**CIRCULAR CONSAR 19-29 Modificaciones y adiciones a las Reglas Generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro.  
(DOF del 07 de julio de 2023)**

**Al margen un sello con el Escudo Nacional, que dice: Estados Unidos Mexicanos.- HACIENDA.- Secretaría de Hacienda y Crédito Público.- Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro.**

**CIRCULAR CONSAR 19-29**

**MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.**

El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, con fundamento en lo dispuesto en los artículos 5 fracciones I, II, VII y XVI, 12 fracciones I, VIII y XVI, 88, 89, 90 fracciones ll, 91 y 113 de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 106 de la Ley del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado; 140 del Reglamento de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 1, 2 fracción III y 8 primer párrafo del Reglamento Interior de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, y

**CONSIDERANDO**

Que la Circular 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro" con sus modificaciones y adiciones, tienen por objeto establecer el procedimiento y requisitos a los que deberán sujetarse las Administradoras de Fondos para el Retiro, Sociedades de Inversión Especializadas de Fondos para el Retiro, Entidades Receptoras y Empresas Operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, en cuanto a la información que deberán proporcionar a la Comisión, para que ésta cuente con los elementos necesarios para supervisar su adecuado funcionamiento;

Que, para contar con toda la información necesaria para supervisar el funcionamiento de los Participantes en los Sistemas de Ahorro para el Retiro, es necesario que se actualicen los anexos 75, 77, 78, 118, 119, 121, 123, 141, 143 y 144, con el objeto de mantener actualizados los catálogos de contrapartes y las denominaciones de los sistemas de concertación, catálogos de calificaciones y calificadoras, los cuales se actualizan de forma recurrente;

Que para instrumentar la adición del artículo 96 bis de las Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro, publicada en el Diario Oficial de la Federación el 27 de septiembre de 2022, relativo a la obligación de las Administradoras de entregar a la Comisión información sobre la valuación de Activos Objeto de Inversión es necesario incorporar un nuevo anexo 148 que permita a los regulados dar cumplimiento a dicha obligación, y

Que de conformidad con la Ley General de Mejora Regulatoria, las presentes modificaciones no generan costos de cumplimiento a los particulares obligados, ya que no se generan obligaciones, sanciones, no se modifican o crea trámites que signifiquen mayores cargas administrativas o costos de cumplimiento, no reduce o restringen prestaciones o derechos, no establecen o modifican definiciones, clasificaciones, metodologías, criterios, caracterizaciones o cualquier otro término de referencia, afectando derechos, obligaciones, prestaciones o trámites de los particulares ya que se trata de una actualización natural de catálogos y referencias, y por otro lado, la incorporación del anexo 148, deriva de una obligación previamente cuantificada en divero cuerpo normativo previamente publicado, ha tenido a bien expedir las siguientes:

**MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.**

**PRIMERO.-**Se **MODIFICA** la regla Séptima, fracciones L y LI, y se **ADICIONA**la fracción XXVIII a la regla Séptima, de la Circular CONSAR 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro", modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18, CONSAR 19-19, CONSAR 19-20, CONSAR 19-21, CONSAR 19-22, CONSAR 19-23, CONSAR 19-24, CONSAR 19-25, CONSAR 19-26, CONSAR 19-27 y CONSAR 19-28 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016, 6 de septiembre de 2017, 15 de marzo de 2018, 18 de enero de 2019, 31 de mayo de 2019, 8 de octubre de 2019, 5 de diciembre de 2019, 17 de diciembre de 2020, 31 de mayo de 2021, y 4 de febrero y 25 de julio de 2022 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

**"SEPTIMA. -**La información que las Administradoras deberán proporcionar a la Comisión consiste en:

**I. a XLIX**. **...**

**L.** Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del tercer día hábil anterior al de entrega del formato, de conformidad con el formato establecido como anexo 143 de las presentes reglas generales;

**LI.** Información pública disponible de la composición de Fondos Mutuos, al cierre del último día hábil correspondiente a dos meses anteriores a la entrega del formato, de conformidad con el formato establecido como anexo 144 de las presentes reglas generales, y

LII. Los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores, de conformidad con lo establecido en el anexo 148 de las presentes reglas generales."

**SEGUNDO.-**Se **MODIFICAN** los anexos 75, 77, 78, 118, 119, 121, 123, 141, 143 y 144 y se **ADICIONA** el anexo 148, de la Circular CONSAR 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro", modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18, CONSAR 19-19, CONSAR 19-20, CONSAR 19-21, CONSAR 19-22, CONSAR 19-23, CONSAR 19-24, CONSAR 19-25, CONSAR 19-26, CONSAR 19-27 y CONSAR 19-28 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016, 6 de septiembre de 2017, 15 de marzo de 2018, 18 de enero de 2019, 31 de mayo de 2019, 8 de octubre de 2019, 5 de diciembre de 2019, 17 de diciembre de 2020, 31 de mayo de 2021, y 4 de febrero de 2022, y 25 de julio de 2022 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

**TRANSITORIAS**

**PRIMERA.-**Las presentes modificaciones y adiciones entrarán en vigor al día hábil siguiente de su publicación en el Diario Oficial de la Federación con excepción de lo siguiente:

I.     El formato establecido como Anexo 123 de las presentes reglas, entrará en vigor a los 30 días naturales después al de su publicación en el Diario Oficial de la Federación.

II.     El formato establecido como Anexo 148 de las presentes reglas, entrará en vigor a los 90 días naturales después al de su publicación en el Diario Oficial de la Federación.

**SEGUNDA.-**Con la entrada en vigor de las presentes modificaciones y adiciones, se abrogan todas aquellas disposiciones que contravengan a las presentes.

Ciudad de México, a 21 de junio de 2023.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, Mtro.**Julio César Cervantes Parra**.- Rúbrica.

**Anexo 75**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información del desglose de operaciones de compraventa durante el día. Se deberá enviar un archivo por SIEFORE. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL** **REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO. | 203 | 16:00 a 20:00 Hrs. |

|  |
| --- |
| **ENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_102248.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000"**1 |
| 2 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 4 | 8 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = Constante "**203**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_105295.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante"0316".**1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_107878.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave de Tipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. 1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_110461.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_113044.png | N | 6 | 0 | 22 | 27 | Clave de Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. 1 |
| 8 | Fecha de Información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_115627.png | F | 8 | 0 | 28 | 35 | Fecha de la Operación que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 168 | 0 | 36 | 203 | Vacíos.6 |

