

Wednesday, September 17, 2025 at 2:19 PM

Ticket #103960

Status	Open	Name	Julio Martinez
Priority	Emergency	Email	julio.martinez@sudameriscb.com.py
Department	Support	Phone	
Create Date	4/22/25, 2:28 PM	Source	Web

Ticket Details

Urgency: Trabajo detenido

Ajustes al Reporte REGISTE OTC OPERATIONS

4/22/25, 2:28 PM Julio Martinez at 2:19 PM

Estimados,

Respecto al ticket cerrado #701036, denominado "REGISTRO OTC PLANILLA EXTRABURSATIL", identificamos que desde la semana pasada se desconfiguraron parámetros ya establecidos tales como:

- 1) "Fecha Valor" para casos de Cancelaciones de Repo (Fecha de Settlement de ejecución del repo). -> **Actualmente incluye incorrectamente la fecha de vencimiento.**
- 2) "TIR" para casos de Tipo de Mercado "REPO" = Tasa del Asset subyacente. -> **Actualmente incluye el campo con valor 0.**

Adicionalmente incluimos otros nuevos ajustes requeridos, todos los casos se encuentran resaltados en colores y descriptos en el archivo adjunto.

- a) Tipo de Mercado: Cambiar "REPO" por "REPORTO".
- b) Casos incorrectamente indicados como mercado "PRIMARIO" debiendo ser "SECUNDARIO".
- c) La comision debe ser el % en tanto por 1.
- d) El campo "Valor negociado" debe estar formulado.
- e) En el Enunciado, donde se indica la Casa de Bolsa favor indicar por defecto "SUDAMERIS SECURITIES CASA DE BOLSA S.A." en lugar de "Sudameris Casa de Bolsa".

Desde ya muchas gracias

11.04 0_RegisteOTCOperationsN0322560-0-0.xlsx (98.6 kb)

4/22/25, 3:58 PM Martin Vila 25 at 2:19 PM

Buenas tardes Julio, como estas?

Para los dos primeros puntos donde mencionas que se desconfiguraron la Fecha Valor y la TIR para los repos, los parámetros tanto el **OTC_USE_SETTLEMENT_DATE_MATUR_y** **OTC_TIR_ASSET_PAYMENT_RATE** deben estar con valor numérico en 1 para que la Fecha Valor de las cancelaciones traiga la fecha settlement de ejecución del REPO, y para que la TIR del REPO traiga la tasa del activo subyacente del REPO.

Con respecto a los demás puntos mencionados, trabajamos en solucionar los casos correspondientes a los **puntos A B C y E**. Por ultimo del **punto D** podrían revisar si el reporte ya realiza el correspondiente calculo?

Aguardamos tu respuesta.

Saludos,

Martin.

4/22/25, 4:39 PM Julio Martinez

Buenas Martin,

La parametrización con valor numerico 1 para **OTC_USE_SETTLEMENT_DATE_MATUR_y** **OTC_TIR_ASSET_PAYMENT_RATE** se debe realizar en CoreX?

En cuanto al punto D, el reporte realiza correctamente el calculo, sin embargo el Regulador precisa que dicho campo se incluya con la formula.

Si bien de igual forma finalmente se visualiza el importe, dicho campo debe contener la formula, no directamente el monto.

A- IV Consistencia de columnas

(i) Valor Negociado

* El valor registrado en el campo "Valor Negociado" deber ser el resultado del producto de: $((\text{Precio} * \text{Valor nominal} * \text{Cantidad}) / 100)$.

Saludos

4/22/25, 5:48 PM Martin Vila 25 at 2:19 PM

Julio gracias por la respuesta.

Si se debe hacer desde el Corex de CBSA y Fondos.

Con respecto al último punto, revisamos con el equipo si es posible hacer lo mencionado.

Saludos,
Martin

4/23/25, 1:32 PM Alan Rosa 025 at 2:19 PM

Julio como estas?

Te respondo por puntos:

Punto A: Queda pendiente del lado de BW, ya nos encontramos realizando y validando el cambio.

Punto B: Nos podrian indicar por que trading route fueron ejecutadas dichas operaciones y como esta configurada la misma? El reporte extrae el dato de tipo de mercado segun la trading route donde se ejecuta la operacion (en trader).

Punto C: Desde el modulo **Corex** (solicitar ayuda a jose o hector) verificar que el parametro **CampoComisionReporteN03** tenga en su valor numerico 1.

Punto D: Esto no es posible, ya que el sistema lo calcula de manera previa a la generacion del reporte y no permite el uso de formulas directo en el excel.

Punto E: Desde el modulo **Corex** (solicitar ayuda a jose o hector) verificar que el parametro **CompanyName** tenga en su value long el valor deseado.

Avanzamos con el punto A y quedamos a las ordenes por cualquier otra duda en los otros puntos.

Saludos!

Alan.

4/28/25, 12:40 PM Alan Rosa 25 at 2:19 PM

Estimados como estan?

Segun lo conversado de manrea presencial paso la actualizacion de los siguientes puntos:

Punto D: Esto no es posible, ya que el sistema lo calcula de manera previa a la generacion del reporte y no permite el uso de formulas directo en el excel.

