

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Ticket #282291

Status	X - Para cerrar	Name	Alma Fernandez
Priority	Emergency	Email	alma.fernandez@sudameriscb.com.py
Department	Support	Phone	595981916873
Create Date	11/27/24, 11:03 AM	Source	Web

Ticket Details

Urgency:	Trabajo detenido
Related client number or user:	ALMA FERNANDEZ

ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11

11/27/24, 11:03 AM Alma Fernandez

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Buenos días Estimados

En adjunto te detallo las diferencias del ANEXO H fecha 25.11 validadas nuevamente el día de hoy.

- 1.Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB
- 2.No figura el número de RUC
- 3.Calificación de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo, no agregar la palabra sensible)
- 4.Cálculo de ponderación de riesgo no corresponde con el título PYBRI02F2889
- 5.El valor de compra no corresponde en cuanto al bono PYTAU01F1133
- 6.El valor contable no corresponde (para todos los títulos)
- 7.El valor mercado no corresponde (para todos los títulos)
- 8.El monto cartera no corresponde (para todos los títulos)
- 9.El valor ponderado por riesgo no corresponde (para todos los títulos)
- 10.Balance Type excluir del reporte
- 11.Desglosar de los títulos de frigo del exterior FRIGF5221691 (es decir por cada compra varía el valor de compra, debe estar por separado)
- 12.En cuanto a los títulos del exterior no coincide nombre del emisor, no figura Nro. de identificación, nominación de tipo de valor diferente en ambos reportes, no corresponde tasa nominal, no coinciden los valores desde valor nominal en adelante.
- 13.TSRYS5823597 No coincide país emisor, nombre del emisor,ruc,tasa nominal, no coinciden los valores desde valor nominal en adelante(hasta valor ponderado por riesgo)
14. Falta agregar la compra del CDA AG2455

Muchas gracias desde ya

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM
ANEXO H 25.11 VALIDACIONES AL 27.11.xlsx (68.6 kb)

11/27/24, 1:02 PM Paola Romay

Buenas tardes, como están?

A continuación detallo por punto:

1.Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB

2.No figura el número de RUC

Deben ingresar en el parámetro 'CompanyName' de corex CBSA en el campo value long, el valor que desean que se muestre.

El RUC lo deben completar en el parámetro 'CompanyRUC' en el campo text short.

3. Calificación de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo, no agregar la palabra sensible)

Figuran los nombre que configuraron en corex en la sección: Asset Risk Types. Entiendo que se explico en otro ticket a detalle.

4.Calculo de ponderación de riesgo no corresponde con el título PYBRI02F2889

A continuación detallo como se realiza el calculo:

En el parámetro "**assetRiskFactor**" se identifiquen por id los subassetclass y los emisores que requieren un valor determinado por normativa.

Ejemplo del contenido del parámetro:

```
{ "SubAssetClass": [{ "key": 8, "value": "0" } ], "Issuer": [ { "key": 60, "value": "0.10" }, { "key": 76, "value": "0.10" } ] }
```

En el ejemplo subassetclass 8 refiere a CDA, Issuer 60 refiere a BANCO CENTRAL DEL PARAGUAY, 76 refiere a MINISTERIO DE ECONOMIA Y FINANZAS.

En los casos que no se encuentren especificados en el parámetro se muestra el mayor entre ponderación por riesgo y ponderación por plazo.

La ponderación por riesgo es el puntaje correspondiente al Asset risk type asociado al asset. Esto se puede modificar en corex -> Asset risk types.

La ponderación por plazo es el plazo residual/12 y dependiendo del rango en el que entra este valor es la ponderación:

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

5.El valor de compra no corresponde en cuanto al bono PYTAU01F1133

Valor de compra se calcula como par value * precio de compra, habria que chequear con que precio se ingreso la operación en el sistema.

6.El valor contable no corresponde (para todos los títulos)

7.El valor mercado no corresponde (para todos los títulos)

8.El monto cartera no corresponde (para todos los títulos)

9.El valor ponderado por riesgo no corresponde (para todos los títulos)

Estos son los cálculos que realiza el sistema para cada uno de los campos mencionados, esto esta validado por la SIV.

Valor de Compra > Par value * precio de compra

Valor Contable > (Par value * precio clean de compra) + intereses devengados desde el último pago de cupón

Valor Mercado > igual a Valor Contable

Monto Cartera > Valor Mercado * cantidad de títulos

Valor Ponderado por Riesgo > Monto Cartera * Ponderación de riesgo

10.Balance Type excluir del reporte

El template que están usando esta desactualizado, favor de usar el adjunto. Se debe agregar en la carpeta templates de corex.

11. Desglozar de los títulos de frigo del exterior FRIGF5221691 (es decir por cada compra varía el valor de compra, debe estar por separado)

Podrían adjuntarnos la normativa donde se especifica que deben estar por separado?

12.En cuanto a los títulos del exterior no coincide nombre del emisor, no figura Nro. de identificación, nominación de tipo de valor diferente en ambos reportes, no corresponde tasa nominal, no coinciden los valores desde valor nominal en adelante.

Emisor: pueden modificarlo desde Ops -> Asset (buscarlo) -> Pestaña General -> Country -> seleccionar el correcto y guardar.

Nro. de identificación: en corex de CBSA buscar Issuers -> buscar el que corresponde -> editar con el

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Nominación de tipo de valor: se muestra el nombre de la subassetclass asociada al asset, pueden editarlo desde corex -> sub asset class -> buscar y editar el que corresponda.

Tasa nominal: lo vemos igual.

Valores desde valor nominal en adelante: mismos cálculos mencionados anteriormente.

13.TSRY5823597 No coincide país emisor, nombre del emisor,ruc,tasa nominal, no coinciden los valores desde valor nominal en adelante(hasta valor ponderado por riesgo)

En cuanto al **país del emisor** el procedimiento es el mismo que se menciona en el punto anterior.

Nombre del emisor: si quieren modificarle el nombre al que ya tiene asignado el asset pueden hacerlo desde corex-> Issuers, sino pueden crear uno nuevo desde Ops-> Assets-> General -> Issuers.