|  |
| --- |
| **DETALLE(S)** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_120993.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "301".**1 |
| 2 | Número consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_123596.png | N | 3 | 0 | 4 | 6 | Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación1. |
| 3 | Tipo de Inversión |  | N | 2 | 0 | 7 | 8 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente:  0 para Directo,  1 para Reporto,  6 para Préstamo de Valores  12 Para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos,  13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos,  14 para Inversiones Tercerizadas1. |
| 4 | Tipo de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 9 | 10 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 011. |
| 5 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 11 | 12 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento1. |
| 6 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_126955.png | AN | 12 | 0 | 13 | 24 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.12 |
| 7 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_129558.png | AN | 9 | 0 | 25 | 33 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.13 |
| 8 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_132161.png | AN | 7 | 0 | 34 | 40 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.14 |
| 9 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_134764.png | AN | 4 | 0 | 41 | 44 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. 5 |
| 10 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_137367.png | AN | 7 | 0 | 45 | 51 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV.5 |
| 11 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_139970.png | AN | 7 | 0 | 52 | 58 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101.Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.15 |
| 12 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_142573.png | AN | 10 | 0 | 59 | 68 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros15 |
| 13 | Fecha de Liquidación |  | F | 8 | 0 | 69 | 76 | Fecha de Liquidación de la operación3. |
| 14 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 77 | 88 | Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1.1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Costo unitario |  | N | 9 | 6 | 89 | 103 | Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.2 |
| 16 | Costo unitario más intereses devengados |  | N | 9 | 6 | 104 | 118 | Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación).  En caso de que los valores reportados no cuenten con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo 15 del presente formato "Costo unitario".  En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 17 | Monto total a liquidar |  | N | 14 | 2 | 119 | 134 | Monto total a liquidar en la operación en pesos  En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore.  Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. 2. |
| 18 | Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento |  | N | 6 | 0 | 135 | 140 | Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros.1 |
| 19 | Tasa de rendimiento |  | N | 3 | 3 | 141 | 146 | Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.2 |
| 20 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 147 | 148 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. 1 |
| 21 | Tipo de cambio promedio de adquisición |  | N | 9 | 6 | 149 | 163 | Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros2,9. |
| 22 | País de adquisición |  | N | 2 | 0 | 164 | 165 | Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países1. |
| 23 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 166 | 171 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes.  En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13:  -En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación.  -En caso de ser operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del Custodio Internacional, de la Plataforma de Negociación Electrónica o del Administrador con el que se haya realizado la operación, según el Catálogo de Contrapartes.  -En caso de flujos por dividendos o cupones se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes.  -En otro caso se deberá llenar con ceros. 1. |
| 24 | Hora de concertación de la operación |  | N | 4 | 0 | 172 | 175 | Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros10. |
| 25 | Banco de Trabajo |  | N | 1 | 0 | 176 | 176 | Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si=1 y No=01. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 26 | Medio de concertación |  | N | 1 | 0 | 177 | 177 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  0 = No aplica  1 = Telefónico  2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación.  En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá considerar lo siguiente:  -      Cuando se realicen a través del Custodio Internacional o del Administrador se deberá indicar 0.  -      Cuando se realicen a través de Plataformas se deberá indicar 2. 1 |
| 27 | Sistema de concertación |  | N | 2 | 0 | 178 | 179 | En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros.  Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado.  0 - No aplica  1 - MEI  2 - SIPO  3 - VAR  4 - MEIPresval  5 - Corros Monex  6 - Bloomberg  7 - Market Axess  8 - Reuters  99 - OTRO  En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos que se realicen a través de Plataformas, se deberá indicar 99.1. |
| 28 | Tipo de postura |  | N | 1 | 0 | 180 | 180 | Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta.  1 - Agresor  2 - Agredido  Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción.1 |
| 29 | Clase de Activo de la Inversión tercerizada |  | N | 3 | 0 | 181 | 183 | En caso de ser inversión tercerizada se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de Activos de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros1. |
| 30 | Observaciones |  | AN | 20 | 0 | 184 | 203 | Se deberá anotar el nombre de la contraparte en caso de haber utilizado el Identificador 076000 "otros operadores" o 700000 "otros Bancos extranjeros" como Contraparte"5. |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Complementarias)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Previsión Social)** | |
| **Clave de Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de Entidad** | **Descripción** |
| 334 | PROFUTURO |  | 430 | XXI BANORTE |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Básicas)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Voluntarias)** | |
| **Clave de Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI BANORTE |  | 634 | PROFUTURO |
| 534 | PROFUTURO |  | 644 | SURA |
| 538 | PRINCIPAL |  | 652 | CITIBANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | CITIBANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 568 | COPPEL |  |  |  |
| 578 | PENSIONISSSTE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001000 | Siefore Inicial | Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE. |
| 002 | 538 | 001000 | Siefore Inicial | Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001000 | Siefore Inicial | Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001000 | Siefore Inicial | Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001000 | Siefore Inicial | Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 000001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 004 | 430 | 000001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 000005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Inversión** | | |  | **Catálogo de Tipo de Liquidación** | | |
| **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |  | **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 0 | Di | Directo |  | 1 | MD | Mismo Día |
| 1 | Re | Reporto |  | 2 | 24 | 24 Hrs. |
| 6 | Pv | Préstamo de Valores |  | 3 | 48 | 48 Hrs. |
| 7 | Gd | Garantías entregadas por operaciones con IFD |  | 4 | 72 | 72 Hrs. |
| 8 | Gr | Garantías recibidas por operaciones de Reporto |  | 5 | 96 | 96 Hrs. |
| 9 | Gi | Garantías recibidas por operaciones con IFD |  | 6 | 120 | 120 Hrs. |
| 10 | Gp | Garantías recibidas por Préstamo de Valores |  | 7 | 144 | 144 Hrs. |
| 11 | Ce | Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados |  | 8 | 168 | 168 Hrs. |
| 12 | Ef | Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa |  | 9 | 192 | 192 Hrs. |
| 13 | Ec | Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa. |  |  |  |  |
| 14 | Lt | Inversiones tercerizadas |  |  |  |  |
| 15 | Ge | Garantías entregadas por instrumentos Estructurados |  |  |  |  |
| 16 | Oc | Operaciones Cambiarias de compra o venta de divisas. |  |  |  |  |
| 17 | Er | Garantías entregadas por operaciones de Reporto |  |  |  |  |
| 18 | Ep | Garantías entregadas por operaciones de Préstamo de Valores |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |  | **Catálogo de Tipo de Instrumento** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |  | **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |  | 1 | BCC | Bono Cupón Cero |
| 2 | USD | Dólar Americano |  | 2 | BTF | Bono Tasa Fija |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |  | 3 | TFA | Bono Tasa Fija Amortizable |
| 6 | JPY | Yen Japonés |  | 4 | BTV | Bono Tasa Flotante |
| 7 | EUR | Euros |  | 5 | TVA | Bono Tasa Flotante Amortizable |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |  | 6 | ACC | Acciones |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |  | 7 | ETF | Exchange Traded Funds |
| 10 | CHF | Franco Suizo |  | 8 | NEP | Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |  | 9 | TRK | Instrumentos conocidos como Trackers |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |  | 10 | EFF | Efectivo |
| 13 | DKK | Corona Danesa |  | 11 | OTR | Otro tipo de instrumento no incluido |
| 14 | SEK | Corona Sueca |  | 12 | MDT | Inversión Tercerizada |
| 15 | NOK | Corona Noruega |  | 13 | EVS | Estructura vinculada a Subyacente |
| 16 | BRL | Real Brasileño |  | 14 | FMU | Fondo Mutuo |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |  |  |  |  |
| 18 | CLP | Peso Chileno |  |  |  |  |
| 19 | INR | Rupia |  |  |  |  |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |  |  |  |  |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |  |  |  |  |
| 22 | CZK | Corona checa |  |  |  |  |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |  |  |  |  |
| 24 | RON | Leu Rumano |  |  |  |  |
| 25 | LVL | Lats Letones |  |  |  |  |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |  |  |  |  |
| 27 | EEK | Corona Estonia |  |  |  |  |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |  |  |  |  |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |  |  |  |  |
| 30 | COP | Peso Colombiano |  |  |  |  |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |  |  |  |  |
| 32 | PEN | Nuevo Sol |  |  |  |  |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |  |  |  |  |
| 99 | OTR | Otras Divisas |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Operación** | | | |
| **Identificador** | **Clasificación** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 1 | 001-250 | Co | Compra |
| 2 | 501-750 | Ve | Venta |
| 3 | 251-500 | Ac | Compra por amortización |
| 4 | 751-999 | Av | Venta por amortización |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Clase de Activos de Inversión Tercerizada** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No aplica |
| 1 | Mercancías. |
| 2 | Renta Variable. |
| 3 | Deuda Extranjera |
| 999 | Otro. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Sistema de Concertación** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No aplica |
| 1 | MEI |
| 2 | SIPO |
| 3 | VAR |
| 4 | MEIPresval |
| 5 | Corros Monex |
| 6 | Bloomberg |
| 7 | Market Axess |
| 8 | Reuters |
| 99 | OTRO |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 2 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 3 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 4 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 5 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 6 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 7 | España |  | 33 | Brasil |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 9 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  | 52 | Croacia |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Contrapartes** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 2001 | Banco de México |  | 82035 | Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 82037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 82039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 82042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 13006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 82043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |
| 13007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 82044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 13010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 82048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 13011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 82049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 13012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 82050 | Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra |
| 13013 | IXE Casa de Bolsa |  | 82051 | Casa de Bolsa Ve por Más |
| 13015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 13018 | Casa de Bolsa Arka |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 13019 | Value Casa de Bolsa |  | 701001 | Abasis |
| 13020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 701002 | American Express (Extranjero) |
| 13021 | Monex Casa de Bolsa |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 13026 | Vector Casa de Bolsa |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero) |
| 13027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 13032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 13040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |
| 13041 | Invex Casa de Bolsa |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 13104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 13105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 13106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 13109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 13114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 13117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 701014 | Cargill Financial Service International (Extranjero) |
| 13118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 13119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 13120 | UBS Casa de Bolsa |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 13121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 13122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 13123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 13124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 13125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 13126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 13127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 13129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 13130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 13131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 16031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 16035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England |
| 16040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 16041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |
| 16044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 16067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 16240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 16408 | B y B Casa de Cambio |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 16419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero) |
| 16507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 16533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 16587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 16629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 16712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |
| 16714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 16715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 16717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 16718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero) |
| 16719 | Unica Casa de Cambio |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |
| 25001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 25002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero) |
| 25007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 25013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |
| 25014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 37006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 37009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |
| 37019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 37135 | Nacional Financiera |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 37166 | Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 37168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 40002 | Banco Nacional de México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 40012 | BBVA Bancomer |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero) |
| 40014 | Banco Santander |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 40017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 40021 | HSBC México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 40022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 40030 | Banco del Bajío |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 40032 | Ixe Banco |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 40036 | Banco Inbursa |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 40037 | Banco Interacciones |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 40042 | Banca Mifel |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 40044 | Scotiabank Inverlat |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 40058 | Banco Regional de Monterrey |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 40059 | Banco Invex |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 40060 | Bansi |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 40062 | Banca Afirme |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 40072 | Banco Mercantil del Norte |  | 801160 | Acciones Propias |
| 40102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 40103 | American Express Bank (México) |  | 801162 | Bank West |
| 40106 | Bank of America México |  | 801163 | Bcpbank Canada |
| 40108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 801164 | Bridgewater Bank |
| 40110 | Banco J.P. Morgan |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 40112 | Banco Monex |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 40113 | Banco Ve por Más |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 40116 | ING Bank (México) |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 40124 | Deutsche Bank México |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 40126 | Banco Credit Suisse México |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 40127 | Banco Azteca |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 40128 | Banco Autofin México |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 40129 | Barclays Bank México |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |
| 40130 | Banco Compartamos |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 40131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 40132 | Banco Multiva |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |
| 40133 | Banco Actinver |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 40134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |
| 40136 | Banco Regional |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 40137 | BanCoppel |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 40138 | Banco Amigo |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |
| 40139 | UBS Bank México |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |
| 40140 | Banco Fácil |  | 801183 | Regions Bank |
| 40141 | Volkswagen Bank |  | 801184 | National City Bank |
| 40142 | El Banco Deuno |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 40143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801186 | State Street B&TC |
| 40144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 40145 | Banco Base |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 40160 | Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 46048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 47005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801191 | North Fork Bank |
| 76000 | Otros Operadores |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 76001 | Derfin |  | 801193 | Bank Of The West |
| 76008 | Stock & Price |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 76010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801195 | Northern TC |
| 76014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 76018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 76022 | Darka |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 76029 | Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 76043 | Timber Hill LLC. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 76044 | Enlace Derivados |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 76048 | Intercam Derivados |  | 801202 | Santander USA |
| 79001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801203 | CME Clearing |
| 79003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A. |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 79004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A. |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 79005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 79006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 79009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 79010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 79012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda |  | 801210 | Natixis |
| 79013 | Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda |  | 801211 | XP Securities LLC |
| 79014 | Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán |  | 801212 | INTL FCStone |
| 79015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A. |  | 801213 | LarrainVial Securities US LLC |
| 79016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801214 | HSBC Securities USA |
| 79017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801215 | Stone Financial Inc. |
| 79018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801216 | ICE Clearing |
| 79022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900000 | Otros Mandatarios o Administradores |
| 79023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 79024 | CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 79025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp. |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 79026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 900004 | Amundi Asset Management |
| 79027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 79028 | BBVA Bancomer USA |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 79029 | Dinero Express |  | 900008 | Ninety One PLC |
| 79030 | Banorte USA Corporation |  | 900009 | Alliance Bernstein |
| 79031 | INB Financial Corp. |  | 900011 | Fidelity International |
| 79032 | INB Delaware Corporation |  | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 79033 | Inter Nacional Bank |  | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 80000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 80001 | Acci Securities Incorporated |  | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 80004 | Afin Securities International Limited |  | 900016 | Vanguard Group |
| 80005 | Arka Securities Incorporated |  | 900017 | Natixis |
| 80008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 80009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 900019 | State Street Corporation |
| 80013 | Vectormex Incorporated |  | 900020 | DWS Investments |
| 80014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900021 | Sherpa Capital |
| 80015 | Vectormex International Incorporated |  | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 80019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900023 | FirstTrust |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 80020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900024 | Baillie Gifford |
| 80021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900025 | UBS AG |
| 80022 | Valores Finamex Limited |  | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 80023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 80024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900028 | GAM Holding AG |
| 80025 | Monex Securities Incorporated |  | 900029 | Invesco Capital Management |
| 80026 | Invex Incorporated |  | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 80027 | GBM International Incorporated |  | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 80028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 80029 | Portfolio Investment Incorporated |  | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 80030 | Arka International, Corp. |  | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 80031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |  | 900035 | UTI Asset Management |
| 80032 | Banorte Asset Management,Inc. |  | 900036 | Nikko Asset Management |
| 80033 | Afin International Holdings,Inc. |  | 900037 | Global X |
| 80034 | Banorte I, LLC. |  | 900038 | VanEck |
| 80037 | Invex International, S.A. |  | 900039 | KraneShares |
| 80038 | Invex Worldwide, S.A. |  | 900040 | ProShares |
| 80041 | Inbursa International, Inc. |  | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 80042 | Inbursa Securities, Inc. |  | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 80043 | IXE Holdings, Inc. |  | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 82004 | Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba. |  | 900044 | Man Group |
| 82006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |  | 900045 | Berenberg |
| 82008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |  | 900046 | Finamex |
| 82009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |  | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |
| 82010 | Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania. |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 82011 | Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur. |  | 920000 | Otros Socios Operadores |
| 82012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
| 82013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |
| 82014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |  | 950000 | Otras Plataformas Electrónicas de Negociación |
| 82016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |  | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 82025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A. |  | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 82027 | Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 82028 | Internacional Oficina de Representación en Madrid, España. |  |  |  |
| 82030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |
| 82031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

El segundo bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha final del periodo.

5 Dato alfabético. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apostrofes; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

9 El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

10 Hora de Operación. Se deberá llenar con el estilo HHMM, con las Horas en formato de 00 - 24 Horas y los minutos de 00 - 60.

12 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

13 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

14 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para las acciones internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO** |

En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:

       1° ISIN, de no existir éste,

       2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

       3° SEDOL.

Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores, salvo en instrumentos provenientes de operaciones primarias, pendientes de liquidar, en donde estos identificadores aún no sean asignados y por tanto no existan.

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos sin contraponerse a las observaciones de cada campo; de lo contrario se llenarán con un CERO y espacios en blanco.

15 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en

mayúsculas, en caso de no existir se anotará un CERO justificado a la izquierda.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

**Políticas a seguir en la transmisión de la información**

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.

II.     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

III.    Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.

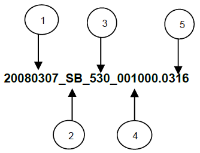
IV.   El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

V.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCION** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 6 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia de SIEFORES. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será **Constante = "0316"**. |

**NOTA:**   La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

            Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefore XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de Siefore Básica Inicial, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá de encriptarse con el programa GNUpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20080307\_SB\_530\_001000.0316.gpg**

            Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encriptarlo, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20080307\_SB\_530\_001000.0316**

**NOTA:**  No se tomara en cuenta la extensión. gpg, en la recuperación del acuse, como lo muestra el ejemplo, ni vendrá encriptado el acuse.

VI.   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| \*Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

**Anexo 77**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene información del desglose de operaciones con instrumentos financieros derivados (Forwards, Futuros, Opciones y Swaps). Se deberá enviar un archivo por SIEFORE". | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL** **REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 738 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

|  |
| --- |
| **ENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_404145.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000"**1 |
| 2 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 4 | 8 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = Constante "**738**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_407192.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante"0314".1** |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_409775.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave de Tipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. 1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_412358.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_414941.png | N | 6 | 0 | 22 | 27 | Clave de Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. 1 |
| 8 | Fecha de Información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_417524.png | F | 8 | 0 | 28 | 35 | Fecha de información correspondiente al día hábil previo al que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 703 | 0 | 36 | 738 | Vacíos.6 |

