S	Dólar	15.0000
USD C	Dólar Cable	14.5000
USD D	Dólar Doméstico	14.5000
USD G	Dólar Gtía. ROFEX	14.5000
USD R	Dólar Referencia	14.3122

Aquellas que no tengan definida una cotización se mostrarán con guión en el campo Cotización.

A continuación se puede ver un detalle de cada una de las monedas:

- Euros: se calcula multiplicando el tipo de cambio de referencia del BCRA Com. "A"3500 (Pesos por Dólar) por el tipo de cambio de referencia del Banco Central Europeo (Dólares por Euro).
- Dólar MEP: tipo de cambio del dólar MEP. – USD D
- Dólar Cable: tipo de cambio del dólar contado con liquidación. – USD C
- Dólar garantía ROFEX. – U\$S
- Dólar Gtía. ROFEX: tipo de cambio definido por ROFEX y Argentina Clearing al que los ALyC pueden realizar débitos y créditos en la CCL y CIM nominada en Dólares conforme a lo indicado en el Instructivo de Liquidación de Argentina Clearing. – USD G
- Dólar Ref. CA3500: tipo de cambio de referencia del BCRA Com."A"3500. - USD R
- Pesos - ARS



8.3 Ajustes

A través de [Información de Mercado > Ajustes](#) podemos observar los precios de ajuste de los diferentes Instrumentos a diferentes fechas. En el encabezado de las columnas podremos filtrar según el concepto buscado.

Ajustes

[Inicio](#) > [Información del mercado](#) > [Ajustes](#)

Líneas por página: 25

« 1 / 14 »

Exportar

Instrumento	Tipo de Instrumento	Ajuste	Fecha
AA17	Título	1,618.50	14/11/2016
AA17022017	Futuro	1,735.47	14/11/2016
AA17122016	-	1,670.72	14/11/2016
AA17C	Título	102.90	14/11/2016
AA17D	Título	103.00	14/11/2016
AA26	-	1,621.00	14/11/2016

9. ANEXOS

9.1 Cálculos del precio de mercado

1. Si existe Last:
 - a) Si Bid > Last → Precio de Mercado = BID
 - b) Si Offer < Last → Precio de Mercado = OFFER
 - c) Sino se cumple a) o b) → Precio de Mercado = LAST

2. Si no existe Last pero existe Settlement:
 - a) Si Bid > Settlement → Precio de Mercado = BID
 - b) Si Offer < Settlement → Precio de Mercado = OFFER
 - c) Sino se cumple a) o b) → Precio de Mercado = SETTLEMENT

3. Si no existe Last ni Settlement → No calcula Precio de Mercado

9.2 Anexo II: Formato de importación - Saldo líquido

La importación de estos datos se ve reflejada en el campo Saldo Líquido del Resumen de Cuenta.

Modelo 1

Elimina el saldo existente al momento de la importación de todas las cuentas asociadas al rol y actualiza el saldo de todas las cuentas informadas en el nuevo archivo.

```
{ "account": "", "movements": [
{"account": "10", "currency": "ARS", "cash": 101.2, "settlType": "CASH"},
{"account": "20", "currency": "U$S", "cash": 103.2, "settlType": "T_PLUS_3"},
{"account": "20", "currency": "ARS", "cash": 104.2, "settlType": "CASH"},
{"account": "40", "currency": "ARS", "cash": 105.2, "settlType": "T_PLUS_3"},
{"account": "50", "currency": "ARS", "cash": 1067.2, "settlType": "T_PLUS_2"}
]
}
```

Modelo 2

Elimina el saldo existente al momento de la importación de la cuenta informada y actualiza sólo el saldo de la misma. Se conservan los saldos del resto de las cuentas asociadas al rol.

```
{"account": "10", "movements": [
{"account": "10", "currency": "U$S", "cash": 553.2, "settlType": "NEXT_DAY"},
{"account": "10", "currency": "ARS", "cash": 789.4, "settlType": "CASH"}
]
}
```

Descripción de datos

Concepto	Descripción
account	Número de la cuenta de negociación.
currency	Moneda en la cual está expresado el importe. Debe corresponder a alguna de las siglas administradas por la aplicación, las cuales podrán consultarse en la pantalla Monedas.
cash	Saldo de la cuenta corriente a la fecha indicada según settlType. Utilizar puntos para separadores de decimales.
settlType	Fecha del saldo en cuenta corriente informado, aceptando como posibles valores CASH, NEXT_DAY, T_PLUS_2 y T_PLUS_3 para contado inmediato, 24hs, 48hs y 72hs respectivamente.