Ruc: el procedimiento para modificarlo es el mismo que se menciona en el punto anterior.

Tasa Nominal: lo revisamos.

Valores desde valor nominal en adelante: mismos cálculos mencionados anteriormente.

14. Falta agregar la compra del CDA AG2455

Podrían chequear desde trader en el portafolio de posición propia si tiene este asset en cartera al 25/11.

Cualquier cosa que necesiten ayuda para ver alguno de estos puntos pueden pedirle ayuda a Alan o Martin.

Quedo atenta, saludos.

Paola.

11/28/24, 6:35 PM Alma Fernandez

Buenas tardes Paola,

Derivada la consulta al area de mesa de trading,

Tengo retorno de los mismos y te lo hago saber,

Muchas gracias desde ya!

12/3/24, 12:47 PM Jose Meza 25 at 2:26 PM

Buenas tardes, confirmo que tuvimos una reunion por Teams con Paola Romay, Martin Vila y Luis Sartorio, donde se corrigieron parametros del sistema el punto

1.Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB, se procedio a cargar los datos en "Company Name", punto 10.Balance Type excluir del reporte, se actualizo el template en Casa De Bolsa Corex, se verifico "Asset Risk Types", para pyC donde se corrigio el puntaje de 0 a 1, (Pendiente verificar y corregir los demas Tipos de Riesgos), en el parametro

"Issuers" se erifico el valor correspondiente a MINISTERIO DE HACIENDA 34, MINISTERIO DE ECONOMIAS Y FINANZAS 91, BANCO CENTRAL 60, esto se coloco en el parametro

del Anexo H para que traiga correctamente la descripcion.Punto 11 BW solicitaron que se les envie la Resolucion Normativa. Punto 13 esta mal cargado o migrado el valor del

campo Country, se remplazo PY por EEUU, (Habria que verificar planilla de Migracion con Julio Martinez).

12/5/24, 9:55 AM Alma Fernandez

Buenos días Estimados

En adjunto las validaciones del anexo H al 04/12

Saludos!

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Larissa Dure

Enviado el: miércoles, 4 de diciembre de 2024 12:33 p. m.

Para: Jose Meza ; Luis Sartorio ; Julio Martinez

CC: SoporteTI ; Alma Fernandez

Asunto: RE: ANEXO H TICKET #282291

Buenos días a todos,

Espero se encuentren muy bien,

Adjunto van las observaciones del cruce entre Anexo H BW Vs archivo enviado por Mesa de Dinero de fecha 03/12. Entendemos que una vez subsanados los puntos todas las observaciones deberían de quedar sin efecto.

Nos podrían confirmar una vez que este disponible nuevamente el reporte para validarlo?

Muchas gracias desde ya.

Saludos cordiales.

Larissa Duré

Control Interno

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM
SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

Enviado el: martes, 3 de diciembre de 2024 12:56

Para: Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Alma Fernandez

alma.fernandez@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

CC: SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>

Asunto: ANEXO H TICKET #282291

Buenas tardes

Adjunto un resumen de lo hablado en la reunión de esta mañana en conjunto con BW, estuvimos en la reunión Luis Sartorio, Paola Romay, Martin Vila.

Si pueden ingresar al **Ticket Nro. 282291**, podrán verificar los puntos tratados y lo que está pendiente.

En general el inconveniente eran Parámetros y carga de Datos que faltaban, también queda pendiente verificar la migración de ciertos títulos y completar correctamente

los puntajes en las calificaciones de riesgos.

Todo esto afecta directamente en la generación de datos del Anexo H.

Cualquier duda, podemos conversarlo, saludos.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM



Alma Fernandez posted 11/28/24, 6:35 PM

Buenas tardes Paola,

Derivada la consulta al area de mesa de trading,

Tengo retorno de los mismos y te lo hago saber,

Muchas gracias desde ya!



Jose Meza posted 12/3/24, 12:47 PM

Buenas tardes, confirmo que tuvimos una reunion por Teams con Paola Romay, Martin Vila y Luis Sartorio, donde se corrigieron parametros del sistema el punto 1. Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB, se procedio a cargar los datos en "Company Name", punto 10. Balance Type excluir del reporte, se actualizo el template en Casa De Bolsa Corex, se verifico "Asset Risk Types", para pyC donde se corrigio el puntaje de 0 a 1, (Pendiente verificar y corregir los demas Tipos de Riesgos), en el parametro "Issuers" se erifico el valor correspondiente a MINISTERIO DE HACIENDA 34, MINISTERIO DE ECONOMIAS Y FINANZAS 91, BANCO CENTRAL 60, esto se coloco en el parametro del Anexo H para que traiga correctamente la descripoion. Punto 11 BW solicitaron que se les envie la Resolucion Normativa. Punto 13 esta mal cargado o migrado el valor del campo Country, se remplazo PY por EEUU, (Habria que verificar planilla de Migracion con Julio Martinez).

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

image002.png (13.6 kb)

image002.png (54 kb)

ANEXO H 03.12 VALIDACIONES AL 04.12.xlsx (84.1 kb)

12/5/24, 11:05 AM Jose Meza 25 at 2:26 PM

Buen día Alma, Luis y Julio

Estuve investigando y revisando los manuales de BW, y puedo aportar soluciones para los siguientes puntos observados:

1. Falta de número de RUC para ciertos títulos:

El problema radica en la ausencia de datos en los parámetros de *Issuer* en **Corex**. Adjunto capturas de pantalla que muestran los datos faltantes y cómo se visualizan actualmente.

2. Calificación de riesgo: solo mostrar las letras (sin agregar "> 1 año"):

En los parámetros de **Asset Risk Types**, actualmente se cargan valores como /

Propongo que coordinemos una reunión breve, de unos **30 minutos**, en la sala de reuniones para abordar estos puntos y avanzar con las correcciones necesarias.

Quedo a la espera de su confirmación.

Saludos

Brokerware OPS X

Issuer - ZETA BANCO S.A.E.C.A.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

96

Name

ZETA BANCO S.A.E.C.A.