|  |
| --- |
| **DETALLE(S)** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_422890.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_425493.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_428096.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios.13 |
| 4 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_430699.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_433302.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_435905.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_438508.png | AN | 6 | 0 | 43 | 48 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_441111.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 10 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 68 | 137 | Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. 17 |
| 11 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 138 | 140 | Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. 1 |
| 12 | Tipo de Operación |  | N | 3 | 0 | 141 | 143 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. 1 |
| 13 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 144 | 161 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 14 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 162 | 164 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato.1 |
| 15 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 165 | 166 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta.1. |
| 16 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 167 | 170 | En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 17 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 171 | 178 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 18 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 179 | 186 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor o no. 3 |
| 19 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 187 | 194 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. 3 |
| 20 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 195 | 202 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout.3 |
| 21 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 203 | 218 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 22 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 219 | 232 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 23 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 233 | 235 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 24 | Precio o Tasa pactada |  | N | 14 | 7 | 236 | 256 | Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. 2 |
| 25 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 257 | 262 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. 5 |
| 26 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 263 | 263 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. 5 |
| 27 | Tipo de Valor del Cheapest to Deliver |  | AN | 4 | 0 | 264 | 267 | Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 28 | Emisora del Cheapest to Deliver |  | AN | 7 | 0 | 268 | 274 | Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 29 | Serie del Cheapest to Deliver |  | AN | 6 | 0 | 275 | 280 | Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 30 | Precio de Cheapest to Deliver |  | N | 3 | 6 | 281 | 289 | Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. 2 |
| 31 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 290 | 290 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |
| 32 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 291 | 298 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 33 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 299 | 318 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista identificador para la contraparte en el catálogo de contrapartes.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 34 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 319 | 321 | Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 35 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 322 | 325 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 36 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 326 | 328 | Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 37 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 329 | 332 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". 1 |
| 38 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 333 | 482 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 39 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 483 | 502 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación.5 |
| 40 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 503 | 516 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.1 |
| 41 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 517 | 524 | En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 42 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 525 | 544 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 43 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 545 | 552 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. 1 |
| 44 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 553 | 572 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 45 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 573 | 580 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 46 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 581 | 600 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 47 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 601 | 608 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 48 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 609 | 628 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 49 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_453710.png | N | 14 | 0 | 629 | 642 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 50 | Espacios en blanco |  | AN | 96 | 0 | 643 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_458911.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante** "**302**". 1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_461514.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_464117.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios asignado al contrato. 13 |
| 4 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_466720.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_469323.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_471926.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_474529.png | AN | 6 | 0 | 43 | 48 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_477132.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 10 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 68 | 137 | Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. 17 |
| 11 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 138 | 140 | Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. 1 |
| 12 | Tipo de Operación |  | N | 3 | 0 | 141 | 143 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. 1 |
| 13 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 144 | 151 | Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. 1 |
| 14 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 152 | 171 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 15 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 172 | 189 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 16 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 190 | 191 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas1. |
| 17 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 192 | 194 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato 1 |
| 18 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 195 | 198 | En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros.1 |
| 19 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 199 | 206 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 20 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 207 | 214 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 21 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 215 | 222 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. 3 |
| 22 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 223 | 230 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout.3 |
| 23 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 231 | 246 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 24 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 247 | 260 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 25 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 261 | 263 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 26 | Precio o Tasa pactada |  | N | 14 | 7 | 264 | 284 | Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. 2 |
| 27 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 285 | 290 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas 5 |
| 28 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 291 | 291 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. 5 |
| 29 | Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 4 | 0 | 292 | 295 | Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 30 | Emisora del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 7 | 0 | 296 | 302 | Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 31 | Serie del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 6 | 0 | 303 | 308 | Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 32 | Precio de Cheapest to Deliver |  | N | 3 | 6 | 309 | 317 | Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. 2 |
| 33 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 318 | 467 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 34 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 468 | 468 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |
| 35 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 469 | 482 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.1 |
| 36 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 483 | 490 | Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no exista el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.1 |
| 37 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 491 | 510 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". 5 |
| 38 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 511 | 518 | Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. 1 |
| 39 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 519 | 538 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 40 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 539 | 546 | Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. 1 |
| 41 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 547 | 566 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 42 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_487985.png | N | 14 | 0 | 567 | 580 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 43 | Espacios en blanco |  | AN | 158 | 0 | 581 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_493200.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "303"**. 1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_495803.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_498406.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_501009.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_503612.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_506215.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_508818.png | AN | 6 | 0 | 43 | 48 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_511421.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero.16 |
| 10 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 68 | 137 | Se deberá anotar la clave **"~~"~~**Unique Trade Identifier" de la operación.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero17 |
| 11 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 138 | 140 | Se registrará el Identificador 1 o 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo 1 |
| 12 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 141 | 148 | En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En otro caso reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros.1 |
| 13 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 149 | 168 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 14 | Tipo de opción |  | N | 3 | 0 | 169 | 171 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. 1 |
| 15 | Subclase de opción |  | N | 3 | 0 | 172 | 174 | Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. 1 |
| 16 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 175 | 175 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. 5 |
| 17 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 176 | 193 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 18 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 194 | 195 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta1. |
| 19 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 196 | 198 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato1 |
| 20 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 199 | 202 | En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 21 | Fecha de la operación |  | F | 8 | 0 | 203 | 210 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 22 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 211 | 218 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 23 | Fecha de Liquidación |  | F | 8 | 0 | 219 | 226 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. 3 |
| 24 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 227 | 234 | Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout.3 |
| 25 | Fecha de ejercicio vigente |  | F | 8 | 0 | 235 | 242 | Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. 3- |
| 26 | Tipo de operación |  | N | 3 | 0 | 243 | 245 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. 1 |
| 27 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 246 | 261 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 28 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 262 | 275 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 29 | Divisa del tamaño del contrato o del monto nocional |  | N | 3 | 0 | 276 | 278 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 30 | Precio o tasa de ejercicio vigente |  | N | 9 | 6 | 279 | 293 | Se deberá anotar el strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 31 | Precio o tasa de ejercicio Cap |  | N | 9 | 6 | 294 | 308 | Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros.2 |
| 32 | Precio o tasa de ejercicio Floor |  | N | 9 | 6 | 309 | 323 | Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 2 |
| 33 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 324 | 329 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas 5 |
| 34 | Prima Pactada |  | N | 14 | 6 | 330 | 349 | Se deberá anotar el monto de la prima en pesos, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. 2 |
| 35 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 350 | 357 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC según el Catálogo Contrapartes.  En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros1 |
| 36 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 358 | 377 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 37 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 378 | 380 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros1 |
| 38 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 381 | 384 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso reportar ceros.1, |
| 39 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 385 | 387 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros 1 |
| 40 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 388 | 391 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera"  En otro caso reportar ceros.1 |
| 41 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 392 | 541 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 42 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 542 | 542 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico.1 |
| 43 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 543 | 562 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 44 | Delta de la opción |  | N | 2 | 6 | 563 | 570 | Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes2 |
| 45 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 571 | 584 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero1 |
| 46 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 585 | 592 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 47 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 593 | 612 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío.5 |
| 48 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 613 | 620 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.1  En otro caso reportar con ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 49 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 621 | 640 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 50 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 641 | 648 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existiera el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 51 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 649 | 668 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío.5 |
| 52 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_524734.png | N | 14 | 0 | 669 | 682 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros1 |
| 53 | Espacios en blanco |  | AN | 56 | 0 | 683 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4:** CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_529935.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "304"**. 1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_532538.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_535141.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_537744.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_540347.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_542950.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_545553.png | AN | 6 | 0 | 43 | 48 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_548156.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 10 | Unique Swap Identifier |  | AN | 70 | 0 | 68 | 137 | Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. 17 |
| 11 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 138 | 140 | Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. 1 |
| 12 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 141 | 148 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 13 | Tipo de Posición |  | N | 1 | 0 | 149 | 149 | En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación al contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2.  Se deberá reportar 1 en otro caso. 1 |
| 14 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 150 | 157 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 15 | Número de cupón vigente a entregar |  | N | 3 | 0 | 158 | 160 | Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 16 | Número de cupón vigente a recibir |  | N | 3 | 0 | 161 | 163 | Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 17 | Fecha de próxima liquidación a entregar |  | F | 8 | 0 | 164 | 171 | Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 3 |
| 18 | Fecha de próxima liquidación a recibir |  | F | 8 | 0 | 172 | 179 | Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 3 |
| 19 | Plazo de referencia a entregar |  | N | 4 | 0 | 180 | 183 | Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 20 | Plazo de referencia a recibir |  | N | 4 | 0 | 184 | 187 | Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 21 | Días para fijar tasa a entregar |  | N | 3 | 0 | 188 | 190 | Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 22 | Días para fijar tasa a recibir |  | N | 3 | 0 | 191 | 193 | Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 23 | Número de cupones a entregar |  | N | 3 | 0 | 194 | 196 | Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 24 | Número de cupones a recibir |  | N | 3 | 0 | 197 | 199 | Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25 | Valor nocional |  | N | 14 | 6 | 200 | 219 | Se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar).  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 26 | Valor nocional 2 |  | N | 14 | 6 | 220 | 239 | Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir).  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 27 | Tipo de cambio pactado |  | N | 12 | 6 | 240 | 257 | Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con nocionales en distinta divisa. 2 |
| 28 | Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado |  | AN | 6 | 0 | 258 | 263 | En caso de que las divisas asociadas a los nocionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir, según el catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado.  En otro caso, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos nocionales. 5 |
| 29 | Divisa del nocional a entregar |  | N | 3 | 0 | 264 | 266 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar conforme al catálogo de Divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 30 | Divisa del nocional a recibir |  | N | 3 | 0 | 267 | 269 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir conforme al catálogo de Divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 31 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 270 | 271 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que entregará/recibirá la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). 1 |
| 32 | Subyacente a entregar |  | AN | 18 | 0 | 272 | 289 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. 5 |
| 33 | Subyacente a recibir |  | AN | 18 | 0 | 290 | 307 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. 5 |
| 34 | Divisa del subyacente a entregar |  | AN | 6 | 0 | 308 | 313 | Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 35 | Divisa del subyacente a recibir |  | AN | 6 | 0 | 314 | 319 | Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 36 | Tasa a entregar del siguiente cupón |  | N | 10 | 6 | 320 | 335 | Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 37 | Tasa a recibir del siguiente cupón |  | N | 10 | 6 | 336 | 351 | Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 38 | Sobretasa a entregar |  | N | 3 | 2 | 352 | 356 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 39 | Sobretasa a recibir |  | N | 3 | 2 | 357 | 361 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 40 | Tipo tasa a entregar |  | N | 3 | 0 | 362 | 364 | Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 41 | Tipo tasa a recibir |  | N | 3 | 0 | 365 | 367 | Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 42 | Base de cálculo de la tasa a entregar |  | AN | 10 | 0 | 368 | 377 | Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 43 | Base de cálculo de la tasa a recibir |  | AN | 10 | 0 | 378 | 387 | Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato. 5 |
| 44 | Amortiza Capital |  | N | 1 | 0 | 388 | 388 | Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. 1 |
| 45 | Tipo de intercambios |  | N | 3 | 0 | 389 | 391 | Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. 1 |
| 46 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 392 | 399 | En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se deberán reportar ceros. 1 |
| 47 | Nombre Corto de Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 400 | 419 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 48 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 420 | 427 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 49 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 428 | 447 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 50 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 448 | 450 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 51 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 451 | 454 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso reportar ceros.1, |
| 52 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 455 | 457 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 53 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 458 | 461 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera"  En otro caso reportar ceros.1 |
| 54 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 462 | 462 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |
| 55 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 463 | 482 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 56 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 483 | 496 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.1 |
| 57 | Observaciones y características especiales |  | AN | 117 | 0 | 497 | 613 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 58 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 614 | 621 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. 1 |
| 59 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 622 | 641 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 60 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 642 | 649 | En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso se deberán reportar ceros. 1 |
| 61 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 650 | 669 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 62 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 670 | 677 | En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso se deberán reportar ceros. 1 |
| 63 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 678 | 697 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 64 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_564385.png | N | 14 | 0 | 698 | 711 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados, se deberá registrar un folio consecutivo para cada estrategia definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 65 | Número de Contratos |  | N | 13 | 0 | 712 | 724 | Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos en posición, en valor absoluto.  Se deberá reportar en ceros en otro caso.1 |
| 66 | Espacios en blanco |  | AN | 14 | 0 | 725 | 738 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 5:** CONTIENE LA INFORMACION DE LOS CUPONES DE LAS OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS) Solo se enviará la primera vez que se reporta la información del SWAP o bien cuando algún parámetro del calendario tenga cambios. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_569840.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "305"**. 1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_572437.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_575034.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios.13 |
| 4 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_577631.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_580228.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_582825.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_585422.png | AN | 6 | 0 | 43 | 48 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_588019.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 10 | Unique Swap Identifier |  | AN | 70 | 0 | 68 | 137 | Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. 17 |
| 11 | Tipo de Cupón |  | N | 1 | 0 | 138 | 138 | Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. 1 |
| 12 | Numero de Cupón |  | N | 3 | 0 | 139 | 141 | Comenzando con el cupón vigente. 1 |
| 13 | Fecha Inicio |  | F | 8 | 0 | 142 | 149 | Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. 3 |
| 14 | Fecha Final |  | F | 8 | 0 | 150 | 157 | Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. 3 |
| 15 | Días de cupón |  | N | 3 | 0 | 158 | 160 | Días de cupón. 1 |
| 16 | Monto de referencia para amortizar |  | N | 14 | 6 | 161 | 180 | Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor nocional. 2 |
| 17 | Nocional |  | N | 14 | 6 | 181 | 200 | Se deberá anotar el monto del valor nocional del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. 2 |
| 18 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 201 | 218 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 19 | Sobretasa |  | N | 3 | 2 | 219 | 223 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. 2 |
| 20 | Observaciones o Características Especiales |  | AN | 50 | 0 | 224 | 273 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 21 | Fecha Inicial de Vigencia del cupón |  | F | 8 | 0 | 274 | 281 | Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. 3 |
| 22 | Fecha Final de Vigencia del cupón |  | F | 8 | 0 | 282 | 289 | Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap.3 |
| 23 | Espacios en blanco |  | AN | 449 | 0 | 290 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 6:**CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MINIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS.  A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_596678.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "306".**1 |
| 2 | Tipo Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_599281.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Se deberá anotar el identificador del tipo de la garantía conforme al catálogo Tipo de Garantía. 1 |
| 3 | Estatus de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_601884.png | N | 1 | 0 | 5 | 5 | Se deberá anotar el identificador del "Estatus de la Garantía" conforme a lo siguiente:  1 si la Garantía está en tránsito (confirmada),  2 si la Garantía está en liquidada**.**  3 si la Garantía no fue entregada en la fecha de liquidación pactada. 1 |
| 4 | Fecha de Liquidación | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_604487.png | F | 8 | 0 | 6 | 13 | Se deberá reportar la fecha de liquidación de la Garantía, cuando el "Estatus de la Garantía" sea reportado en "1" (en tránsito).  En caso de que el "Estatus de la Garantía" sea reportado en "2" (liquidada), se deberá reportar 19000101.3 |
| 5 | ISIN de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_607090.png | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | En caso de reportarse valores, se deberá anotar el ISIN proporcionado por el proveedor de precios.  En otro caso se llenará con ceros.5 |
| 6 | Cusip o Cins de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_609693.png | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | En caso de reportarse valores, se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios.  En otro caso se llenará con ceros.13 |