9.3 Anexo III: Formato de importación - Posición

Los datos importados sobre la posición de la cuenta permitirán el cálculo de diferencias, márgenes y portfolio de la cuenta.

Modelo 1

Elimina la posición existente al momento de la importación de todas las cuentas asociadas al rol y actualiza la posición de todas las cuentas informadas en el nuevo archivo.

```
{
  "account": "",
  "positions": [
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "TVPP052015",
      "settlType": null,
      "size": "-100",
      "price": 6.180000,
      "originalPrice": 9.860250,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "DLR022016",
      "settlType": null,
      "size": "101",
      "price": 11.345000,
      "originalPrice": 11.430495,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "DLR012016",
      "settlType": null,
      "size": "100",
      "price": 11.095000,
      "originalPrice": 11.200000,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "DLR072015",
      "settlType": null,
      "size": "-200",
      "price": 9.768000,
      "originalPrice": 9.775000,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "PESA",
      "settlType": "CASH",
      "size": "-3000",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "NDG21",
      "settlType": "CASH",
      "size": "110000",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    },
    {
      "account": "3333",
      "symbolReference": "AO16",
      "settlType": "T_PLUS_3",
      "size": "41700",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    },
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "RO15",
      "settlType": "T_PLUS_3",
      "size": "18862",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    },
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "APBR",
      "settlType": "CASH",
      "size": "2000",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    },
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "APBR",
      "settlType": "T_PLUS_3",
      "size": "-2000",
      "price": 0.000000,
      "originalPrice": 0.000000,
    }
  ]
}
```

Modelo 2

Elimina la posición existente al momento de la importación de la cuenta informada y actualiza sólo la posición de la misma. Se conservan las posiciones del resto de las cuentas asociadas al rol.

```
{
  "account": "2222",
  "positions": [
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "RO15",
      "settlType": "T_PLUS_3",
      "size": "18862",
      "price": 0.00000,
      "originalPrice": 0.00000
    },
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "APBR",
      "settlType": "CASH",
      "size": "2000",
      "price": 0.00000,
      "originalPrice": 0.00000
    },
    {
      "account": "2222",
      "symbolReference": "APBR",
      "settlType": "T_PLUS_3",
      "size": "-2000",
      "price": 0.00000,
      "originalPrice": 0.00000
    }
  ]
}
```

Descripción de datos

Concepto	Descripción
account	Número de la cuenta de negociación.
symbolReference	Siglas utilizadas por DMA para identificar cada instrumento. Coinciden con las utilizadas por Argentina Clearing.
settlType	Fecha del saldo en cuenta corriente informado, aceptando como posibles valores CASH, NEXT_DAY, T_PLUS_2 y T_PLUS_3 para contado inmediato, 24hs, 48hs y 72hs respectivamente.
size	<p>Cantidad de contratos del instrumento, utilizando signo positivo para posición comprada y negativo para posición vendida.</p> <p>Cuando se trate de instrumentos tipo Stock y Bond, se informará la tenencia a la fecha como Contado Inmediato y las cantidades a liquidar a cada plazo (siguiendo el ejemplo del Modelo 1, la cuenta 20 posee una tenencia a la fecha de 100 valor nominal de RO15 y liquidarán a 24hs ventas por 400 valor nominal).</p>
price	Precio de ajuste del día anterior (obligatorio para instrumentos del tipo futuro).
originalPrice	Precio promedio ponderado de la posición en dicho instrumento (obligatorio para instrumentos del tipo futuro).

Validaciones

Se valida que los Instrumentos informados sean administrados por DMA. El instrumento surge de la combinación de los datos `symbolReference` y `settType`. En caso que el mismo no sea reconocido por la aplicación, se rechazará la importación (no tomará ningún dato) y mediante un mensaje se detallarán los instrumentos no aceptados para proceder a la corrección del JSON.

9.4 Anexo IV: Formato de importación - Otras garantías

Los importes informados se ven reflejados en el campo Otras Garantías del Reporte de Garantías.