Issuer Type Id

Estado y Entidades publicas

Document

Economic Group Id

Balance Assets

0,00

Currency Id

Issuer - G.P.S.A.E.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

52

Name

G.P.S.A.E.

Issuer Type Id

Sector Privado

Document

Economic Group Id

Balance Assets



Issuer - BRICAPAR S.A.E.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

82

Name

BRICAPAR S.A.E.

Issuer Type Id

Estado y Entidades publicas

Document

[REDACTED]

Economic Group Id

Asset Risk Types



No filters are applied

Type Desc

--

AA+py

AApy

AA-py

A+py

Apy

A-py / < 1 año

BBB+py

BBBpy

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

De: Alma Fernández

Enviado el: jueves, 5 de diciembre de 2024 09:50

Para: Tickets Brokerware

CC: Jose Meza ; Mesa de Trading ; Luis Sartorio ; SoporteTI ; Julio Martinez

Asunto: RV: ANEXO H TICKET #282291

Buenos días Estimados

En adjunto las validaciones del anexo H al 04/12

Saludos!

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>

Enviado el: miércoles, 4 de diciembre de 2024 12:33 p. m.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Para: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio
luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

CC: SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Alma Fernandez
alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H TICKET #282291

Buenos días a todos,

Espero se encuentren muy bien,

Adjunto van las observaciones del cruce entre Anexo H BW Vs archivo enviado por Mesa de Dinero de fecha 03/12. Entendemos que una vez subsanados los puntos todas las observaciones deberían de quedar sin efecto.

Nos podrían confirmar una vez que este disponible nuevamente el reporte para validarlo?

Muchas gracias desde ya.

Saludos cordiales.

Larissa Duré

Control Interno

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Asunción, Paraguay

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

De: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

Enviado el: martes, 3 de diciembre de 2024 12:56

Para: Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Alma Fernandez

alma.fernandez@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

CC: SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>

Asunto: ANEXO H TICKET #282291

Buenas tardes

Adjunto un resumen de lo hablado en la reunión de esta mañana en conjunto con BW, estuvimos en la reunión Luis Sartorio, Paola Romay, Martin Vila.

Si pueden ingresar al **Ticket Nro. 282291**, podrán verificar los puntos tratados y lo que está pendiente.

En general el inconveniente eran Parámetros y carga de Datos que faltaban, también queda pendiente verificar la migración de ciertos títulos y completar correctamente

los puntajes en las calificaciones de riesgos.

Todo esto afecta directamente en la generación de datos del Anexo H.

Cualquier duda, podemos conversarlo, saludos.



Alma Fernandez posted 11/28/24, 6:35 PM

Buenas tardes Paola,

Derivada la consulta al area de mesa de trading,

Tengo retorno de los mismos y te lo hago saber,

Muchas gracias desde ya!



Jose Meza posted 12/3/24, 12:47 PM

Buenas tardes, confirmo que tuvimos una reunion por Teams con Paola Romay, Martin Vila y Luis Sartorio, donde se corrigieron parametros del sistema el punto 1. Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB, se procedio a cargar los datos en "Company Name", punto 10. Balance Type excluir del reporte, se actualizo el template en Casa De Bolsa Corex, se verifico "Asset Risk Types", para pyC donde se corrigio el puntaje de 0 a 1, (Pendiente verificar y corregir los demas Tipos de Riesgos), en el parametro "Issuers" se erifico el valor correspondiente a MINISTERIO DE HACIENDA 34, MINISTERIO DE ECONOMIAS Y FINANZAS 91, BANCO CENTRAL 60, esto se coloco en el parametro del Anexo H para que traiga correctamente la descripcion. Punto 11 BW solicitaron que se les envie la Resolucion Normativa. Punto 13 esta mal cargado o migrado el valor del campo Country, se remplazo PY por EEUU, (Habria que verificar planilla de Migracion con Julio Martinez).

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

image002.png (13.6 kb)
image002.png (54 kb)
ANEXO H 03.12 VALIDACIONES AL 04.12.xlsx (84.1 kb)
image003.png (51.7 kb)

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

image005.png (40.8 kb)

image001.png (28.5 kb)

12/5/24, 11:15 AM Alma Fernandez

Buenos días Jose!

Estoy haciendo home, me uno por teams sin problemas

Saludos,

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza

Enviado el: jueves, 5 de diciembre de 2024 10:55 a. m.

Para: Alma Fernandez ; Tickets Brokerware

CC: Mesa de Trading ; Luis Sartorio ; SoporteTI ; Julio Martinez

Asunto: RE: ANEXO H TICKET #282291

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Buen día Alma, Luis y Julio

Estuve investigando y revisando los manuales de BW, y puedo aportar soluciones para los siguientes puntos observados:

1. Falta de número de RUC para ciertos títulos:

El problema radica en la ausencia de datos en los parámetros de *Issuer* en **Corex**. Adjunto capturas de pantalla que muestran los datos faltantes y cómo se visualizan actualmente.

2. Calificación de riesgo: solo mostrar las letras (sin agregar "> 1 año"):

En los parámetros de **Asset Risk Types**, actualmente se cargan valores como /

Propongo que coordinemos una reunión breve, de unos **30 minutos**, en la sala de reuniones para abordar estos puntos y avanzar con las correcciones necesarias.

Quedo a la espera de su confirmación.

Saludos

☰ Brokerware OPS X

Issuer - ZETA BANCO S.A.E.C.A.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

96

Name

ZETA BANCO S.A.E.C.A.

Issuer Type Id

Estado y Entidades publicas

Document

[REDACTED]

Economic Group Id

Balance Assets

0,00

Currency Id

Issuer - G.P.S.A.E.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

52

Name

G.P.S.A.E.

Issuer Type Id

Sector Privado

Document

[REDACTED]

Economic Group Id

Balance Assets



Issuer - BRICAPAR S.A.E.

« Issuers

GENERAL

ASSETS

Id

82

Name

BRICAPAR S.A.E.