| 7 | Sedol de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_612296.png | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | En caso de reportarse valores, se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionado por el proveedor de precios.  En otro caso se llenará con ceros.14 |
| 8 | Tipo de Valor de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_614899.png | AN | 4 | 0 | 42 | 45 | Se deberá reportar la clave del tipo de valor otorgada por el proveedor de precios.  Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar el tipo de valor asignado por el proveedor de precios al tipo de cambio correspondiente a la divisa de la garantía.  Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EF". 15 |
| 9 | Emisora de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_617502.png | AN | 7 | 0 | 46 | 52 | Se deberá reportar la clave de la emisora otorgada por el proveedor de precios.  Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la emisora asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía.  Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EFECTIV". 15 |
| 10 | Serie de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_620105.png | AN | 7 | 0 | 53 | 59 | Se deberá reportar la serie otorgada por el proveedor de precios.  Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la serie asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía.  Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101.15 |
| 11 | Consecutivo de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_622708.png | AN | 10 | 0 | 60 | 69 | Se deberá reportar en cero justificado a la izquierda.15 |
| 12 | Contraparte de la Garantía | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_625311.png | N | 8 | 0 | 70 | 77 | Identificador de la Contraparte en caso de que la garantía se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 13 | Nombre corto de la contraparte de la garantía |  | AN | 20 | 0 | 78 | 97 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. 5 |
| 14 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 98 | 105 | En el caso que las posiciones de derivados asociadas a la garantía se encuentren listadas en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En otro caso reportar ceros1 |
| 15 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 106 | 125 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 16 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 126 | 133 | En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 17 | Nombre Corto Socio liquidador |  | AN | 20 | 0 | 134 | 153 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 18 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 154 | 161 | En caso de que las posiciones de derivados asociadas a las garantías utilicen una Cámara de Compensación para su liquidación, se deberá reportar su identificador de acuerdo al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 19 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 162 | 181 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 20 | Número de títulos |  | N | 14 | 0 | 182 | 195 | Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá anotar el número de títulos respecto de la garantía recibida o entregada.  Para el caso de efectivo en divisas se deberá reportar el monto nominal de divisas entregadas o recibidas.  Para el caso de garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos. 1 |
| 21 | Valor Unitario a Mercado |  | N | 9 | 6 | 196 | 210 | Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá reportar el valor a mercado unitario en pesos de acuerdo al proveedor de precios.  Para el caso de las garantías entregadas o recibidas en divisas, se deberá anotar el tipo de cambio de la divisa contra el peso de acuerdo al proveedor de precios.  Para el caso de las garantías en pesos se deberá reportar 1. 2 |
| 22 | Valor de mercado en pesos de la garantía |  | N | 14 | 6 | 211 | 230 | Para el caso de valores entregados o recibidos en garantía se deberá anotar el valor total a mercado de las garantías con respecto a los precios del proveedor de precios a la fecha de envío.  Para el caso de las garantías en efectivo en divisas, se deberá reportar el monto entregado o recibido en pesos actualizado con el tipo de cambio a la fecha de envío.  Para el caso de las garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos entregado o recibido.1 |
| 23 | Valor de mercado en divisa |  | N | 14 | 6 | 231 | 250 | Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado en la divisa origen.1 |
| 24 | Intereses Devengados |  | N | 14 | 2 | 251 | 266 | Importe de los Intereses devengados en pesos de las garantías a la fecha del reporte. 2 |
| 25 | Divisa de la Garantía |  | N | 2 | 0 | 267 | 268 | Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas.1 |
| 26 | Traslado de dominio (Prenda Bursátil) |  | N | 2 | 0 | 269 | 270 | Se reportará 01 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes nacionales (prenda bursátil) y 02 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes internacionales (CSA).  Se reportará 00 en otro caso. 1 |
| 27 | Factor de Aforo |  | N | 3 | 4 | 271 | 277 | Se deberá reportar el valor residual después de aplicar el "haircut" o dato de descuento.  Ejemplo: En caso de que se determine un "haircut" o dato de descuento de 10%, se deberá reportar 0.9 1 |
| 28 | Número de contrato |  | AN | 30 | 0 | 278 | 307 | Se deberá reportar el número de contrato marco al amparo del cuál fue entregada o recibida la garantía. 5 |
| 29 | Espacios en blanco |  | AN | 431 | 0 | 308 | 738 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 7:** CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_634496.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "307".** 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_637099.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. 5 |
| 3 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_639702.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_642305.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_644908.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_647511.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_650114.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 8 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_652717.png | AN | 6 | 0 | 44 | 49 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 9 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_655320.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 11 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 69 | 138 | Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. 17 |
| 12 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 139 | 141 | Se registrará el Identificador 1 de manera constante. 1 |
| 13 | Tipo de Operación |  | N | 3 | 0 | 142 | 144 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación:  1 - Largo  2 - Corto  Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. 1 |
| 14 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 145 | 162 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 15 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 163 | 165 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato1 |
| 16 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 166 | 167 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta1. |
| 17 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 168 | 171 | En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 18 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 172 | 179 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 19 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 180 | 187 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 20 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 188 | 195 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout.3 |
| 21 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 196 | 211 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 22 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 212 | 225 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 23 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 226 | 228 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 24 | Precio o Tasa pactada de apertura |  | N | 14 | 7 | 229 | 249 | Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente la operación con puntos forwards integrados en su caso. 2 |
| 25 | Precio o Tasa pactada al cierre de la posición |  | N | 14 | 7 | 250 | 270 | En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros 2 |
| 26 | Monto liquidado al cierre de la posición |  | N | 14 | 2 | 271 | 286 | Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). 2 |
| 27 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 287 | 292 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. 5 |
| 28 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 293 | 293 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. |
| 29 | Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 4 | 0 | 294 | 297 | Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 30 | Emisora del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 7 | 0 | 298 | 304 | Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 31 | Serie del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 6 | 0 | 305 | 310 | Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 32 | Precio de Cheapest to Deliver |  | N | 3 | 6 | 311 | 319 | Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. 2 |
| 33 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 320 | 320 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |
| 34 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 321 | 328 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 35 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 329 | 348 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 36 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 349 | 351 | Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 37 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 352 | 355 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 38 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 39 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 359 | 362 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". 1 |
| 40 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 363 | 512 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 41 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 513 | 532 | Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación.5 |
| 42 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 533 | 546 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.1 |
| 43 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 547 | 554 | En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 44 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 555 | 574 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados"  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 45 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 575 | 582 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 46 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 583 | 602 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 47 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 603 | 610 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 48 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 611 | 630 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 49 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 631 | 638 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 50 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 639 | 658 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 51 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_668129.png | N | 14 | 0 | 659 | 672 | En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 52 | Espacios en blanco |  | AN | 66 | 0 | 673 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 8:** CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_673330.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante** "**308**". 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_675933.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. 5 |
| 3 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_678536.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_681139.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_683742.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_686345.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_688948.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios.5 |
| 8 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_691551.png | AN | 6 | 0 | 44 | 49 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 9 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_694154.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 11 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 69 | 138 | Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. 17 |
| 12 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 139 | 141 | Se registrará el Identificador 1 de manera constante. 1 |
| 13 | Tipo de Operación |  | N | 3 | 0 | 142 | 144 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo  2-Corto  Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. 1 |
| 14 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 145 | 152 | Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. 1 |
| 15 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 153 | 172 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 16 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 173 | 190 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 17 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 191 | 192 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas1. |
| 18 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 193 | 195 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. 1 |
| 19 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 196 | 199 | En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 20 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 200 | 207 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 21 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 208 | 215 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 22 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 216 | 223 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout.3 |
| 23 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 224 | 239 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 24 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 240 | 253 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 25 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 254 | 256 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 26 | Precio o Tasa pactada de apertura |  | N | 14 | 7 | 257 | 277 | Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. 2 |
| 27 | Precio o Tasa pactada al cierre de la posición |  | N | 14 | 7 | 278 | 298 | En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros 2 |
| 28 | Monto liquidado al cierre de la posición |  | N | 14 | 2 | 299 | 314 | Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). 2 |
| 29 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 315 | 320 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas 5 |
| 30 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 321 | 321 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. 5 |
| 31 | Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 4 | 0 | 322 | 325 | Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 32 | Emisora del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 7 | 0 | 326 | 332 | Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 33 | Serie del subyacente Cheapest to Deliver |  | AN | 6 | 0 | 333 | 338 | Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. 5 |
| 34 | Precio de Cheapest to Deliver |  | N | 3 | 6 | 339 | 347 | Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. 2 |
| 35 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 348 | 497 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 36 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 498 | 498 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |
| 37 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 499 | 518 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación.5 |
| 38 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 519 | 532 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.1 |
| 39 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 533 | 540 | Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 40 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 541 | 560 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". 5 |
| 41 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 561 | 568 | Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. 1 |
| 42 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 569 | 588 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 43 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 589 | 596 | Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. 1 |
| 44 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 597 | 616 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 45 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_705451.png | N | 14 | 0 | 617 | 630 | En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 46 | Espacios en blanco |  | AN | 108 | 0 | 631 | 738 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 9:** CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TITULOS OPCIONALES) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_710666.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "309"**. 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_713269.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. 5 |
| 3 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_715872.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_718475.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_721078.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_723681.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_726284.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 15 |
| 8 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_728887.png | AN | 6 | 0 | 44 | 49 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 9 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_731490.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. 16 |
| 11 | Unique Trade Identifier |  | AN | 70 | 0 | 69 | 138 | Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. 17 |
| 12 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 139 | 141 | Se registrará el Identificador 1 de manera constante. 1 |
| 13 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 142 | 149 | En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En otro caso reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar cero. 1 |
| 14 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 150 | 169 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados"  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 15 | Tipo de opción |  | N | 3 | 0 | 170 | 172 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. 1 |
| 16 | Subclase de opción |  | N | 3 | 0 | 173 | 175 | Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. 1 |
| 17 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 176 | 176 | "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. 5 |
| 18 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 177 | 194 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. 5 |
| 19 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 195 | 196 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta1. |
| 20 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 197 | 199 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato1 |
| 21 | Plazo de referencia |  | N | 4 | 0 | 200 | 203 | En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 22 | Fecha de la operación |  | F | 8 | 0 | 204 | 211 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 23 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 212 | 219 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 24 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 220 | 227 | Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout.3 |
| 25 | Fecha de ejercicio vigente |  | F | 8 | 0 | 228 | 235 | Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. 3- |
| 26 | Tipo de operación |  | N | 3 | 0 | 236 | 238 | Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación:  1-Largo  2-Corto  Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición.1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 27 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 239 | 254 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 28 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 255 | 268 | Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. 1 |
| 29 | Divisa del tamaño del contrato o del monto nocional |  | N | 2 | 0 | 269 | 270 | Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 30 | Precio o Tasa pactada de apertura |  | N | 14 | 7 | 271 | 291 | Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. 2 |
| 31 | Precio o Tasa pactada al cierre de la posición |  | N | 14 | 7 | 292 | 312 | En caso de cierre se deberá anotar el strike al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros 2 |
| 32 | Monto liquidado al cierre de la posición |  | N | 14 | 2 | 313 | 328 | Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). 2 |
| 33 | Precio o tasa de ejercicio vigente |  | N | 9 | 6 | 329 | 343 | Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. 2 |
| 34 | Precio o tasa de ejercicio Cap |  | N | 9 | 6 | 344 | 358 | Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 2 |
| 35 | Precio o tasa de ejercicio Floor |  | N | 9 | 6 | 359 | 373 | Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 2 |
| 36 | Estructura de las divisas del precio o tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 374 | 379 | Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado.  En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas 5 |
| 37 | Prima Pactada |  | N | 14 | 6 | 380 | 399 | Se deberá anotar el monto en pesos de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. 2 |
| 38 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 400 | 407 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes.  En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros.1 |
| 39 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 408 | 427 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 40 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 428 | 430 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 41 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 431 | 434 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 42 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 435 | 437 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros.1 |
| 43 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 438 | 441 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera"  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 44 | Observaciones y características especiales |  | AN | 150 | 0 | 442 | 591 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 45 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 592 | 592 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico.1 |
| 46 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 593 | 612 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 47 | Delta de la opción |  | N | 2 | 6 | 613 | 620 | Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 48 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 621 | 634 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. 1 |
| 49 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 635 | 642 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 50 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 643 | 662 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 51 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 663 | 670 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 52 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 671 | 690 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 53 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 691 | 698 | En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 54 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 699 | 718 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. 5 |
| 55 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_745265.png | N | 14 | 0 | 719 | 732 | En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.  En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. 1 |
| 56 | Espacios en Blanco |  | AN | 6 | 0 | 733 | 738 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 10:** CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_750466.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "310"**. 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_753069.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. 5 |
| 3 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_755672.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_758275.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_760878.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_763481.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_766084.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 8 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_768687.png | AN | 6 | 0 | 44 | 49 | Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado.15 |
| 9 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_771290.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. 16 |
| 11 | Unique Swap Identifier |  | AN | 70 | 0 | 69 | 138 | Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. 17 |
| 12 | Estatus de operación |  | N | 3 | 0 | 139 | 141 | Se registrará el Identificador 1 de manera constante. 1 |
| 13 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 142 | 149 | Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. 3 |
| 14 | Fecha de inicio |  | F | 8 | 0 | 150 | 157 | Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. 3 |
| 15 | Tipo de Posición |  | N | 1 | 0 | 158 | 158 | En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2.  Se deberá reportar 1 en otro caso. 1 |
| 16 | Número de cupón vigente a entregar |  | N | 3 | 0 | 159 | 161 | Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 17 | Número de cupón vigente a recibir |  | N | 3 | 0 | 162 | 164 | Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 18 | Plazo de referencia a entregar |  | N | 4 | 0 | 165 | 168 | Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 19 | Plazo de referencia a recibir |  | N | 4 | 0 | 169 | 172 | Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 20 | Días para fijar tasa a entregar |  | N | 3 | 0 | 173 | 175 | Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 21 | Días para fijar tasa a recibir |  | N | 3 | 0 | 176 | 178 | Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 22 | Número de cupones a entregar |  | N | 3 | 0 | 179 | 181 | Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 23 | Número de cupones a recibir |  | N | 3 | 0 | 182 | 184 | Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 24 | Valor nocional |  | N | 14 | 6 | 185 | 204 | Se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar).  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25 | Valor nocional 2 |  | N | 14 | 6 | 205 | 224 | Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir).  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir asumiendo una posición larga en el contrato. 2 |
| 26 | Tipo de cambio pactado |  | N | 12 | 6 | 225 | 242 | Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con nocionales en distinta divisa. 2 |
| 27 | Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado |  | AN | 6 | 0 | 243 | 248 | Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para nocionales, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir según el catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado.  En otro caso se deberá registrar las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos nocionales. 5 |
| 28 | Divisa del nocional a entregar |  | N | 2 | 0 | 249 | 250 | Se registrará el identificador de la divisa del nocional a entregar conforme al catálogo de Divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 29 | Divisa del nocional a recibir |  | N | 2 | 0 | 251 | 252 | Se registrará el identificador de la divisa del nocional a recibir conforme al catálogo de Divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 30 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 253 | 254 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que recibirá/entregará la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). 1 |
| 31 | Subyacente a entregar |  | AN | 18 | 0 | 255 | 272 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. 5 |
| 32 | Subyacente a recibir |  | AN | 18 | 0 | 273 | 290 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco.  Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. 5 |
| 33 | Divisa del subyacente a entregar |  | AN | 3 | 0 | 291 | 293 | Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 34 | Divisa del subyacente a recibir |  | AN | 3 | 0 | 294 | 296 | Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 35 | Tasa a entregar del siguiente cupón |  | N | 10 | 6 | 297 | 312 | Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 36 | Tasa a recibir del siguiente cupón |  | N | 10 | 6 | 313 | 328 | Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 37 | Sobretasa a entregar |  | N | 3 | 2 | 329 | 333 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 38 | Sobretasa a recibir |  | N | 3 | 2 | 334 | 338 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 2 |
| 39 | Tipo tasa a entregar |  | N | 3 | 0 | 339 | 341 | Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 40 | Tipo tasa a recibir |  | N | 3 | 0 | 342 | 344 | Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 1 |
| 41 | Base de cálculo de la tasa a entregar |  | AN | 10 | 0 | 345 | 354 | Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 42 | Base de cálculo de la tasa a recibir |  | AN | 10 | 0 | 355 | 364 | Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. 5 |