Se tuvo una llamada con el regulador y segun lo conversado no es necesario, por lo que el pedido queda sin efecto

1) "Fecha Valor" para casos de Cancelaciones de Repo (Fecha de Settlement de ejecucion del repo). -> Actualmente incluye incorrectamente la fecha de vencimiento.

No aplica, se mantiene el parametro actual

Se va proceder al chequeo de los parametros para el punto 2 , c y e y posteriormente se va a validar nuevamente estos puntos.

Saludos!

Alan.

4/28/25, 12:41 PM Alan Rosa

Sobre el punto b) , verificamos que las operaciones fueron por una trading route que no correspondia

4/28/25, 2:42 PM Lucia Molinolo at 2:19 PM

Estimados, cómo están?

En el próximo paquete les enviaremos el ajuste correspondiente al punto A.

Aguardamos sus comentarios sobre el resto de los puntos que mencionó Alan en el mensaje anterior.

Saludos!

Lucía

4/28/25, 2:44 PM Alan Rosa

Se realizo en conjunto con Jose el ajuste de los parametros en corex de casa de bolsa Produccion :

CampoComisionReporteN03 pasando su valor numerico de 0 a 1

CompanyName pasando de Sudameris Casa de Bolsa a Sudameris Securities Casa de Bolsa S.A.

Se comprobo ademas de que **OTC_TIR_ASSET_PAYMENT_RATE** ya se encuentra en 1.

Vamos a proceder a validar estos cambios con Julio.

Saludos!

Alan.

4/28/25, 3:49 PM Alan Rosa

Ademas, se reviso el parametro **OTCTIR_ASSET_RATE_FIXED**, el cual se encontraba en 0, se procedio a colocar en 1.

4/28/25, 4:20 PM Alan Rosa 025 at 2:19 PM

Se relevaron los puntos 2, c) y e) con Julio

punto 2) Ok

c) para valores menores a 0.01, retorna 0 . Lo ideal seria que muestre a 8 decimales.

e) OK

Vamos a estar trabajando en el punto c)

Saludos!

Alan.

4/29/25, 8:23 AM Alan Rosa

Julio como estas?

Podriamos validar la cantidad de decimales necesarios en el campo comision con el regulador? Dado que es un reporte normativo, por flujos internos debemos tener el respaldo del regulador para hacer cualquier modificacion sobre el reporte.

Saludos!

Alan.

5/6/25, 11:11 AM Martin Vila

Buen dia Julio, como estas?

Pudiste ver la consulta de Alan?

Saludos,

Martin.

5/7/25, 4:24 PM Alan Rosa 2025 at 2:19 PM

Estimados, como vimos en conjunto vamos a quedar a la espera del regulador.

Saludos!

Alan.

6/5/25, 10:39 AM Julio Martinez

Buenos días Alan,

A la fecha aun no contamos con definiciones al respecto, esperamos la respuesta del Regulador para la proxima semana

7/25/25, 6:11 PM Julio Martinez

Estimados, detallamos a continuación las respuestas del Regulador aclarando algunos criterios para campos del reporte (adjuntamos de igual manera el mail correspondiente).

Favor parametrizar correctamente el reporte segun las consultas nro 3, 4, 8 y 9

Consulta N° 1:

1. Los campos de "Fecha operación" y "Fecha valor" **siempre** deben ser iguales, es decir deben contener la misma fecha?. ¿O hay ocasiones en que ambos campos pueden diferir?

Respuesta del Regulador:

Los campos **Fecha de Operación** y **Fecha Valor** podrían ser diferentes, dependiendo del día de la liquidación de la operación, en caso de ser t+1, t+2 y así sucesivamente.

Consulta N° 2:

2. El campo de "N° de operación" debe ser siempre correlativo?, ¿incluso respecto a las numeraciones informadas de la fecha anterior?. Actualmente informamos las numeraciones que genera nuestro sistema, no obstante no necesariamente son correlativas ya que pueden existir "saltos" ya sea por operaciones anuladas y/o por operaciones bursátiles entre los registros de operaciones OTC.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:19 PM

El campo **Nro. De Operación** no siempre es correlativo, depende del registro que genera vuestro sistema.

Consulta N° 3:

3. Para casos excepcionales en los cuales se da de alta un cliente con posterioridad al horario operativo de pedido de numero de comitentes en la Bolsa de Valores (quedando “en proceso” para el dia siguiente en AP5) y que opere con CDAS durante la tarde, ¿cómo se registra el campo de “Código comitente SEN”?, ya que dicho dato recién se obtendrá al día siguiente?

Respuesta del Regulador:

Es factible declarar provisoriamente el Código Sen como 0 (cero), sin embargo, el código comitente interno debe declararse obligatoriamente.

Consulta N° 4:

4. Para el campo “Tipo de Cartera” favor aclarar la forma de registro a partir del siguiente ejemplo:

Nuestra Casa de Bolsa Compra el CDA de un cliente para cartera propia

Por lo tanto, **ambas puntas** deben tener registrado el “Tipo de Cartera” como “Propia”? ¿O para la punta de Venta se debe registrar siempre como “Terceros”?