Issuer Type Id

Estado y Entidades publicas

Document

[REDACTED]

Economic Group Id

Asset Risk Types



No filters are applied

Type Desc

--

AA+py

AApy

AA-py

A+py

Apy

A-py / < 1 año

BBB+py

BBBpy

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

De: Alma Fernández alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Enviado el: jueves, 5 de diciembre de 2024 09:50

Para: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading

mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; SoporteTI

SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

Asunto: RV: ANEXO H TICKET #282291

Buenos días Estimados

En adjunto las validaciones del anexo H al 04/12

Saludos!

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

De: Larissa Duré larissa.dure@sudameriscb.com.py>

Enviado el: miércoles, 4 de diciembre de 2024 12:33 p. m.

Para: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

CC: SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H TICKET #282291

Buenos días a todos,

Espero se encuentren muy bien,

Adjunto van las observaciones del cruce entre Anexo H BW Vs archivo enviado por Mesa de Dinero de fecha 03/12. Entendemos que una vez subsanados los puntos todas las observaciones deberían de quedar sin efecto.

Nos podrían confirmar una vez que este disponible nuevamente el reporte para validarlo?

Muchas gracias desde ya.

Saludos cordiales.

Larissa Duré

Control Interno

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

Enviado el: martes, 3 de diciembre de 2024 12:56

Para: Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Alma Fernandez

alma.fernandez@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>

CC: SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>

Asunto: ANEXO H TICKET #282291

Buenas tardes

Adjunto un resumen de lo hablado en la reunión de esta mañana en conjunto con BW, estuvimos en la reunión Luis Sartorio, Paola Romay, Martin Vila.

Si pueden ingresar al **Ticket Nro. 282291**, podrán verificar los puntos tratados y lo que está pendiente.

En general el inconveniente eran Parámetros y carga de Datos que faltaban, también queda pendiente verificar la migración de ciertos títulos y completar correctamente

los puntajes en las calificaciones de riesgos.

Todo esto afecta directamente en la generación de datos del Anexo H.

Cualquier duda, podemos conversarlo, saludos.



Alma Fernandez posted 11/28/24, 6:35 PM

Buenas tardes Paola,

Derivada la consulta al area de mesa de trading,

Tengo retorno de los mismos y te lo hago saber,

Muchas gracias desde ya!



Jose Meza posted 12/3/24, 12:47 PM

Buenas tardes, confirmo que tuvimos una reunion por Teams con Paola Romay, Martin Vila y Luis Sartorio, donde se corrigieron parametros del sistema el punto 1. Encabezado incompleto en nombre y RUC de la CB, se procedio a cargar los datos en "Company Name", punto 10. Balance Type excluir del reporte, se actualizo el template en Casa De Bolsa Corex, se verifico "Asset Risk Types", para pyC donde se corrigio el puntaje de 0 a 1, (Pendiente verificar y corregir los demas Tipos de Riesgos), en el parametro "Issuers" se erifico el valor correspondiente a MINISTERIO DE HACIENDA 34, MINISTERIO DE ECONOMIAS Y FINANZAS 91, BANCO CENTRAL 60, esto se coloco en el parametro del Anexo H para que traiga correctamente la descripcion. Punto 11 BW solicitaron que se les envie la Resolucion Normativa. Punto 13 esta mal cargado o migrado el valor del campo Country, se remplazo PY por EEUU, (Habria que verificar planilla de Migracion con Julio Martinez).

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

12/10/24, 4:37 PM Alma Fernandez 2:26 PM

Buenas tardes Sres,

Les paso las diferencias del reporte.

En adjunto las validaciones del anexo H al 04/12

Saludos

ANEXO H 03.12 VALIDACIONES AL 04.12.xlsx (84.1 kb)

12/11/24, 9:54 AM Lucia Molinolo

Estimados, cómo están?

Vemos que los puntos que mencionan son los mismos que ya fueron respondidos anteriormente.
Entiendo que con Pao y Martín estuvieron viendo esto via call.

Les pedimos por favor que realicen las configuraciones pertinentes (mencionadas en el primer mensaje) antes de volver a validar el reporte.

El reporte refleja la información cargada en el sistema, por lo que si la info que tienen es incorrecta, esos errores se replicaran en el Anexo H.

Aguardamos comentarios luego de que realicen las configuraciones.

Saludos,
Lucía

12/11/24, 10:35 AM Alma Fernandez 26 PM

Buenos días Estimados

Favor tener en cuenta lo mencionado más debajo de manera a que el ANEXO H generado desde el sistema pueda reflejar la información correcta

Saludos.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware

Enviado el: miércoles, 11 de diciembre de 2024 09:54 a. m.

Para: Alma Fernandez

CC: Jose Meza ; Julio Martinez ; Luis Sartorio ; Mesa de Trading ; SoporteTI

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

12/16/24, 10:04 AM Andres Mouriño 26 PM

Alma, como estás?

En el primer mensaje Paola detallo todas las correcciones que deben realizarse en el sistema previo a realizar una nueva validación, queremos confirmar si chequearon los 14 puntos que se explicaron anteriormente.

Deberían ver en conjunto con el equipo de la Mesa de Operaciones y también con IT para hacer cambios en CoreX.

Quedamos a disposicion por cualquier consulta.

Saludos,
Andrés

12/16/24, 10:25 AM Alma Fernandez

Muchas gracias Andres.

Estimados Equipos

Favor validar lo solicitado en la brevedad posible

Saludos

Alma Fernández

Auditoria Interna

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

SUDAMERIS SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware

Enviado el: lunes, 16 de diciembre de 2024 10:04 a. m.

Para: Alma Fernandez

CC: Jose Meza ; Julio Martinez ; Larissa Dure ; Luis Sartorio ; Mesa de Trading ; SoporteTI

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

12/16/24, 11:05 AM Juan Moran

Hola Alma, con mi usuario solo puedo ver 5 tickets en el sistema de BW, no tengo acceso al #282291, pero quedamos atentos a si desde Operaciones pueden ver el ticket las instrucciones que debamos realizar.