| 43 | Amortiza Capital |  | N | 1 | 0 | 365 | 365 | Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. 1 |
| 44 | Tipo de intercambios |  | N | 3 | 0 | 366 | 368 | Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. 1 |
| 45 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 369 | 376 | En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados.  En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se deberán reportar ceros. 1 |
| 46 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 377 | 396 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 47 | Contraparte |  | N | 8 | 0 | 397 | 404 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 48 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 405 | 424 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 49 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 425 | 427 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros 1 |
| 50 | Calificación contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 428 | 431 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro reportar ceros.1, |
| 51 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 432 | 434 | En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 52 | Calificación contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 435 | 438 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera"  En otro caso reportar ceros.1 |
| 53 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 439 | 439 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  1 = Telefónico  2 = Electrónico. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 54 | Número de confirmación de la operación con la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 440 | 459 | Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 55 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 460 | 473 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura.1 |
| 56 | Observaciones y características especiales |  | AN | 117 | 0 | 474 | 590 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. 5 |
| 57 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 591 | 598 | En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. 1 |
| 58 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 599 | 618 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 59 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 619 | 626 | En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 60 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 627 | 646 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 61 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 647 | 654 | En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 62 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 655 | 674 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 63 | Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición |  | N | 14 | 7 | 675 | 695 | En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros 2 |
| 64 | Monto Neto liquidado al cierre de la posición |  | N | 14 | 2 | 696 | 711 | Se deberá anotar el monto neto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). 2 |
| 65 | Folio para estrategia con derivados | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_787513.png | N | 14 | 0 | 712 | 725 | En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.  Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.  En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.  En ningún caso se podrá reutilizar el folio.  Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.1 |
| 66 | Número de Contratos |  | N | 13 | 0 | 726 | 738 | Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos operados, en valor absoluto.1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 11:**CONTIENE LA INFORMACION VIGENTE DE LAS LÍNEAS OPERATIVAS O IMPORTE MÍNIMO DE TRANSFERENCIA (THRESHOLDS O MINIMUM TRANSFER AMOUNT) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION), LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX) ASÍ COMO LOS CONTRATOS QUE CUENTAN CON PRENDA BURSÁTIL.  A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro y contratos que cuenten con prenda bursátil. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_792708.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "311".**1 |
| 2 | Contraparte | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_795305.png | N | 8 | 0 | 4 | 11 | Se deberá reportar el identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. 1 |
| 3 | Nombre Corto contraparte | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_797902.png | AN | 20 | 0 | 12 | 31 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte del contrato limitado a 20 caracteres en caso de no existir identificador para la misma en el catálogo de contrapartes y que, en su caso, deberá coincidir con el nombre reportado en los detalles 1 a 4. 5 |
| 4 | Id Contrato | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_800499.png | N | 2 | 0 | 32 | 33 | Se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE para cada contrato ISDA reportado para cada contraparte, en el presente detalle. No se podrán reutilizar los identificadores para la misma contraparte en ningún caso. 1 |
| 5 | Tipo de Neteo |  | N | 1 | 0 | 34 | 34 | Se deberá anotar el tipo de neteo de derivados establecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para el cómputo de consumo de las líneas operativas (threshold o minimum transfer amount) según el catálogo de "Tipo de Neteo".1 |
| 6 | Threshold establecido por la Contraparte |  | N | 9 | 0 | 35 | 43 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como línea operativa o margen operativo para la SIEFORE.1 |
| 7 | Divisa del Threshold establecido por la Contraparte |  | N | 2 | 0 | 44 | 45 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 8 | Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte |  | N | 9 | 0 | 46 | 54 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como importe mínimo de transferencia para la SIEFORE.1 |
| 9 | Divisa del Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte |  | N | 2 | 0 | 55 | 56 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 10 | Threshold establecido por la SIEFORE |  | N | 9 | 0 | 57 | 65 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como línea operativa o margen operativo para la contraparte.1 |
| 11 | Divisa del Threshold establecido por la SIEFORE |  | N | 2 | 0 | 66 | 67 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 12 | Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la SIEFORE |  | N | 9 | 0 | 68 | 76 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como importe mínimo de transferencia para la contraparte.1 |
| 13 | Divisa del Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la SIEFORE |  | N | 2 | 0 | 77 | 78 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Minimum Transfer Amount establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 14 | Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte |  | N | 9 | 0 | 79 | 87 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como monto independiente.1 |
| 15 | Divisa del Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte |  | N | 2 | 0 | 88 | 89 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 16 | Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE |  | N | 9 | 0 | 90 | 98 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como monto independiente.1 |
| 17 | Divisa del Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE |  | N | 2 | 0 | 99 | 100 | Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 18 | Manejo de Garantías |  | N | 1 | 0 | 101 | 101 | Se deberá registrar 1 si el contrato ISDA prevé manejo de garantías con instrumentos financieros. De lo contrario se deberá reportar cero.1 |
| 19 | Liquidación en Pesos |  | N | 1 | 0 | 102 | 102 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en pesos.  En otro caso reportar 0. |
| 20 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas |  | N | 1 | 0 | 103 | 103 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo I de divisas autorizadas por el CAR.  En otro caso reportar 0.1 |
| 21 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo II de divisas |  | N | 1 | 0 | 104 | 104 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo II de divisas autorizadas por el CAR.  En otro caso reportar 0.1 |
| 22 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo III de divisas |  | N | 1 | 0 | 105 | 105 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo III de divisas autorizadas por el CAR.  En otro caso reportar 0.1 |
| 23 | Número de contrato |  | AN | 30 | 0 | 106 | 135 | Se deberá reportar el número de contrato marco. |
| 24 | Observaciones |  | AN | 603 | 0 | 136 | 738 | En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo "Tipo de Neteo", se deberán reportar características especiales relacionadas con la forma en la que se netean las posiciones para el cómputo de consumos de las líneas operativas establecidas en los contratos de derivados.6 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Básicas)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Voluntarias)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI BANORTE |  | 634 | PROFUTURO |
| 534 | PROFUTURO |  | 644 | SURA |
| 538 | PRINCIPAL |  | 652 | CITIBANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | CITIBANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 568 | COPPEL |  |  |  |
| 578 | PENSIONISSSTE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Complementarias)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Previsión Social)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 334 | PROFUTURO |  | 430 | XXI BANORTE |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001000 | Siefore Inicial | Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE. |
| 002 | 538 | 001000 | Siefore Inicial | Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001000 | Siefore Inicial | Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001000 | Siefore Inicial | Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001000 | Siefore Inicial | Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 552 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 000001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 004 | 430 | 000001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo Aperturas y Cierres** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alta (Cuando no se reporte la posición total a precio ponderado se empleará para posiciones concertadas en la fecha de información) |
| 2 | Baja (Cuando no se reporte la posición total a precio ponderado se empleará para posiciones concertadas en la fecha de información) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |
| 2 | USD | Dólar Americano |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |
| 6 | JPY | Yen Japonés |
| 7 | EUR | Euros |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Opción** | | |  | **Catálogo de Subclase de Opción** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |  | **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Americana | AM |  | 1 | Plain Vanilla | PV |
| 2 | Europea | EU |  | 7 | Otros | OT |
| 100 | Otros | OT |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Estatus de Operación** | |  | **Catálogo de Tipos de Tasa** | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Posición Abierta. |  | 1 | Tasa Fija | TF |
| 7 | Se ejerce la opción (Este estatus se empleará únicamente en la fecha de ejercicio de la opción) |  | 2 | Tasa Variable al Inicio del Cupón | TVI |
|  | 3 | Tasa Variable al Final del Cupón | TVF |
| 8 | Se utiliza el layout de detalle (Estatus para indicar que el instrumento cuenta con un calendario de cupones).  En las fechas que no exista detalle, a reportar, de cupones se empleará el Estatus de Operación 1 |  | 4 | Tasa Variable Promedio | TVP |
|  | 5 | Tasa Capitalizable Simple | TCS |
|  | 6 | Tasa Capitalizable Compuesta | TCC |
|  | 100 | Otros | OTR |
|  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Amortización** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No amortiza |
| 1 | Amortiza pata entrega |
| 2 | Amortiza pata recibir |
| 3 | Amortiza ambas patas |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Intercambios** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No intercambia nocionales |
| 1 | Intercambia nocionales al inicio |
| 2 | Intercambia nocionales al final |
| 3 | Intercambia nocionales al inicio y al final |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Neteo** | | |
| **Identificador** | **Descripción Corta** | **Descripción** |
| 0 | Sin neteo | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que no se podrá dar ningún tipo de compensación entre posiciones con pérdidas y posiciones con ganancias que se tengan abiertas con la contraparte, realizando el cómputo de líneas operativas únicamente con las posiciones que mantienen pérdidas. |
| 1 | Neteo por posición completa de la contraparte | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que se compensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en todas las posiciones abiertas con la contraparte, para el cómputo de consumos de líneas operativas |
| 2 | Neteo por clase de activo de la contraparte | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que se compensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en las posiciones cuyos subyacentes correspondan a la misma clase de activos subyacentes (Bonos, Renta Variable, Divisas, Tasas, etc.), para el cómputo de consumos de líneas operativas. |
| 3 | Neteo por tipo de derivado de la contraparte | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que se compensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en las posiciones por cada tipo de derivado (Forward, Opciones, Swaps), para el cómputo de consumos de líneas operativas. |
| 4 | Neteo de posiciones por subyacente. | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que únicamente se compensarán las pérdidas y ganancias que tengan en común el subyacente, para el cómputo de consumos de líneas operativas. |
| 9 | Otro | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule un tipo de neteo de posiciones distinto a los previamente mencionados. |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Operación** | | |  | **Catálogo de Tipo de Entrega** | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Largo | Co |  | F | Entrega Física |
| 2 | Corto | Ve |  | D | Diferenciales |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH IBCA |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| Calificaciones Corto Plazo en Escala Local | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | **HR D** |  |  | **1056** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Garantía** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | **Garantía otorgada** **por la SIEFORE**enoperaciones con Instrumentos Financieros Derivados. |
| 2 | **Garantía recibida por la SIEFORE** en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Contrapartes** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 2001 | Banco de México |  | 82035 | Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 82037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 82039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 82042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 13006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 82043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |
| 13007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 82044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 13010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 82048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 13011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 82049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 13012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 82050 | Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra |
| 13013 | IXE Casa de Bolsa |  | 82051 | Casa de Bolsa Ve por Más |
| 13015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 13018 | Casa de Bolsa Arka |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 13019 | Value Casa de Bolsa |  | 701001 | Abasis |
| 13020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 701002 | American Express (Extranjero) |
| 13021 | Monex Casa de Bolsa |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 13026 | Vector Casa de Bolsa |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero) |
| 13027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 13032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 13040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |
| 13041 | Invex Casa de Bolsa |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 13104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 13105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 13106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 13109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 13114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 13117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 701014 | Cargill Financial Service International (Extranjero) |
| 13118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 13119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 13120 | UBS Casa de Bolsa |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 13121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 13122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 13123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 13124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 13125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 13126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 13127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 13129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 13130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 13131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 16031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 16035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England |
| 16040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 16041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |
| 16044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 16067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 16240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 16408 | B y B Casa de Cambio |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 16419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero) |
| 16507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 16533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 16587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 16629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 16712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |
| 16714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 16715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 16717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 16718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero) |
| 16719 | Unica Casa de Cambio |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |
| 25001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 25002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero) |
| 25007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 25013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |
| 25014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 37006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 37009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |
| 37019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 37135 | Nacional Financiera |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 37166 | Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 37168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |
| 40002 | Banco Nacional de México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 40012 | BBVA Bancomer |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero) |
| 40014 | Banco Santander |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 40017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 40021 | HSBC México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 40022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 40030 | Banco del Bajío |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 40032 | Ixe Banco |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 40036 | Banco Inbursa |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 40037 | Banco Interacciones |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 40042 | Banca Mifel |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 40044 | Scotiabank Inverlat |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 40058 | Banco Regional de Monterrey |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 40059 | Banco Invex |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 40060 | Bansi |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 40062 | Banca Afirme |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 40072 | Banco Mercantil del Norte |  | 801160 | Acciones Propias |
| 40102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 40103 | American Express Bank (México) |  | 801162 | Bank West |
| 40106 | Bank of America México |  | 801163 | Bcpbank Canada |
| 40108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 801164 | Bridgewater Bank |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 40110 | Banco J.P. Morgan |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 40112 | Banco Monex |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 40113 | Banco Ve por Más |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 40116 | ING Bank (México) |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 40124 | Deutsche Bank México |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 40126 | Banco Credit Suisse México |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 40127 | Banco Azteca |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 40128 | Banco Autofin México |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 40129 | Barclays Bank México |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |
| 40130 | Banco Compartamos |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 40131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 40132 | Banco Multiva |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |
| 40133 | Banco Actinver |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 40134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |
| 40136 | Banco Regional |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 40137 | BanCoppel |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 40138 | Banco Amigo |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |
| 40139 | UBS Bank México |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |
| 40140 | Banco Fácil |  | 801183 | Regions Bank |
| 40141 | Volkswagen Bank |  | 801184 | National City Bank |
| 40142 | El Banco Deuno |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 40143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801186 | State Street B&TC |
| 40144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 40145 | Banco Base |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 40160 | Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 46048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 47005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801191 | North Fork Bank |
| 76000 | Otros Operadores |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 76001 | Derfin |  | 801193 | Bank Of The West |
| 76008 | Stock & Price |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 76010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801195 | Northern TC |
| 76014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 76018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 76022 | Darka |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 76029 | Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 76043 | Timber Hill LLC. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 76044 | Enlace Derivados |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 76048 | Intercam Derivados |  | 801202 | Santander USA |
| 79001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801203 | CME Clearing |
| 79003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A. |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 79004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A. |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 79005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 79006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 79009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 79010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 79012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda |  | 801210 | Natixis |
| 79013 | Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda |  | 801211 | XP Securities LLC |
| 79014 | Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán |  | 801212 | INTL FCStone |
| 79015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A. |  | 801213 | LarrainVial Securities US LLC |
| 79016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801214 | HSBC Securities USA |
| 79017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801215 | Stone Financial Inc. |
| 79018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801216 | ICE Clearing |
| 79022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900000 | Otros Mandatarios o Administradores |
| 79023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 79024 | CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 79025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp. |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 79026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 900004 | Amundi Asset Management |
| 79027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 79028 | BBVA Bancomer USA |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 79029 | Dinero Express |  | 900008 | Ninety One PLC |
| 79030 | Banorte USA Corporation |  | 900009 | Alliance Bernstein |
| 79031 | INB Financial Corp. |  | 900011 | Fidelity International |
| 79032 | INB Delaware Corporation |  | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 79033 | Inter Nacional Bank |  | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 80000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 80001 | Acci Securities Incorporated |  | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 80004 | Afin Securities International Limited |  | 900016 | Vanguard Group |
| 80005 | Arka Securities Incorporated |  | 900017 | Natixis |
| 80008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 80009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 900019 | State Street Corporation |
| 80013 | Vectormex Incorporated |  | 900020 | DWS Investments |
| 80014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900021 | Sherpa Capital |
| 80015 | Vectormex International Incorporated |  | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 80019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900023 | FirstTrust |
| 80020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900024 | Baillie Gifford |
| 80021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900025 | UBS AG |
| 80022 | Valores Finamex Limited |  | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 80023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 80024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900028 | GAM Holding AG |
| 80025 | Monex Securities Incorporated |  | 900029 | Invesco Capital Management |
| 80026 | Invex Incorporated |  | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 80027 | GBM International Incorporated |  | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 80028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 80029 | Portfolio Investment Incorporated |  | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 80030 | Arka International, Corp. |  | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 80031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |  | 900035 | UTI Asset Management |
| 80032 | Banorte Asset Management,Inc. |  | 900036 | Nikko Asset Management |
| 80033 | Afin International Holdings,Inc. |  | 900037 | Global X |
| 80034 | Banorte I, LLC. |  | 900038 | VanEck |
| 80037 | Invex International, S.A. |  | 900039 | KraneShares |
| 80038 | Invex Worldwide, S.A. |  | 900040 | ProShares |
| 80041 | Inbursa International, Inc. |  | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 80042 | Inbursa Securities, Inc. |  | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 80043 | IXE Holdings, Inc. |  | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 82004 | Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba. |  | 900044 | Man Group |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 82006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |  | 900045 | Berenberg |
| 82008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |  | 900046 | Finamex |
| 82009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |  | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |
| 82010 | Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania. |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 82011 | Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur. |  | 920000 | Otros Socios Operadores |
| 82012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
| 82013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |
| 82014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |  | 950000 | Otras Plataformas Electrónicas de Negociación |
| 82016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |  | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 82025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A. |  | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 82027 | Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 82028 | Internacional Oficina de Representación en Madrid, España. |  |  |  |
| 82030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |
| 82031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

