

Ticket #523014 at 2:19 PM

Status X - Consulta **Name** Julio Martinez

Priority High Email julio.martinez@sudameriscb.com.py

Department Support **Phone**

Create Date 4/8/25, 4:25 PM Source Web

Ticket Details

Urgency: Tarea detenida

Asset CDA-First coupon/dividend date (Secundario)

4/8/25, 4:25 PM Julio Martinez

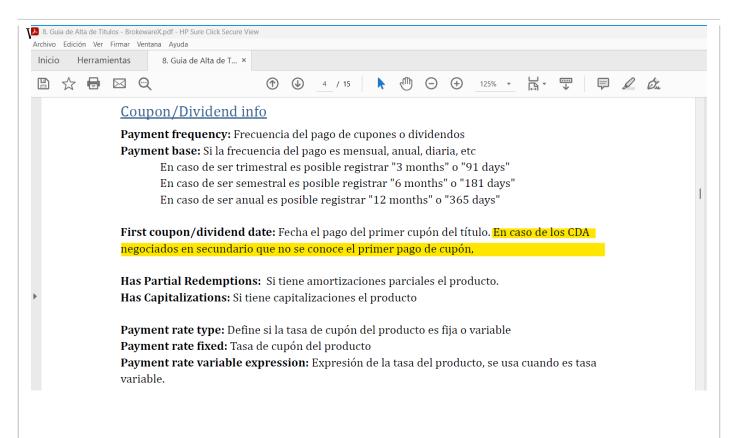
Buenas tardes Estimados,

Tenemos una duda respecto al apartado Structure de Assets, especificamente para CDAs y el campo "First coupon/dividend date".

Hay casos de operaciones en secundario donde no poseemos la proforma con el detalle payments y por ende solamente tenemos el dato del proximo cupon a vencer. Como se registra el campo "First coupon/dividend date" para este tipo de casos? Se agrega el proximo cupon a vencer?

En meses anteriores hemos recibido la Guia para Alta de Titulos pero justamente en la parte donde menciona esta particularidad no posee información:





Saludos

4/8/25, 6:02 PM Martin Vila

Buenas tardes Julio, espero que te encuentres bien.

Para el caso de CDAs negociados en el mercado secundario, en el campo **First coupon** se debe ingresar la siguiente fecha del próximo pago de cupón posterior a la fecha de compra, en el campo **Issuance date** se debe ingresar la última fecha de pago de cupón.

Si te queda alguna consulta estamos atentos por cualquier cosa. A su vez adjunto el nuevo documento con la frase completa, te pedimos disculpa por el error en el documento.

Saludos,

Martin.

8. Guia de Alta de Titulos - BrokewareX.pdf (1.8 mb)



4/8/25, 7:06 PM Julio Martinez 5 at 2:19 PM

Buenas Martin, gracias por la pronta respuesta.

La unica duda que nos queda para los casos en secundario es que indicaste lo siguiente "en el campo Issuance date se debe ingresar la última fecha de pago de cupón".

Entonces, a modo de ejemplo, supongamos que compramos (Posición Propia) en secundario un CDA con las siguientes caracteristicas:

- Fecha de Emision: 03/07/2024

- Periodicidad de pago de cupones: Mensual

- Fecha de Vencimiento del titulo (Maturity): 03/07/2025

- Fecha de compra en secundario: 19/03/2025

- Detalle de cupones/payments:

Cupon Nro	Fecha	Importe
1	1/8/2024	30,21
2	2/9/2024	32,22
3	30/9/2024	28,19
4	30/10/2024	30,21
5	29/11/2024	30,21
6	30/12/2024	31,21
7	28/1/2025	29,2
8	27/2/2025	30,21
Comprado por Posicion Propia el 19/03/2025		
9	31/3/2025	32,22
10	28/4/2025	28,19
11	28/5/2025	30,21
12	3/7/2025	36,25



Wood pandon mentercolorial Mos ୧୦୬୭ ୩ ୩ ୭ ଅଧିକ ପିଳି t ଓ Mark los cupones a vencer, es decir desde el cupon nro 9 al cupon nro 12.

Entonces, cómo cargaríamos en el sistema (menu Asset/Structure) los siguientes campos? (favor agregar datos a continuación conforme al ejemplo):

- Issuance date:
- Maturity date:
- First coupon/dividend date:

Desde ya muchas gracias Saludos

4/9/25, 3:30 PM Martin Vila

Buenas tardes Julio.

En ese caso para que el sistema haga los cálculos de forma correcta, lo ideal seria que se averigüe cual es la ultima fecha de pago de cupón antes de la fecha de compra con el emisor o quien corresponde, sino en caso contrario es imposible que el sistema haga los respectivos calculos.

Saludos.

Martin.