Saludos

Tickets



Showing 1 - 5 of 5 Open Tickets

Ticket #	Create Date	Status	Subject	Department
160120	12/13/24	Open	Auditoria BW de Cuentas	Support
457751	12/13/24	Open	Personas Juridicas sin correo	Support
366713	12/11/24	X - Para cerrar	LISTADO DE CUENTAS BANCARIAS DE CLIENTES	Support
366363	12/10/24	X - Para cerrar	Ajustes en el Reporte Dinamico RescatesdeClientes	Support
697501	11/25/24	Open	OE Eliminar las entidades que no aplican	Development

Héctor Morán

Infraestructura TI

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 982 779 503

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez

Enviado el: lunes, 16 de diciembre de 2024 10:23

Para: Tickets Brokerware ; Julio Martinez ; Jose Meza ; Luis Sartorio

CC: Larissa Dure ; Mesa de Trading ; SoporteTI ; Operaciones

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Muchas gracias Andres.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Estimados Equipos

Favor validar lo solicitado en la brevedad posible

Saludos

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>

Enviado el: lunes, 16 de diciembre de 2024 10:04 a. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

12/16/24, 11:10 AM Lucia Molinolo

Buenas Héctor, cómo estás?

Ahí te di acceso a todos los tickets.

Saludos,
Lucía

12/16/24, 11:22 AM Juan Moran

Buenas, estuve dando lectura a los mensajes y veo que Jose, Mesa de Dinero y BW tuvieron una call sobre esto y se ejecutaron todos los pasos.

Jose no esta hoy por la oficina y tampoco mañana.

Si me indican especificamente que hay que configurar lo realizo, pero entiendo que todos los pasos de configuracion ya fueron realizados por Jose.

Quedo atento.

Saludos

12/16/24, 11:37 AM Jose Meza

Buen dia Alma

Como te habia comentado anteriormente y tambien respondido en este ticket, necesitamos que indiquen a TI, los datos faltantes, para poder configurar en CoreX.

En Issuers falta llenar con el RUC de cada entidad, en Asset Risk Types, eliminar lo que no debe mostrarse ejemplo "este miercoles 18/12 y podemos completar los datos faltantes si nos sentamos 30 minutos.

12/19/24, 11:07 AM Martin Vila at 2:26 PM

Buen dia estimados, como estan?

Pudieron realizar los ajustes correspondientes relacionados al Anexo H? Si precisan ayuda estamos atentos.

Saludos,
Martin

12/19/24, 2:25 PM Alma Fernandez

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM
Buenas tardes Estimados

En el adjunto lo que estuvimos viendo en la reunión, ya con el responsable de cada área para modificar en el sistema.

Saludos Cordiales.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 11:07 a. m.

Para: Alma Fernandez

CC: Jose Meza ; Juan Moran ; Julio Martinez ; Larissa Dure ; Luis Sartorio ; Mesa de Trading ; Operaciones ; SoporteTI

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

image002.png (13.6 kb)

Attachment: Observaciones AL 24122024.xlsx (84.6 kb)

12/24/24, 3:35 PM Jose Meza

Buenas tardes Alma / Larissa

En adjunto se encuentra una Planilla Excel **"Asset Risk Types_24122024"**, en la misma se encuentran las calificaciones de Riesgo donde solicitan que se eliminen aquellos registros

que se encuentran duplicados hoy en día, y tienen el mismo puntaje. Estos registros están marcados en **amarillo**.

También están los registros pendientes de modificar eliminando las "**\ y \>1 año**", **Estos registros están marcados en celeste**.

Y por ultimo se encuentran los registros marcados en color **verde** donde nos tienen que definir cual de ellos se elimina y también cuál de ellos se modifica.

Aguardo tus comentarios y confirmación para proceder, también más abajo se encuentra el detalle de los puntos solucionados, saludos.

60	Observaciones					
61	1.No figura el numero de RUC para los siguientes titulos:		TI			
62	PYGPE01F3996	SOLUCIONADO	TI			
63	PYGPE05F5112	SOLUCIONADO	TI			
64	PYGPE03F4018	SOLUCIONADO	TI			
65	PYBRI02F2889	SOLUCIONADO	TI			
66	TSRY55823597	SOLUCIONADO	TI			
67	2.Calificacion de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo no agregar, /> 1 año)		TI		PENDIENTE DE CONFIRMACION DE LA PLANILLA ENVIADA	

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 14:19

Para: Tickets Brokerware ; Julio Martinez ; Luis Sartorio ; Joaquin Rolon ; Jose Meza

CC: Juan Moran ; Larissa Dure ; Mesa de Trading ; Operaciones ; SoporteTI

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Estimados

En el adjunto lo que estuvimos viendo en la reunión, ya con el responsable de cada área para modificar en el sistema.

Saludos Cordiales.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 11:07 a. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>;

Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure

larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Mesa de

Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>;

SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

image002.png (13.6 kb)

image002.png (20.8 kb)

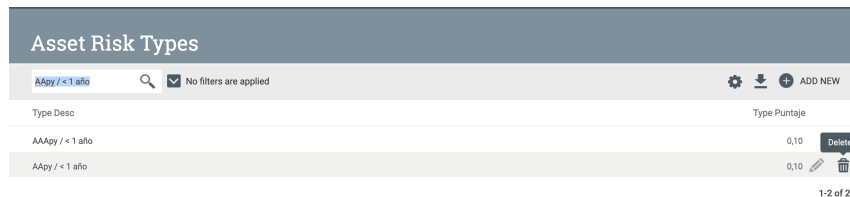
Asset Risk Types_24122024.xlsx (10.3 kb)

12/24/24, 3:55 PM Martin Vila 5 at 2:26 PM

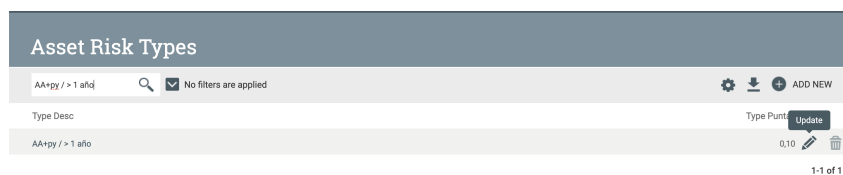
Buen dia Alma, como estas?