Si la cantidad es negativa, se anotará el signo negativo en la 1ª posición de la izquierda, si la cantidad es positiva se anotará un CERO en la 1ª posición de la izquierda.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

El segundo bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha final del periodo.

5 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apostrofes; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

8 La calificación de la contraparte, emisión o emisor se ubicará en alguna de cuatro calificaciones posibles, ésta clasificación es realizada por los Proveedores de Precios y será modificada por éstos conforme a sus procedimientos internos de clasificación y podrá ser diferente entre los diferentes Proveedores de Precios.

12 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

13 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

14 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

15 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas, en caso de no existir se anotará un CERO justificado a la izquierda.

16 Bloomberg Ticker será la clave que asigna Bloomberg al tipo de contrato o producto reportado. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

17 "Unique Trade Identifier" o "Unique Swap Identifier" es la clave única de operación asignada con propósitos de reporte regulatorio, a cada operación de derivados. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO** |

En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:

       1° ISIN, de no existir éste,

       2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

       3° SEDOL.

Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores.

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las indicaciones de cada campo; de lo contrario se llenarán con un CERO y espacios en blanco.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

**Políticas a seguir en la transmisión de la información**

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con éste.

II.     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

III.    Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las SIEFOREs Básicas, SIEFOREs de Aportaciones Voluntarias, SIEFOREs de Aportaciones Complementarias y SIEFOREs de Previsión Social.

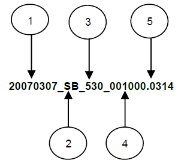
IV.   El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

V.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCION** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad SIEFOREs Básicas, SIEFOREs de Aportaciones Voluntarias, SIEFOREs de Aportaciones Complementarias y SIEFOREs de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 6 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicará para familia de SIEFORES. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será **Constante = "0314"**. |

**NOTA:**   La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

             Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad SIEFORE XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de SIEFORE Básica Inicial, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá de encriptarse con el programa GNUpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20070307\_SB\_530\_001000.0314.gpg**

       Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encriptarlo, sólo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20070307\_SB\_530\_001000.0314**

**NOTA:**No se tomará en cuenta la extensión .gpg, en la recuperación del acuse, como lo muestra el ejemplo, ni vendrá encriptado el acuse.

VI.   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| \*Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

**Anexo 078**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información del desglose de valores en reporto, desglose de valores en préstamo, operaciones compra-venta durante el día, cartera de valores, determinación del precio de la acción y activo total de la sociedad de inversión, desglose de operaciones que se operan en divisas, desglose de valores recibidos en garantía, ingreso y egreso mismo día y fecha valor, depósitos en instituciones financieras y aportaciones iniciales mínimas y excedentes en operaciones con derivados listados, flujos pendientes por liquidar derivados de operaciones en tránsito, y Consumo de límites regulatorios para inversiones Tercerizadas. Se deberá enviar un archivo por SIEFORE". | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE** **TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 343 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

|  |
| --- |
| **ENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1076750.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000".**1 |
| 2 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 4 | 8 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = **Constante**"**343**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1079839.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante"0300".**1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1082436.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave del Tipo de Entidad Siefore a que corresponda la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1085033.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad Siefore a que corresponda la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1087630.png | N | 6 | 0 | 22 | 27 | Clave del Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos.1 |
| 8 | Fecha de Información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1090227.png | F | 8 | 0 | 28 | 35 | Fecha de información correspondiente al día hábil previo al que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 308 | 0 | 36 | 343 | Vacíos.6 |

