

ANEXO IV

ETAPA DE ADECUACIÓN:

Los Mercados registrados en la CNV deberán adecuar sus sistemas conforme lo requerido en los Anexos IV y V del presente Capítulo antes del 31 de julio de 2022. Los Mercados deberán ofrecer como alternativa la versión ISO 20022 del protocolo a partir del 1° de agosto de 2022, ofreciendo la misma funcionalidad según su rol y con las mismas condiciones de acceso, seguridad, integridad y disponibilidad.

Los Mercados deberán remitir a la CNV toda la información correspondiente a sus operaciones en tiempo real. La remisión deberá contener la información de Comitentes intervinientes en las operaciones, el CUIT del Comitente Comprador-CUIT y el CUIT del Comitente Vendedor, el Tipo de Comitente Comprador y el Tipo Comitente Vendedor, en tiempo real y en formato FIX, de acuerdo con las especificaciones de los Anexos IV y V del presente Capítulo.

Los CUIT/CUIL deberán ser remitidos al enviarse la operación original.

Asimismo, no podrán -remitirse en ningún caso números de CUIT de tipo genéricos, como por ejemplo el identificado con el número 20-00000000-6.

Para actualizar la información de los CUIT/CUIL se deberá enviar un nuevo Registro 66 (SESENTA Y SEIS) "Alta Comitentes" para tales fines.

Además de los CUIT de los clientes, los Mercados deberán informar, en todos los casos sin excepción, el nombre y apellido del cliente -si se trata de una persona humana- o la denominación social del cliente -si se trata de una persona jurídica-. También deberán informar el CUIT y la respectiva denominación de cada uno de los condóminos o cotitulares de las subcuentas comitentes, el número de subcuenta comitente en CVSA o el número que identifique a las cuentas de los clientes en el caso de los Mercados de Futuros.

El alta de los datos indicados precedentemente para el Registro de Comitentes y Condóminos o cotitulares de las cuentas comitentes se efectuará informando el Registro 67 (SESENTA Y SIETE).

Por cada subcuenta comitente de un agente se deberá informar su titular y todos los condóminos que participan de la misma, identificados por CUIT.

Los Apoderados, Representantes Legales, Socios Gerentes, etc., deberán informar mediante el registro 67 (SESENTA Y SIETE) el CUIT de la sociedad a la cual representan.

Los Comitentes del exterior que no tengan CUIT, deberán informar los correspondientes números de CDI (Clave de Identificación –AFIP) o en su caso CIE (Clave de Inversores del Exterior – AFIP).

Se incorpora en todos los Mensajes el campo Nro. FCI Cnv para que se informe el Nro. de FCI otorgado por CNV, cuando la operación involucre a un Fondo Común de Inversión

Se deberán informar sin excepción todas las operaciones dadas de baja con posterioridad a su concertación, así como todos los arreglos en las operaciones que se lleven a cabo con posterioridad a la misma.

Se recuerda que el dato correspondiente al Código ISIN debe ser remitido obligatoriamente para todas las especies que cuenten con el mismo.

En esta etapa los Mercados deberán:

1) Enviar:

▪ Las Especies / Títulos que pueden operar en cada mercado, de acuerdo al formato del Registro 60 (SESENTA).

- Los Agentes habilitados para operar en cada mercado, de acuerdo al formato del Registro 61 (SESENTA Y UNO).

2) Informar los valores y descripciones de los distintos atributos de las Operaciones que realizan:

- Ruedas
- Plazos
- Monedas
- Tipos de comitentes
- Tipos de cheques
- Tipos de operación de destino
- Plazos de las operaciones

Si se produjesen cambios o se incorporasen nuevos atributos distintos de los detallados en el Anexo V, los Mercados deberán informarlos a la CNV en un plazo de TREINTA (30) días corridos previos a remitir las operaciones, a efectos de que pueda otorgar nuevos códigos o autorizar los cambios que resulten necesarios.

La CNV ha definido los valores que corresponden a los distintos atributos en el Anexo V, el cual contiene los formatos de registros. Si algún valor no estuviera considerado para alguno de los Mercados, éste deberá informar a la CNV, quien actualizará la información y notificará al Mercado el código a utilizar para informar las operaciones.

En todos los casos, los Mercados deberán utilizar los códigos definidos por la CNV para enviar la información.

Cada Mercado enviará sus operaciones en registros en formato de mensajería FIX de acuerdo a lo especificado en el Anexo V del presente capítulo.

PUESTA EN MARCHA

Finalizada la etapa de adecuación, se inicia la Puesta en Marcha del sistema con los Mercados. En dicho momento los Mercados deberán tener adecuados y probados sus sistemas para enviar la totalidad de las operaciones de acuerdo a lo especificado por la CNV.

CONSIDERACIONES GENERALES

- Responsabilidad

Cada Mercado será el responsable de entregar en tiempo y forma la información requerida por esta CNV acerca de las transacciones realizadas. Cada Mercado arbitrará los medios que hagan falta para cumplir con lo requerido por la CNV.

- Requisitos

En *condiciones normales*, el Mercado deberá entregar el registro de las operaciones concertadas en tiempo real o en un lapso no mayor a los TREINTA (30) segundos posteriores a su concertación.

En *condiciones anormales o de contingencia*, el Mercado deberá arbitrar los medios que sean necesarios para entregar el registro correspondiente en un lapso menor a UNA (1) hora de producida la transacción.

Se entiende por condiciones anormales:

- Caída de vínculos de comunicaciones,
- Interrupciones de alimentación eléctrica,
- Falla de servidor o dispositivo.

En *cualquier otra situación*, el responsable del área de Operaciones del Mercado deberá notificar el mismo día a la CNV, por correo electrónico, o cualquier otro medio

fehaciente previamente aprobado, la causa del incumplimiento, las medidas correctivas que tomarán y el tiempo estimado de normalización en el envío de información.

Las áreas técnicas de cada Mercado deberán informar a la CNV la arquitectura de la solución tecnológica que será implementada. Para ello deberán contar con adecuados recursos y contratos con proveedores.

La solución a utilizar para la transferencia de los registros deberá presentar, como mínimo, las siguientes características:

Privacidad: deberá asegurar la privacidad de la información suministrada.

Integridad: deberá asegurar la integridad de la información suministrada.

Compleitud: deberá asegurar que ningún registro se pierda. En el caso de detectar una pérdida deberá retransmitir dicho registro.

Originalidad: deberá asegurar que ningún registro sea recibido por la CNV en duplicado. Se deberá tener especial cuidado respecto de esto, tanto en las entradas en contingencia como en las salidas de contingencia.

La CNV sólo admitirá incumplimientos de estos requisitos por causas fundadas de fuerza mayor, debidamente documentados, pero no admitirá incumplimientos por causas comprobables de imprevisión o impericia de parte del Mercado.

La CNV llevará a cabo un control de disponibilidad.



República Argentina - Poder Ejecutivo Nacional
Las Malvinas son argentinas

Hoja Adicional de Firmas
Anexo

Número:

Referencia: ANEXO IV - "PROYECTO DE IMPLEMENTACIÓN DEL SISTEMA DE VIGILANCIA Y MONITOREO INTELIGENTE CNV".

El documento fue importado por el sistema GEDO con un total de 3 pagina/s.