Eso se hace desde el Corex, en la seccion Asset Risk Types, para esto deberias comunicarte con Jose.

Para borrar una, buscas la que quieras y le das al icono de Delete como muestra la imagen.



Para editar una buscas la que quieras, y le das al icono del lapiz.



Saludos,
Martin.

Captura de pantalla 2024-12-24 a la(s) 15.51.59.png (124.3 kb)
Captura de pantalla 2024-12-24 a la(s) 15.52.36.png (118.7 kb)
Captura de pantalla 2024-12-24 a la(s) 15.54.20.png (107.9 kb)

12/26/24, 2:55 PM Alma Fernandez

Buenas tardes Jose

Favor avanzar en base a la reunión que mantuvimos con Romina en donde se valido el paso a paso

[@Julio Martinez/](#) [@Luis Sartorio](#) Favor realizar los cambios solicitados en el Excel, sin esas modificaciones BW no puede hacer mucho

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Saludos.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza

Enviado el: martes, 24 de diciembre de 2024 03:28 p. m.

Para: Alma Fernandez ; Tickets Brokerware ; Julio Martinez ; Luis Sartorio ; Joaquin Rolon

CC: Juan Moran ; Larissa Dure ; Mesa de Trading ; Operaciones ; SoporteTI

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Alma / Larissa

En adjunto se encuentra una Planilla Excel "**Asset Risk Types_24122024**", en la misma se encuentran las calificaciones de Riesgo donde solicitan que se eliminen aquellos registros

que se encuentran duplicados hoy en día, y tienen el mismo puntaje. Estos registros están marcados en **amarillo**.

También están los registros pendientes de modificar eliminando las "**\ y \>1 año**", **Estos registros**

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Y por ultimo se encuentran los registros marcados en color verde donde nos tienen que definir cual de ellos se elimina y también cuál de ellos se modifica.

Aguardo tus comentarios y confirmación para proceder, también más abajo se encuentra el detalle de los puntos solucionados, saludos.

60	Observaciones						
61	1.No figura el numero de RUC para los siguientes titulos:					TI	
62	PYGPE01F3996	SOLUCIONADO				TI	
63	PYGPE05F5112	SOLUCIONADO				TI	
64	PYGPE03F4018	SOLUCIONADO				TI	
65	PYBRI02F2889	SOLUCIONADO				TI	
66	TSRY55823597	SOLUCIONADO				TI	
67	2.Calificacion de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo no agregar, /> 1 año)					TI	PENDIENTE DE CONFIRMACION DE LA PLANILLA ENVIADA

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 14:19

Para: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM
jufo.martinez@sudameriscb.com.py; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py; Joaquin Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py; Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py
CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py
Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Estimados

En el adjunto lo que estuvimos viendo en la reunión, ya con el responsable de cada área para modificar en el sistema.

Saludos Cordiales.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 11:07 a. m.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Para Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

12/26/24, 4:55 PM Alma Fernandez

Muchas gracias Jose!

Saludos!

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza

Enviado el: jueves, 26 de diciembre de 2024 04:47 p. m.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM
Para: Alma Fernandez ; Tickets Brokerware ; Julio Martinez ; Luis Sartorio ; Joaquin Rolon

CC: Juan Moran ; Larissa Dure ; Mesa de Trading ; Operaciones ; SoporteTI

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Alma

Se procedió de acuerdo con lo solicitado, se eliminaron las **" / > 1 año "** y las **" / "**.

Los que quedan son porque tienen diferentes puntajes de riesgo, y no se pueden ajustar.

Adjunto Excel actualizado con los cambios realizados.

Saludos.

25	SOBERANO	1				
26	AAAp / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
27	AA+py / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
28	AA+py / > 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
29	AApy / > 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
30	AApy / < 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
31	AA-py / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
32	AA-py / > 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
33	A+py / < 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
34	A+py / > 1 año	0,2	Eliminar	Eliminado		
35	Apy / < 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
36	Apy / > 1 año	0,2	Eliminar	Eliminado		
37	A-py / > 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
38	BBB+py / < 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
39	BBB+py / > 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
40	BBBpy / < 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
41	BBBpy / > 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
42	BBB-py / > 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
43	BBB-py / > 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
44	BB+py / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
45	BB+py / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
46	BBpy / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
47	BBpy / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
48	BB-py / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
49	BB-py / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
50	AAAp	0				
51	pyBBB+	0				
52	pyBBB+py	0				
53	pyAA-	0				
54	AA-py	0				
55	A+py	0				
56	A+ py	0				
57	Apy	0				
58	pyBBB +	0				
59	pyB	0				
60	pyA	0				
61	AAA	0				
62	pyAA+ En evolución	0	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
63	pyBBB-	0				

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Enviado el: jueves, 26 de diciembre de 2024 14:45

Para: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Joaquin Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py>

CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Jose

Favor avanzar en base a la reunión que mantuvimos con Romina en donde se valido el paso a paso

[@Julio Martinez/](#) [@Luis Sartorio](#) Favor realizar los cambios solicitados en el Excel, sin esas modificaciones BW no puede hacer mucho

Saludos.

Alma Fernández

Auditoria Interna

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

SUDAMERIS SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

Enviado el: martes, 24 de diciembre de 2024 03:28 p. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>; Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Joaquin Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py>

CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Alma / Larissa

En adjunto se encuentra una Planilla Excel "**Asset Risk Types_24122024**", en la misma se encuentran las calificaciones de Riesgo donde solicitan que se eliminen aquellos registros

que se encuentran duplicados hoy en día, y tienen el mismo puntaje. Estos registros están marcados en **amarillo**.

También están los registros pendientes de modificar eliminando las "**\ y \>1 año**", **Estos registros están marcados en celeste**.