|  |
| --- |
| **DETALLE(S)** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** DESGLOSE DE VALORES EN REPORTO | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1095523.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "301".**1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1098134.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios.12 |
| 3 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1100745.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios.13 |
| 4 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1103356.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios.14 |
| 5 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1105967.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1108578.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1111189.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1113800.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. 15 |
| 9 | Plazo Total de la Operación de Reporto |  | N | 6 | 0 | 60 | 65 | Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Reporto. 1 |
| 10 | Plazo Actual del Reporto |  | N | 6 | 0 | 66 | 71 | El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. 1 |
| 11 | Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto |  | N | 12 | 0 | 72 | 83 | Número de títulos de los valores recibidos como colateral de la operación en Reporto (unidades).1 |
| 12 | Costo total de adquisición del Reporto |  | N | 14 | 2 | 84 | 99 | Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. 2 |
| 13 | Tasa Premio |  | N | 3 | 3 | 100 | 105 | Tasa Premio pactada del Reporto. 2 |
| 14 | Precio Pactado |  | N | 9 | 6 | 106 | 120 | Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. 2 |
| 15 | Importe pactado de cada operación |  | N | 14 | 2 | 121 | 136 | El valor total de la operación en Reporto al vencimiento, equivalente al costo total de adquisición más el premio pactado. 2 |
| 16 | Premio devengado |  | N | 14 | 2 | 137 | 152 | Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. 2 |
| 17 | Valor razonable |  | N | 14 | 2 | 153 | 168 | Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte2. |
| 18 | Tipo de garantía pactada |  | N | 2 | 0 | 169 | 170 | Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores 1 |
| 19 | Tasa de mercado |  | N | 3 | 3 | 171 | 176 | Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. 2 |
| 20 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 177 | 178 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas1. |
| 21 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 179 | 180 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas.1 |
| 22 | Tipo de cambio pactado |  | N | 9 | 6 | 181 | 195 | Tipo de cambio pactado2, en el reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. 9 |
| 23 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 196 | 201 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. 1 |
| 24 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 202 | 221 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 25 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 222 | 224 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 26 | Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera |  | N | 4 | 0 | 225 | 228 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporto conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 27 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 229 | 231 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 28 | Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda |  | N | 4 | 0 | 232 | 235 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporto conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 29 | Folio de operación |  | N | 12 | 0 | 236 | 247 | Se deberá anotar un folio único por cada operación de reporto definido por la Siefore, el cual está asociado al folio del colateral de la operación en su caso. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Colateral recibido por concepto de operaciones en reporto y garantías recibidas por concepto de préstamos de valores). En caso de no recibir sobrecolateral llenar con ceros. 1 |
| 30 | Espacios en blanco |  | AN | 96 | 0 | 248 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1124497.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "302".**1 |
| 2 | Número consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1127108.png | N | 3 | 0 | 4 | 6 | Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación.1 |
| 3 | Tipo de Inversión |  | N | 2 | 0 | 7 | 8 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente:  0 para Directo, en el caso de llamadas de capital también se deberán reportar con tipo de inversión 0 y como una operación de compra,  1 para Reporto,  6 para Préstamo de Valores,  12 para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos,  13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos,  14 para Inversiones tercerizadas,  16 para operaciones cambiarias de compra o venta de divisas.  Para las operaciones cambiarias se deberán reportar la operación de compra de la divisa recibida y la operación venta de la divisa entregada. 1 |
| 4 | Tipo de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 9 | 10 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. 1 |
| 5 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 11 | 12 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. 1 |
| 6 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1130499.png | AN | 12 | 0 | 13 | 24 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. 12 |
| 7 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1133110.png | AN | 9 | 0 | 25 | 33 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.13 |
| 8 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1135721.png | AN | 7 | 0 | 34 | 40 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios.  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. 14 |
| 9 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1138332.png | AN | 4 | 0 | 41 | 44 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. 5 |
| 10 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1140943.png | AN | 7 | 0 | 45 | 51 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIVO. 5 |
| 11 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1143554.png | AN | 7 | 0 | 52 | 58 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. 15 |
| 12 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1146165.png | AN | 10 | 0 | 59 | 68 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros.15 |
| 13 | Fecha de Liquidación |  | F | 8 | 0 | 69 | 76 | Fecha de Liquidación de la operación. 3 |
| 14 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 77 | 88 | Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. 1 |
| 15 | Costo unitario |  | N | 9 | 6 | 89 | 103 | Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 16 | Costo unitario más intereses devengados |  | N | 9 | 6 | 104 | 118 | Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación).  En caso de que la posición no cuente con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo "Costo unitario".  En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 17 | Monto total a liquidar |  | N | 14 | 2 | 119 | 134 | Monto total a liquidar en la operación en pesos.  En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore.  Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". 2 |
| 18 | Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento |  | N | 6 | 0 | 135 | 140 | Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. 1 |
| 19 | Tasa de rendimiento |  | N | 3 | 3 | 141 | 146 | Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 20 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 147 | 148 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. 1 |
| 21 | Tipo de cambio promedio de adquisición |  | N | 9 | 6 | 149 | 163 | Tipo de cambio9 promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 22 | País de adquisición |  | N | 2 | 0 | 164 | 165 | Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. 1 |
| 23 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 166 | 171 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes.  En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13:  -  En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación.  -  En caso de ser operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del Custodio Internacional, de la Plataforma de Negociación Electrónica o del Administrador con el que haya realizado la operación, según el Catálogo de Contrapartes.  -  En caso de flujos por dividendos o pagos de cupón se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes.  -  En caso de llamadas de capital se deberá reportar el identificador "025002".  En otro caso se deberá llenar con ceros. 1 |
| 24 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 172 | 191 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 25 | Hora de concertación de la operación |  | N | 4 | 0 | 192 | 195 | Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros. 10 |
| 26 | Banco de Trabajo |  | N | 1 | 0 | 196 | 196 | Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. 1 |
| 27 | Medio de concertación |  | N | 1 | 0 | 197 | 197 | Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  0 = No aplica  1 = Telefónico  2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación. 1  En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá considerar lo siguiente:  -    Cuando se realicen a través del Custodio Internacional o del Administrador o Patrocinador del Fondo se deberá indicar 0.  -    Cuando se realicen a través de Plataformas se deberá indicar 2. 1 |
| 28 | Sistema de concertación |  | N | 2 | 0 | 198 | 199 | En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros.  Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado.  0 - No aplica  1 - MEI  2 - SIPO  3 - VAR  4 - MEIPresval  5 - Corros Monex  6 - Bloomberg  7 - Market Axess  8 - Reuters  99 - OTRO. 1  En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos que se realicen a través de medios electrónicos, se deberá indicar 99.1 |
| 29 | Tipo de postura |  | N | 1 | 0 | 200 | 200 | Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta.  1- Agresor  2- Agredido.  Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción.1 |
| 30 | Clase de la Inversión tercerizada |  | N | 3 | 0 | 201 | 203 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros. 1 |
| 31 | Observaciones |  | AN | 20 | 0 | 204 | 223 | Se deberán reportar características especiales que no se incorporen en la información del presente detalle para las operaciones de compra y venta que se realicen en el día. 5 |
| 32 | Compra en mercado primario |  | N | 1 | 0 | 224 | 224 | En caso de reportar compras realizadas en mercado primario anotar 1.  En otro caso se deberá anotar 0. 1 |
| 33 | Espacios en blanco |  | AN | 119 | 0 | 225 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CARTERA DE VALORES | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1156602.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "303"**1**.** |
| 2 | Tipo de Inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1159213.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente:  0 para Directo,  1 para Reporto,  6 para Préstamo de Valores,  7 para Garantías entregadas por operaciones con Instrumentos Financieros Derivados,  11 para el Inst. de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados,  14 para Inversiones Tercerizadas  15 para Garantías entregadas por operaciones con instrumentos estructurados. 1 |
| 3 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 6 | 7 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento1. |
| 4 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1162084.png | AN | 12 | 0 | 8 | 19 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios.  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. 12 |
| 5 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1164695.png | AN | 9 | 0 | 20 | 28 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios.  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.13 |
| 6 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1167306.png | AN | 7 | 0 | 29 | 35 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios.  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. 14 |
| 7 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1169917.png | AN | 4 | 0 | 36 | 39 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. 5 |
| 8 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1172528.png | AN | 7 | 0 | 40 | 46 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. 5 |
| 9 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1175139.png | AN | 7 | 0 | 47 | 53 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. 15 |
| 10 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1177750.png | AN | 10 | 0 | 54 | 63 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. 15 |
| 11 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 64 | 75 | Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. 1 |
| 12 | Costo promedio unitario en pesos de Adquisición |  | N | 9 | 6 | 76 | 90 | En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 13 | Costo Total de Adquisición |  | N | 14 | 2 | 91 | 106 | De acuerdo al Catálogo de Tipos de inversión:  -Si se indica "1" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner el costo total de la operación del reporto sin incluir el premio.  -Si se indica "0, 6, 7, 11" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner costo total de adquisición. Este costo debe ser igual a la cantidad de títulos por el costo promedio unitario.  -En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore.  Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". 2 |
| 14 | Valor unitario a Mercado |  | N | 9 | 6 | 107 | 121 | En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 15 | Valor total a Mercado |  | N | 14 | 2 | 122 | 137 | En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado.  En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". 2 |
| 16 | Intereses Devengados |  | N | 14 | 2 | 138 | 153 | Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. 2 |
| 17 | Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento |  | N | 6 | 0 | 154 | 159 | Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. 1 |
| 18 | País de origen |  | N | 2 | 0 | 160 | 161 | Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario. 1 |
| 19 | Calificadora Emisión primera |  | N | 3 | 0 | 162 | 164 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 20 | Calificación Homologada de la Emisión primera |  | N | 4 | 0 | 165 | 168 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 00001. |
| 21 | Calificadora Emisión segunda |  | N | 3 | 0 | 169 | 171 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 22 | Calificación Homologada de la Emisión segunda |  | N | 4 | 0 | 172 | 175 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. 1 |
| 23 | Calificadora Emisora primera |  | N | 3 | 0 | 176 | 178 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 24 | Calificación Homologada de la Emisora primera |  | N | 4 | 0 | 179 | 182 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000. 1 |
| 25 | Calificadora Emisora segunda |  | N | 3 | 0 | 183 | 185 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 26 | Calificación Homologada de la Emisora segunda |  | N | 4 | 0 | 186 | 189 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000. 1 |
| 27 | Tipo de derecho o modificación accionaría |  | N | 2 | 0 | 190 | 191 | Se deberá anotar el identificador del tipo de derecho o modificación accionaría decretado según el Catálogo de Tipo de Derecho, para cualquier Activo Objeto de Inversión, de lo contrario llenar con ceros. 1 |
| 28 | Fecha en que se decreta el derecho o modificación accionaría |  | F | 8 | 0 | 192 | 199 | Si se ha decretado algún tipo de derecho o modificación accionaría a la fecha del reporte que no haya sido liquidado/ejercido, se deberá anotar la fecha en que se decretó. Solamente en el caso de acciones o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. 3 |
| 29 | Proporción de la modificación accionaría |  | N | 6 | 6 | 200 | 211 | En caso de reportarse algún Tipo de derecho o modificación accionaria en el Id 27, indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones o vehículos (reportar el factor que se multiplica por cada título: #Títulos nuevos / #Títulos anteriores). 2 |
| 30 | Ejercicio del derecho o modificación accionaría |  | N | 1 | 0 | 212 | 212 | En caso de ejercerse en la fecha de información el derecho o modificación accionaría se deberá anotar "1" si no "0". 1 |
| 31 | Monto del Derecho |  | N | 14 | 2 | 213 | 228 | Si el tipo de derecho decretado es pago en efectivo se deberá anotar el monto decretado de pago por unidad accionaria o por título del vehículo. 2 |
| 32 | Valor Nominal Actualizado |  | N | 14 | 6 | 229 | 248 | Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos), Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen).  En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. 1 |
| 33 | Títulos en circulación |  | N | 14 | 0 | 249 | 262 | Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia.En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. 1 |
| 34 | Valor Nominal Inicial |  | N | 14 | 6 | 263 | 282 | Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0(Denominado en moneda de origen).  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. 1 |
| 35 | Títulos en Circulación Inicial |  | N | 14 | 0 | 283 | 296 | Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia.En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. 1 |
| 36 | Folio para cobertura de divisas |  | N | 14 | 0 | 297 | 310 | En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura.  En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso.  La cobertura deberá ser total de manera obligatoria.  Indicar cero si no corresponde a una cobertura. 1 |
| 37 | Clase de la Inversión tercerizada |  | N | 3 | 0 | 311 | 313 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. 1 |
| 38 | Aviso de Recomposición |  | N | 1 | 0 | 314 | 314 | Se deberá anotar el identificador con forme al catálogo de Aviso de Recomposición. 1 |
| 39 | Índice de Mandato |  | N | 3 | 8 | 315 | 325 | Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberá reportar el índice del mandato (truncado a 8 decimales) construido con base 1, afectado por la rentabilidad en pesos diaria del Mandato. En otro caso llenar con ceros. 2 |
| 40 | Observaciones |  | AN | 18 | 0 | 326 | 343 | Si el tipo de derecho o modificación accionaría es "8" se deberá especificar el nombre anterior de la emisora. Si el tipo de derecho o modificación accionaría es "10" se deberá especificar el instrumento anterior utilizando el formato de Tipo Valor, Emisora y Serie respetando la longitud de dichos indicadores de 4, 7 y 7 respectivamente, los espacios en blanco deberán de ir a la izquierda dejando en blanco los que no se ocupen y sin espacios intermedios5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4:** DETERMINACION DEL PRECIO DE LA ACCION Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1190457.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "304**".1 |
| 2 | Capital Contable (Activo Total de la Sociedad de Inversión) |  | N | 14 | 2 | 4 | 19 | Es el capital contable, la suma del Activo Administrado por una Sociedad de Inversión y de los Activos Administrados por los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. 2 |
| 3 | Activo Administrado por la Sociedad de Inversión |  | N | 14 | 2 | 20 | 35 | Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión directamente gestionado en materia de inversiones por ésta, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales.2 |
| 4 | Activo Administrado por los Mandatarios |  | N | 14 | 2 | 36 | 51 | Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión que se encuentre bajo la gestión financiera de los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales.2 |
| 5 | Acciones en circulación finales |  | N | 12 | 0 | 52 | 63 | Es la cantidad de acciones en circulación en día que se está reportando. 1 |
| 6 | Precio de la acción |  | N | 9 | 6 | 64 | 78 | Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales 2 |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 265 | 0 | 79 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 5:** COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTO Y PRÉSTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1197008.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "305".**1 |
| 2 | Tipo de Inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1199619.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente:  8 para Garantías recibidas por operaciones de Reporto,  10 para Garantías recibidas por Préstamo de Valores. 1 |
| 3 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 6 | 7 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. 1 |
| 4 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1202490.png | AN | 12 | 0 | 8 | 19 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 5 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1205101.png | AN | 9 | 0 | 20 | 28 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 6 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1207712.png | AN | 7 | 0 | 29 | 35 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 7 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1210323.png | AN | 4 | 0 | 36 | 39 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. 5 |
| 8 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1212934.png | AN | 7 | 0 | 40 | 46 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. 5 |
| 9 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1215545.png | AN | 7 | 0 | 47 | 53 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.15 |
| 10 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1218156.png | AN | 10 | 0 | 54 | 63 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. 15 |
| 11 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 64 | 75 | Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). 1 |
| 12 | Costo unitario original en pesos |  | N | 9 | 6 | 76 | 90 | En este campo se debe poner el costo unitario original al que se recibió. 2 |
| 13 | Costo Total Original |  | N | 14 | 2 | 91 | 106 | Se debe poner el costo total original al que se recibió la posición en garantía. Este valor debe ser igual al costo unitario original por el número de títulos. 2 |
| 14 | Valor unitario a Mercado |  | N | 9 | 6 | 107 | 121 | En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte.2 |
| 15 | Valor total a Mercado |  | N | 14 | 2 | 122 | 137 | En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. 2 |
| 16 | Intereses Devengados |  | N | 14 | 2 | 138 | 153 | Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. 2 |
| 17 | Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento |  | N | 6 | 0 | 154 | 159 | Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión.1 |
| 18 | País de origen |  | N | 2 | 0 | 160 | 161 | Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. 1 |