Modelo 1

Elimina las garantías existentes al momento de la importación de todas las cuentas asociadas al rol y actualiza las garantías de todas las cuentas informadas en el nuevo archivo.

```
{"account":""," "collaterals":[
  {"account":"10", "currency":"ARS", "amount":101.2},
  {"account":"20", "currency":"U$S", "amount":103.2},
  {"account":"20", "currency":"ARS", "amount":104.2},
  {"account":"40", "currency":"ARS", "amount":105.2},
  {"account":"50", "currency":"ARS", "amount":1067.2}
]
```

Modelo 2

Elimina las garantías existentes al momento de la importación de la cuenta informada y actualiza sólo la garantía de la misma. Se conservan las garantías del resto de las cuentas asociadas al rol.

```
{"account":"10", "collaterals":[
{"account":"10", "currency":"U$S", "amount":553.2}, {"account":"10", "currency":"ARS", "amount":789.4}]}
```

Descripción de datos

Concepto	Descripción
account	Número de la cuenta de negociación.
currency	Moneda en la cual está expresado el importe. Debe corresponder a alguna de las siglas administradas por la aplicación, las cuales podrán consultarse en la pantalla Monedas.
amount	Valor de los activos depositados en garantía. Utilizar puntos para separadores de decimales.

9.5 Anexo V: Formato de importación - Crédito

Si bien el Crédito puede ser ingresado manualmente desde la pantalla de Administración de Créditos, se ofrece como alternativa la importación de estos valores para una o varias cuentas.

Modelo 1

Elimina el crédito existente al momento de la importación de todas las cuentas asociadas al rol y actualiza el crédito de todas las cuentas informadas en el nuevo archivo. Se admite moneda ARS y un solo crédito por cuenta.

```
{ "account": "", "credits": [
  { "account": "10", "currency": "ARS", "amount": 101.2 },
  { "account": "20", "currency": "ARS", "amount": 103.2 },
  { "account": "30", "currency": "ARS", "amount": 104.2 },
  { "account": "40", "currency": "ARS", "amount": 105.2 },
  { "account": "50", "currency": "ARS", "amount": 1067.2 } ] }
```

Modelo 2

Elimina el crédito existente al momento de la importación de la cuenta informada y actualiza sólo el crédito de la misma.

```
{ "account": "10", "credits": [
  { "account": "10", "currency": "ARS", "amount": 789.4 }
] }
```

Descripción de datos

Concepto	Descripción
account	Número de la cuenta de negociación.

currency	Moneda en la cual está expresado el importe. Debe corresponder a alguna de las siglas administradas por la aplicación, las cuales podrán consultarse en la pantalla Monedas.
amount	Importe otorgado como crédito. Utilizar puntos para separadores de decimales.

9.6 Anexo VI: Exportación de datos desde BackOffice PRO

Todos aquellos datos requeridos por PMY DMA para llevar adelante los controles de riesgo pre- trade, pueden ser informados desde BackOffice PRO.

Primeramente, tildar en la pantalla Personas>Operaciones>Comitentes de BackOffice PRO el campo “Primary DMA” de las personas que utilicen DMA y configurar “Factor DMA” con el valor deseado. Este factor multiplica al saldo de la cuenta informado, generalmente suele colocarse 1.

Un vez definido ésto, de manera diaria y posterior a los procesos de back-office de rutina, acceder a la pantalla Actualizaciones>Importación/Exportación>Exportación y exportar los temas Primary DMA Saldos, Primary DMA Posiciones y Primary DMA Otras Garantías. Si se encuentran realizadas todas las configuraciones de mapeo de datos, el sistema generará tres archivos formato json que serán guardados en la ruta indicada en el mensaje que se muestra al finalizar el proceso.

Cuando existan datos sin mapeo, BackOffice PRO mostrará un mensaje indicando que no ha podido realizarse la exportación y detallará las conversiones faltantes. En este caso, el usuario debe dirigirse a la pantalla Actualizaciones>Importación/Exportación>Relaciones, filtrar por “Tercero” igual a “Primary” y proceder a ingresar los valores correspondientes para cada registro donde el campo “Valor Tercero” sea igual a “<sin valor>”. Los posibles datos a convertir son:

- Comitente (colocar número de cuenta de negociación);
- Moneda (utilizar únicamente las administradas por PMY DMA);
- Posición RIMA (utilizar las siglas de ACSA respetando mayúsculas, minúsculas, guiones, espacios, etc);
- Productos Valores (ídem Posición RIMA).