¿Como sería en caso contrario? Vende: Nuestra Casa de Bolsa y Compra: Cliente (¿cómo se registraría cada punta?)

Respuesta del Regulador:

La punta compradora si es la Casa de Bolsa debe ir Cartera “**Propia**”, punta vendedora si se trata de un cliente debe ir como “**Terceros**”. Mismo ejercicio aplica cuando la casa de Bolsa vende un instrumento a un cliente, la punta vendedora Casa de Bolsa “**Propia**”, punta compradora Cliente “**Terceros**”, en el caso de que la Casa de Bolsa sólo intermedie entre clientes, ambos registros deben ser “**Terceros**”

Wednesday, September 17, 2025 at 2:19 PM

5. "TIR" en casos de operaciones de Reporto. Favor reconfirmar si para casos de vencimientos y/o altas de operaciones de Reporto OTC, el dato de "TIR" debe ser igual al dato de "Tasa Nominal", es decir ambos campos deben contener el dato de la tasa del CDA subyacente.

Respuesta del Regulador:

La Tasa Nominal corresponde a la Tasa Nominal del instrumento entregado en garantía de la operación de Reporto, el campo **TIR** corresponde a la tasa de interés propia de la negociación de Reporto pactada entre las partes.

Consulta N° 6:

6. Favor reconfirmar que tanto para el "Precio clean" y el "Precio Dirty" no existen limitantes en cuanto a la cantidad de decimales.

Respuesta del Regulador:

Precio Clean y **Precio Dirty**, NO existen limitantes en cuanto a la cantidad de decimales.

Consulta N° 7:

7. Favor reconfirmar la forma de registro del campo de "Periodicidad" para casos de CDAs que no posean periodicidad de cupones, sino que el mismo sea directamente **al vencimiento del título**. ¿Para esos casos se debe incluir por defecto la opción de "ANUAL"? ¿por mas de que realmente el plazo no sea efectivamente anual?

Respuesta del Regulador:

Asignar periodicidad **Anual**.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:19 PM

8. Respecto al campo de “Comisión” y considerando que corresponde a un valor en tanto por 1, en algunas ocasiones contamos con valores a partir del quinto decimal, favor reconfirmar si existen limitantes en cuanto a la cantidad de decimales. Consulta del Proveedor:

Respuesta del Regulador:

Campo **Comisión** no existen limitantes en cuanto a la cantidad de decimales.

Consulta N° 9:

9. Adicionalmente, respecto al campo de “Comisión”, supongamos que realizamos la venta de **2 CDAs** a un Cliente (nominal de Gs. 100.000.000 c/u), al cual cobramos por dicha operación global un monto total de comisión de Gs. 100.000. Al respecto:

El monto de comisión de **Gs. 100.000** (0,000975668 en tanto por 1) se agrega a cada CDA de las puntas de venta:

Codigo Comitente Interno	Código Comitente SEN	Codigo Identidad del Titulo Valor	Tipo de Mercado	Tipo de operación	Moneda	Cantidad	Valor Nominal	Periodicidad	Comisión	Valor Negociado
X Cliente	X Cliente	XX0001	SECUNDARIO	COMPRA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0,000975668	102.493.840
X Cliente	X Cliente	XX0002	SECUNDARIO	COMPRA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0,000975668	102.493.840
20	8294	XX0001	SECUNDARIO	VENTA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0	102.493.840
20	8294	XX0002	SECUNDARIO	VENTA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0	102.493.840

¿O se debe dividir la comisión total cobrada y asignar a cada CDA? (Total de comisión de 100.000 / 2 titulos: **50.000**). Por lo tanto la comisión prorrateada a cada CDA es de **Gs. 50.000** (0,00048783 en tanto por 1). Quedando de esta manera:

Codigo Comitente Interno	Código Comitente SEN	Codigo Identidad del Titulo Valor	Tipo de Mercado	Tipo de operación	Moneda	Cantidad	Valor Nominal	Periodicidad	Comisión	Valor Negociado
X Cliente	X Cliente	XX0001	SECUNDARIO	COMPRA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0,00048783	102.493.840
X Cliente	X Cliente	XX0002	SECUNDARIO	COMPRA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0,00048783	102.493.840
20	8294	XX0001	SECUNDARIO	VENTA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0	102.493.840
20	8294	XX0002	SECUNDARIO	VENTA	PYG	1	100.000.000	MENSUAL	0	102.493.840

Respuesta del Regulador:

De acuerdo con el ejemplo la comisión debe ser **prorrateada**, de manera a que refleje el monto total de la comisión cobrada por la operación y no genere una duplicación.

Wednesday, September 17, 2025 at 2:19 PM

Captura de pantalla 2025-07-25 175442.png (37.5 kb)

Captura de pantalla 2025-07-25 175629.png (34.6 kb)

RE_ Consultas sobre criterios para el Reporte Diario de Operaciones Extradursatiles.msg (307.5 kb)

8/25/25, 5:55 PM Alan Rosa

Julio como estas?

Muchas gracias por la clara respuesta a todos los puntos, vamos a estar trabajando en los mismos.

Saludos!

Alan.