Y por ultimo se encuentran los registros marcados en color **verde** donde nos tienen que definir cual de ellos se elimina y también cuál de ellos se modifica.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Queridos colegas, para la confirmación para proceder, también más abajo se encuentra el detalle de los puntos solucionados, saludos.

60	Observaciones						
61	1.No figura el numero de RUC para los siguientes titulos:					TI	
62	PYGPE01F3996	SOLUCIONADO				TI	
63	PYGPE05F5112	SOLUCIONADO				TI	
64	PYGPE03F4018	SOLUCIONADO				TI	
65	PYBRI02F2889	SOLUCIONADO				TI	
66	TSRY55823597	SOLUCIONADO				TI	
67	2.Calificación de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo no agregar, /> 1 año)					TI	PENDIENTE DE CONFIRMACION DE LA PLANILLA ENVIADA

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 14:19

Para: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez

julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Joaquin

Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py>; Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure

larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>;

Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Buenas tardes Estimados

En el adjunto lo que estuvimos viendo en la reunión, ya con el responsable de cada área para modificar en el sistema.

Saludos Cordiales.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 11:07 a. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

12/26/24, 4:55 PM Jose Meza

Buenas tardes Alma

Se procedió de acuerdo con lo solicitado, se eliminaron las **" / > 1 año "** y las **" / "**.

Los que quedan son porque tienen diferentes puntajes de riesgo, y no se pueden ajustar.

Adjunto Excel actualizado con los cambios realizados.

Saludos.

25	SOBERANO	1				
26	AAAp / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
27	AA+py / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
28	AA+py / > 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
29	AApy / > 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
30	AApy / < 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
31	AA-py / < 1 año	0,1	Modificar	Procesado		
32	AA-py / > 1 año	0,1	Eliminar	Eliminado		
33	A+py / < 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
34	A+py / > 1 año	0,2	Eliminar	Eliminado		
35	Apy / < 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
36	Apy / > 1 año	0,2	Eliminar	Eliminado		
37	A-py / > 1 año	0,2	Modificar	Procesado		
38	BBB+py / < 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
39	BBB+py / > 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
40	BBBpy / < 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
41	BBBpy / > 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
42	BBB-py / > 1 año	0,4	Modificar	Procesado		
43	BBB-py / > 1 año	0,4	Eliminar	Eliminado		
44	BB+py / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
45	BB+py / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
46	BBpy / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
47	BBpy / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
48	BB-py / > 1 año	0,6	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
49	BB-py / < 1 año	0,8	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
50	AAAp	0				
51	pyBBB+	0				
52	pyBBB+py	0				
53	pyAA-	0				
54	AA-py	0				
55	A+py	0				
56	A+ py	0				
57	Apy	0				
58	pyBBB +	0				
59	pyB	0				
60	pyA	0				
61	AAA	0				
62	pyAA+ En evolución	0	Consultar	No se modifica, solo se ajusta en el reporte		
63	pyBBB-	0				

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez

Enviado el: jueves, 26 de diciembre de 2024 14:45

Para: Jose Meza ; Tickets Brokerware ; Julio Martinez ; Luis Sartorio ; Joaquin Rolon

CC: Juan Moran ; Larissa Dure ; Mesa de Trading ; Operaciones ; SoporteTI

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Jose

Favor avanzar en base a la reunión que mantuvimos con Romina en donde se valido el paso a paso

[@Julio Martinez/](#) [@Luis Sartorio](#) Favor realizar los cambios solicitados en el Excel, sin esas modificaciones BW no puede hacer mucho

Saludos.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

Enviado el: martes, 24 de diciembre de 2024 03:28 p. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>; Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Joaquin Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py>

CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Alma / Larissa

En adjunto se encuentra una Planilla Excel "**Asset Risk Types_24122024**", en la misma se encuentran las calificaciones de Riesgo donde solicitan que se eliminen aquellos registros

que se encuentran duplicados hoy en día, y tienen el mismo puntaje. Estos registros están marcados en **amarillo**.

También están los registros pendientes de modificar eliminando las "**\ y \>1 año**", **Estos registros están marcados en celeste**.

Y por ultimo se encuentran los registros marcados en color **verde** donde nos tienen que definir cual de ellos se elimina y también cuál de ellos se modifica.

Aguardo tus comentarios y confirmación para proceder, también más abajo se encuentra el detalle de los puntos solucionados, saludos.

60	Observaciones				
61	1.No figura el numero de RUC para los siguientes titulos:		TI		
62	PYGPE01F3996	SOLUCIONADO	TI		
63	PYGPE05F5112	SOLUCIONADO	TI		
64	PYGPE03F4018	SOLUCIONADO	TI		
65	PYBRI02F2889	SOLUCIONADO	TI		
66	TSRY55823597	SOLUCIONADO	TI		
67	2.Calificacion de riesgo solo colocar las letras (por ejemplo no agregar, /> 1 año)		TI	PENDIENTE DE CONFIRMACION DE LA PLANILLA ENVIADA	

José Meza

Team Leader Tecnología

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. C. Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 489-800

Asunción, Paraguay

De: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 14:19

Para: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>; Julio Martinez

julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Joaquin Rolon joaquin.rolon@sudameriscb.com.py>; Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>

CC: Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure

larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Mesa de Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>;

Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>; SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: RE: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Buenas tardes Estimados

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

En el adjunto lo que estuvimos viendo en la reunión, ya con el responsable de cada área para modificar en el sistema.

Saludos Cordiales.

Alma Fernández

Auditoria Interna

SUDAMERIS
SECURITIES

Avda. Aviadores del Chaco esq. Prof. César Vasconcellos

Planta Baja

Cel: +595 981 916-873

Asunción, Paraguay

De: Tickets Brokerware tickets@brokerware.com.uy>

Enviado el: jueves, 19 de diciembre de 2024 11:07 a. m.