Ejemplo:

Tercero	Dato	Valor Propio	Valor Tercero
Dato: Comitente			
Primary	Comitente	Gomez Adrian	10000
Dato: Moneda			
Primary	Moneda	Dolares	US\$
Primary	Moneda	Pesos	ARS
Primary	Moneda	USD ROFEX	USD R
Dato: Plazos de negociación			
Primary	Plazos de negociación	Contado inmediato	CASH
Primary	Plazos de negociación	24 Hs.	NEXT_DAY
Primary	Plazos de negociación	48 Hs.	T_PLUS_2
Primary	Plazos de negociación	72 Hs.	T_PLUS_3
Dato: Posición DMA			
Primary	Posición DMA	DLR012017 (ROFEX)	DLR012017
Primary	Posición DMA	DLR022017 (ROFEX)	DLR022017
Dato: Productos Valores			
Primary	Productos Valores	AY24	AY24
Primary	Productos Valores	APBR	APBR

Una vez realizadas todas las conversiones, proceder a exportar nuevamente los archivos no generados.

Como último paso, dirigirse a PMY DMA e importar todos los archivos desde la pantalla

Importación.

9.7 Anexo VII: Validaciones aplicables a las importaciones

Se detallan a continuación las validaciones que aplica el sistema a las importaciones:

1. Que todos los archivos informen un mismo concepto, como por ejemplo saldos líquidos. El upload múltiple no contempla la posibilidad de subir posiciones, garantías y saldos en simultáneo, sino que seguirán realizándose por separado. Si se intenta importar distintos conceptos al mismo tiempo, la importación se rechazará bajo el mensaje “No se ha podido importar el archivo: formato incorrecto”.
2. Que todos los archivos posean el formato de edición de muchas cuentas, o bien si los archivos poseen el campo account definido éste debe ser siempre para la misma cuenta. Si esta condición no se cumple, la importación se rechazará bajo el mensaje “No se esperaban las siguientes cuentas: [Nro_de_cuenta]”.
3. Para el caso de Saldo Líquido y Otras Garantías, se admitirá la repetición de la combinación

{cuenta} – {Instrumento} – {Plazo}, sumando todos los registros importados donde estos datos coincidan. Por otro lado, la Posición deberá ser única para la combinación {cuenta} – {Instrumento} – {Plazo}. En caso de importar varios archivos donde estos datos coincidan, se rechazará la importación detallando los datos repetidos con el mensaje “Registros repetidos ({cantidad}): [{cuenta} – {Instrumento} – {Plazo}]”.

4. Para importar Posición se validará lo siguiente: a) existencia de conversión del instrumento importado; b) verificación de existencia del instrumento importado en los sistemas del Mercado. Si se rechaza una importación por alguno de estos motivos, en el mensaje de error de importación se detallará lo siguiente:
 - I. Cuando no exista conversión se expondrá {Instrumento} - {Plazo}
 - II. Cuando no exista en el mercado se expondrá {Instrumento} - {Plazo}*
5. Validación en importación de posiciones iniciales para contratos de futuro: el precio para diferencias no debe superar en un 10% al precio de último ajuste para dicho contrato de futuro. En caso de superarlo se mostrará un mensaje que indicará que “el precio se encuentra fuera de rango”.
6. Validación en importación de posiciones iniciales para títulos: se omitirán los registros que contengan períodos de liquidación desconocidos en las importaciones de posiciones iniciales y movimientos. Los plazos de liquidación válidos son CI, NEXT_DAY, T_PLUS_2 y T_PLUS_3. El detalle de los registros omitidos puede visualizarse desde el menú Gestión de Datos > Datos Importados.
7. Importación solo de cuentas con riesgo: en las importaciones de Posiciones, Movimientos, Garantías y Créditos solo se importarán los registros para las cuentas que son de riesgo. Para las que no, se omitirán. Cuando el sistema detecta cuentas que no son de riesgo, se mostrará un mensaje de “Importación realizada con ADVERTENCIAS”. El detalle de cuáles fueron las cuentas que se omitieron se podrá acceder desde el menú [Gestión de Datos > Datos Importados](#).