Para: Alma Fernandez alma.fernandez@sudameriscb.com.py>

CC: Jose Meza jose.meza@sudameriscb.com.py>; Juan Moran juan.moran@sudameriscb.com.py>;

Julio Martinez julio.martinez@sudameriscb.com.py>; Larissa Dure

larissa.dure@sudameriscb.com.py>; Luis Sartorio luis.sartorio@sudameriscb.com.py>; Mesa de

Trading mesadetrading@sudameriscb.com.py>; Operaciones operaciones@sudameriscb.com.py>;

SoporteTI SoporteTI@sudameriscb.com.py>

Asunto: Re: ANEXO H fecha 25.11 validado nuevamente al 27.11 [#282291]

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

image002.png (13.6 kb)

image002.png (20.8 kb)

image003.png (65.6 kb)

Asset Risk Types_24122024.xlsx (10.6 kb)

5/27/25, 1:31 PM Lucia Molinolo

Estimados, cómo están?

Queda algo pendiente de nuestro lado sobre esto?

Quedo atenta por si hay algo en lo que podamos ayudarlos.

Saludos,

Lucía

5/27/25, 2:42 PM Jose Meza

Buenas tardes Lucia, estamos gestionando de nuestra parte la verificación de datos del "Asset Risk Types" en CoreX, debido a que tenemos registros duplicados y con puntajes diferentes, este proceso lo estamos verificando en compañía de Alan Rosa.

6/18/25, 1:15 PM Alan Rosa

Buenas! ya se realizó el ajuste, quedamos a la espera de las pruebas de los usuarios.

8/26/25, 7:47 AM Alan Rosa

Buenas, dejo lo que avanzamos por Mail

natalia Ortega reportó lo siguiente:

1° - la mesa hoy día no puede sacar el anexo h de BW, solo OPS puede, en ese caso necesitaríamos que en la parte de reportes nos añadan en el perfil de TRADER el reporte de anexo H como tal.

2° - Las acciones cartulares del banco continental que entraron en cartera en junio, las tenemos que

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Reportar una por una, ya al no tener tasa, tampoco cuenta con los siguientes datos que son, fecha de vencimiento, plazo residual, tasa nominal ni variación en valor compra ni valor contable, adjunto imagen más abajo de como las estamos reportando hoy día.



En ese caso habría que ver las cargas en BW para esta parte para que en un futuro saque como te estaría indicando.

3°- los nombres de emisores con sus RUC deben estar como lo indica la DNIT (AGENTE FISCAL). (habría que revisar cada cierto tiempo si eso tiene cambios)

4°- las calificaciones de riesgo deben ir deben tener el siguiente formato respetando el siguiente orden: (AA+py, AA-py, Cpy, AA+py)

5°- hay series de CDAS que salen en el anexo hoy día de BW y no tenemos en cartera, ahí apelo al control de OPS para que nos ayuden con ese tema también.

6°- todas las Asset de los bonos ya sea usd o pyg hay que volver a revisarlas (mas aun las migradas) para saber si el valor presente esta calculando correctamente y por ende los otros valores (valor compra, valor contable, valor mercado) , OPS favor ayudarnos con esa parte también ya que no son muchas las Asset migradas que estamos reportando al día de hoy.

7° - las Asset de certificados de deposito, debe ser "Certificado de depósitos de ahorro", es ese el nombre del "tipo valor" en el anexo.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

Las ponderaciones de riesgo para los CDAs debe ser 0 y por ende no tienen valor ponderado por riesgo. También observo que hay cdas que en cantidad saca 2, y en realidad por serie de CDA se pone la cantidad (ósea siempre debe ser 1)

mi respuesta a estos puntos:

Respecto a los puntos mencionados, les comento lo siguiente:

1. **Disponibilidad de funcionalidad:** Este cambio requiere ajustes a nivel de código, por lo que podríamos incluirlo en los próximos paquetes de actualización.
2. **Mapeo de títulos al flujo del sistema:** Es necesario definir cómo se mapearán estos títulos dentro del flujo actual. Si les parece, podemos coordinar una reunión con los analistas de BW para establecer esto correctamente, de forma que luego podamos representarlos de manera automática en el reporte.
3. **Listado con RUC:** ¿Podrías facilitarnos la lista correspondiente con sus respectivos RUC? Con [@Jose Meza](#) nos encargamos de realizar las actualizaciones necesarias.
4. **Repair de riesgos:** Esta corrección ya había sido aplicada en el entorno de pruebas, pero fue sobrescrita. Procederemos a aplicar nuevamente el *repair* de los riesgos y te avisamos para que lo valides antes de aplicarlo en producción.
5. **Casos específicos:** ¿Podrías compartirnos ejemplos concretos de los casos que mencionás?
6. **Validación desde OPS:** Por favor, indiquen si podemos colaborar en la validación de este punto en conjunto a OPS.
7. **Ajustes con validación:** Realizamos el ajuste correspondiente con José. Te notificamos cuando esté listo para que puedas validarlo y avanzar a producción.

Ponderaciones de riesgo y cantidades cda : También realizaremos este ajuste con José. Te avisamos para que valides y podamos proceder con el paso a producción.

1. Luego de esto se ajustó en QA lo siguiente
2. update issuer set IssuerName='TELEF. CELULAR DEL PARAGUAY SAE (TELECEL SAE)' where IssuerName='TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY S.A.E. (TELECEL SAE)'
3. update issuer set IssuerName='NUCLEO SA' where IssuerName='NUCLEO S.A.'
4. update parameters set
ParameterCharacterValueLong='{ "SubAssetClass": [{"key":8,"value":"0"}, {"key":2,"value":"1"}], Issuer': [{"key":60,"value":"0.10"}, {"key":34,"value":"0.10"}, {"key":76,"value":"0.10"}]}'

Wednesday, September 17, 2025 at 2:26 PM

6. update SubAssetClass set SubAssetClassName='Certificado de depósitos de ahorro'
7. where SubAssetClassId=8

Del lado de bw queda pendiente el punto 1 de agregar el reporte a trader pero el mismo ya estaría disponible para descargar desde ops y validar su contenido

quedo atento a sus comentarios a modo de cerrar este ticket

normalizacion riesgos.sql (7.1 kb)