| 19 | Calificadora Emisión primera |  | N | 3 | 0 | 162 | 164 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 20 | Calificación Homologada de la Emisión primera |  | N | 4 | 0 | 165 | 168 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 21 | Calificadora Emisión segunda |  | N | 3 | 0 | 169 | 171 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 22 | Calificación Homologada de la Emisión segunda |  | N | 4 | 0 | 172 | 175 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 23 | Calificadora Emisora primera |  | N | 3 | 0 | 176 | 178 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 24 | Calificación Homologada de la Emisora primera |  | N | 4 | 0 | 179 | 182 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25 | Calificadora Emisora segunda |  | N | 3 | 0 | 183 | 185 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 26 | Calificación Homologada de la Emisora segunda |  | N | 4 | 0 | 186 | 189 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 27 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 190 | 195 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes1. |
| 28 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 196 | 215 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 29 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 216 | 218 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 30 | Calificación Homologada de la Contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 219 | 222 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 31 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 223 | 225 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 32 | Calificación Homologada de la Contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 226 | 229 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 33 | Folio de operación |  | N | 12 | 0 | 230 | 241 | Se deberá anotar el folio asociado a la operación de reporto o préstamo de valores definido por la Siefore, el cual deberá ser el mismo reportado en los detalle 1 (Desglose de Valores en Reporto) y 6 (Desglose de valores en préstamo) respectivamente1. |
| 34 | Espacios en blanco |  | AN | 102 | 0 | 242 | 343 | Vacíos6. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 6:** DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1229373.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "306".**1 |
| 2 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1231984.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1234595.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1237206.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1239817.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. 5 |
| 6 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1242428.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. 5 |
| 7 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1245039.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. 15 |
| 8 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1247650.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. 15 |
| 9 | Plazo Total de la Operación de Préstamo de Valores |  | N | 6 | 0 | 60 | 65 | Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. Se mantendrá constante en tanto el instrumento se encuentre en préstamo.1 |
| 10 | Plazo Actual de la Operación de Préstamo de Valores |  | N | 6 | 0 | 66 | 71 | Número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. 1 |
| 11 | Cantidad de Títulos en préstamo |  | N | 12 | 0 | 72 | 83 | Número de títulos en préstamo (en unidades). 1 |
| 12 | Valor inicial de mercado del Préstamo de Valores |  | N | 9 | 6 | 84 | 98 | Precio unitario pactado para la operación de Préstamo de Valores en pesos. 2 |
| 13 | Valor inicial total de mercado del Préstamo de Valores |  | N | 14 | 2 | 99 | 114 | Valor inicial total de la operación de Préstamo de Valores sin incluir el premio en pesos. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por valor inicial de mercado. 2 |
| 14 | Importe pactado de cada operación |  | N | 14 | 2 | 115 | 130 | El valor total de la operación de Préstamo de Valores al vencimiento, equivalente al valor inicial total de mercado más el premio pactado2. |
| 15 | Tasa Premio |  | N | 3 | 3 | 131 | 136 | Tasa Premio pactada para el Préstamo de Valores. 2 |
| 16 | Premio devengado |  | N | 14 | 2 | 137 | 152 | Premio devengado del Préstamo de Valores a la fecha del reporte. 2 |
| 17 | Tipo de garantía pactada |  | N | 2 | 0 | 153 | 154 | Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores. 1 |
| 18 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 155 | 156 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa del activo objeto del Préstamo de Valores según el Catálogo de Divisas1. |
| 19 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 157 | 158 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el premio de la operación según el Catálogo de Divisas. 1 |
| 20 | Tipo de cambio pactado |  | N | 9 | 6 | 159 | 173 | Tipo de cambio9 pactado para la liquidación del premio, en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. Para la liquidación del premio en pesos mexicanos reportar 1. 2 |
| 21 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 174 | 179 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 22 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 180 | 199 | Se deberá anotar el nombre de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 23 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 200 | 202 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 24 | Calificación Homologada de la Contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 203 | 206 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 25 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 207 | 209 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 26 | Calificación Homologada de la Contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 210 | 213 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 27 | Folio de operación |  | N | 12 | 0 | 214 | 225 | Se deberá anotar un folio único por cada operación de préstamo de valores definido por la Siefore, el cual está asociado al folio de garantía de la operación. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Garantías recibidas por concepto de operaciones en reporto, prestamos de valores y derivados que no forman parte del activo total de la sociedad de inversión). 1 |
| 28 | Espacios en blanco |  | AN | 118 | 0 | 226 | 343 | Vacíos6. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 7:** ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIENTEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1257769.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "307".**1 |
| 2 | Número de Movimiento | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1260372.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Se deberá señalar un número de movimiento definido por la SIEFORE el cual se incrementará por cada nuevo movimiento o flujo reportado,  El número de movimiento deberá iniciar en 1 cada día.1 |
| 3 | Tipo de inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1262975.png | N | 2 | 0 | 8 | 9 | Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión del activo financiero del que derive el flujo o movimiento de efectivo conforme al Catálogo de Tipo de Inversión. 1 |
| 4 | Tipo de valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1265578.png | AN | 4 | 0 | 10 | 13 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar MDT.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el tipo de valor asignado por el proveedor a la divisa del flujo, o EF si se encuentra denominado en pesos. 5 |
| 5 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1268181.png | AN | 7 | 0 | 14 | 20 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.  En caso de ser Inversiones tercerizadas deberá ser definido por la SIEFORE para cada mandatario.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la emisora asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o EFECTIV si se encuentra denominado en pesos. 5 |
| 6 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1270784.png | AN | 7 | 0 | 21 | 27 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.  En caso de ser Inversiones tercerizadas será un consecutivo definido por la SIEFORE el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la serie asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o 990101 si se encuentra denominado en pesos. 15 |
| 7 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1273387.png | AN | 10 | 0 | 28 | 37 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. Para el caso de Inversiones tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión tercerizada. 15 |
| 8 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1275990.png | AN | 12 | 0 | 38 | 49 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. 12 |
| 9 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1278593.png | AN | 9 | 0 | 50 | 58 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. 13 |
| 10 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1281196.png | AN | 7 | 0 | 59 | 65 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. 14 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 11 | Tipo de flujo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1283799.png | N | 2 | 0 | 66 | 67 | Se deberá reportar el tipo de flujo según el Catálogo de Tipos de Flujo.  Para el caso de los flujos por dividendos y distribuciones de efectivo estos deberán ser reportados en la fecha exderecho.  Aquí se deberán reportar las comisiones de cualquier tipo (comisiones sobre saldo, las comisiones Mexder, la tasa PAI, las comisiones de los Brókers, etc) y se deberá especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" del presente detalle el tipo de comisión.1 |
| 12 | Descriptivo de tipo de flujo |  | AN | 30 | 0 | 68 | 97 | En caso de utilizar el identificador "99 - Otros flujos" en el campo "Tipo de flujo", se deberá registrar un nombre descriptivo del tipo de flujo que se está reportando. 5 |
| 13 | Contraparte flujo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1286654.png | N | 6 | 0 | 98 | 103 | Se deberá anotar el identificador de la Contraparte liquidadora de conformidad con el Catálogo de Contrapartes. 1  En caso de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del administrador de acuerdo al Catálogo de Contrapartes 1 |
| 14 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 104 | 123 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte liquidadora limitado a 20 caracteres cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 15 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 124 | 131 | Se deberá reportar la fecha de liquidación del flujo. 3 |
| 16 | Títulos o unidades |  | N | 12 | 0 | 132 | 143 | Se deberá reportar el número de títulos o unidades del Activo Objeto de Inversión de los cuales se deriva el flujo reportado.  Para el caso de swaps se deberá reportar el monto nocional utilizado para valuar la posición con el precio otorgado por el proveedor de precios. Para el caso de operaciones con derivados se deberá reportar el producto de número de contratos por tamaño de contratos.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el número de divisas o pesos de los cuales se deriva el flujo reportado.1 |
| 17 | Divisa | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1290013.png | N | 2 | 0 | 144 | 145 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se encuentra denominado el flujo reportado. 1 |
| 18 | Divisa de liquidación |  | N | 2 | 0 | 146 | 147 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se liquidará el flujo reportado. 1 |
| 19 | Tipo de cambio aplicado |  | N | 9 | 6 | 148 | 162 | Se deberá anotar el tipo de cambio aplicado para valuar en pesos mexicanos el flujo denominado en divisas, o 1 si el flujo está denominado en pesos mexicanos. 2 |
| 20 | Dirección del flujo |  | N | 1 | 0 | 163 | 163 | Se deberá reportar un 1 si se trata de un flujo de entrada a la cartera de la SIEFORE.  Se deberá reportar un 2 si se trata de un flujo de salida a la cartera de la SIEFORE. 1 |
| 21 | Monto de flujo en Divisa |  | N | 14 | 2 | 164 | 179 | Monto total del flujo expresado en la divisa en la que se encuentra denominado. 2 |
| 22 | Monto de flujo en pesos mexicanos |  | N | 14 | 2 | 180 | 195 | Monto total del flujo expresado en pesos mexicanos. 6 |
| 23 | Espacios en blanco |  | AN | 148 | 0 | 196 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 8:** DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1296494.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "308".**1 |
| 2 | Contraparte | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1299105.png | N | 6 | 0 | 4 | 9 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMS excedentes) se deberá reportar el identificador del Socio Liquidador.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) se deberá reportar el identificador de la Cámara de compensación. 1 |
| 3 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 10 | 29 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMS excedentes) y no exista identificador para el Socio Liquidador en el catálogo se deberá reportar el nombre corto del Socio Liquidador.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) y no exista identificador para la Cámara de Compensación en el catálogo se deberá reportar el nombre corto de la Cámara de Compensación.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 4 | Divisa | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1301976.png | N | 2 | 0 | 30 | 31 | Se reportará el identificador de la de la divisa en la cual está denominado el depósito o en su caso la aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados según el "Catálogo de Divisas". 1 |
| 5 | Monto en divisa |  | N | 12 | 2 | 32 | 45 | Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de liquidación. 2 |
| 6 | Monto |  | N | 12 | 2 | 46 | 59 | En este campo se debe reportar el valor en pesos mexicanos del depósito o en su caso aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados. 2 |
| 7 | Tipo de Depósito | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1305107.png | N | 1 | 0 | 60 | 60 | Se deberá anotar el tipo de depósito según el catálogo de tipo de depósito. 1 |
| 8 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 61 | 63 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 9 | Calificación Homologada de la Contraparte primera |  | N | 4 | 0 | 64 | 67 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 10 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 68 | 70 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. 1 |
| 11 | Calificación Homologada de la Contraparte segunda |  | N | 4 | 0 | 71 | 74 | Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 12 | Espacios vacíos |  | AN | 269 | 0 | 75 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 9:** FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRÁNSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1311398.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "309".**1 |
| 2 | Divisa del Flujo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1314009.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se reportará el identificador de la divisa en la que se liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas". 1 |
| 3 | Tipo de Operación | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1316620.png | N | 1 | 0 | 6 | 6 | Indicar 1 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reportad es de entrada 2 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de salida. 1 |
| 4 | Monto por liquidar |  | N | 12 | 2 | 7 | 20 | Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, en pesos mexicanos, para la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar. 2 |
| 5 | Monto en divisa |  | N | 12 | 2 | 21 | 34 | Se deberán reportar los flujos netos totales que estén pendientes por liquidar en la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle. 2 |
| 6 | Espacios vacíos |  | AN | 309 | 0 | 35 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 10:** CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1322377.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "310".**1 |
| 2 | Identificador Mandato | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1324988.png | AN | 4 | 0 | 4 | 7 | Se indicará el valor constante MDT. 5 |
| 3 | Identificador Mandatario | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1327599.png | AN | 7 | 0 | 8 | 14 | Deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Emisora reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. 5 |
| 4 | Consecutivo mandato | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1330210.png | AN | 7 | 0 | 15 | 21 | Deberá ser un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Serie reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. 5 |
| 5 | Límite establecido para valores extranjeros |  | N | 14 | 2 | 22 | 37 | Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en valores extranjeros en el mandato.1 |
| 6 | Consumo del límite para valores extranjeros |  | N | 14 | 2 | 38 | 53 | Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en valores extranjeros. 1 |
| 7 | Límite establecido para Renta Variable |  | N | 14 | 2 | 54 | 69 | Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en renta variable en el mandato. 1 |
| 8 | Consumo del límite para Renta Variable |  | N | 14 | 2 | 70 | 85 | Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en renta variable. 1 |
| 9 | Límite establecido para Mercancías |  | N | 14 | 2 | 86 | 101 | Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en mercancías. 1 |
| 10 | Consumo del límite para Mercancías |  | N | 14 | 2 | 102 | 117 | Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en mercancías. 1 |
| 11 | Límite establecido para Divisas |  | N | 14 | 2 | 118 | 133 | Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en divisas. 1 |
| 12 | Consumo del límite para divisas |  | N | 14 | 2 | 134 | 149 | Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en divisas. 1 |
| 13 | Límite establecido para Medida de Control de Riesgo |  | N | 3 | 8 | 150 | 160 | Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecido por la Siefore correspondiente al límite de medida de control de riesgo. 1 |
| 14 | Consumo del límite para Medida Control de Riesgo |  | N | 3 | 6 | 161 | 169 | Se deberá anotar el límite consumido, en porcentaje (truncado a 6 decimales), por el mandato correspondiente al límite de medida de control de riesgo. 1 |
| 15 | Espacios vacíos |  | AN | 174 | 0 | 170 | 343 | Vacíos. 6 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Básicas)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Voluntarias)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI BANORTE |  | 634 | PROFUTURO |
| 534 | PROFUTURO |  | 644 | SURA |
| 538 | PRINCIPAL |  | 652 | CITIBANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | CITIBANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 568 | COPPEL |  |  |  |
| 578 | PENSIONISSSTE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Complementarias)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Previsión Social)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 334 | PROFUTURO |  | 430 | XXI BANORTE |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001000 | Siefore Inicial | Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE. |
| 002 | 538 | 001000 | Siefore Inicial | Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001000 | Siefore Inicial | Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001000 | Siefore Inicial | Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001000 | Siefore Inicial | Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 000001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 004 | 430 | 000001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 000004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Inversión** | | |  | **Catálogo de Tipo de Liquidación** | | |
| **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |  | **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 0 | Di | Directo |  | 1 | MD | Mismo Día |
| 1 | Re | Reporto |  | 2 | 24 | 24 Hrs. |
| 6 | Pv | Préstamo de Valores |  | 3 | 48 | 48 Hrs. |
| 7 | Gd | Garantías entregadas por operaciones con IFD |  | 4 | 72 | 72 Hrs. |
| 8 | Gr | Garantías recibidas por operaciones de Reporto |  | 5 | 96 | 96 Hrs. |
| 10 | Gp | Garantías recibidas por Préstamo de Valores |  | 6 | 120 | 120 Hrs. |
| 11 | Ce | Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados |  | 7 | 144 | 144 Hrs. |
| 12 | Ef | Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa |  | 8 | 168 | 168 Hrs. |
| 13 | Ec | Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa. |  | 9 | 192 | 192 Hrs. |
| 14 | It | Inversiones tercerizadas |  |  |  |  |
| 15 | Ge | Garantías entregadas por instrumentos Estructurados |  |  |  |  |
| 16 | Oc | Operaciones Cambiarias de compra o venta de divisas. |  |  |  |  |
| 17 | Er | Garantías entregadas por operaciones de Reporto |  |  |  |  |
| 18 | Ep | Garantías entregadas por operaciones de Préstamo de Valores |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de flujo** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Flujo por pago de cupón |
| 02 | Flujo por amortización parcial o total |
| 03 | Flujo por dividendos (reportado en fecha exderecho) |
| 04 | Flujo por distribuciones de efectivo (reportado en fecha exderecho) |
| 05 | Flujo por pago de cupones en swaps |
| 06 | Flujo por liquidación diaria de derivados listados |
| 07 | Flujo por pago de intereses sobre depósitos en efectivo y por AIMS excedentes |
| 08 | Flujo por comisiones (Especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" la descripción del tipo de comisión.) |
| 09 | Liquidación de Comisiones sobre saldo |
| 10 | Flujo por ajuste de valuación en instrumentos derivados. |
| 11 | Flujo por liquidación de reembolso del Fondo Mutuo |
| 12 | Flujo por garantías recibidas en efectivo por IFD |
| 99 | Otros flujos |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |  | **Catálogo de Tipo de Instrumento** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |  | **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |  | 1 | BCC | Bono Cupón Cero |
| 2 | USD | Dólar Americano |  | 2 | BTF | Bono Tasa Fija |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |  | 3 | TFA | Bono Tasa Fija Amortizable |
| 6 | JPY | Yen Japonés |  | 4 | BTV | Bono Tasa Flotante |
| 7 | EUR | Euros |  | 5 | TVA | Bono Tasa Flotante Amortizable |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |  | 6 | ACC | Acciones |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |  | 7 | ETF | Exchange Traded Funds |
| 10 | CHF | Franco Suizo |  | 8 | NEP | Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |  | 9 | TRK | Instrumentos conocidos como Trackers |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |  | 10 | EFF | Efectivo |
| 13 | DKK | Corona Danesa |  | 11 | OTR | Otro tipo de instrumento no incluido |
| 14 | SEK | Corona Sueca |  | 12 | MDT | Inversión Tercerizada |
| 15 | NOK | Corona Noruega |  | 13 | EVS | Estructura vinculada a Subyacente |
| 16 | BRL | Real Brasileño |  | 14 | FMU | Fondo Mutuo |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |  |  |  |  |
| 18 | CLP | Peso Chileno |  |  |  |  |
| 19 | INR | Rupia |  |  |  |  |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |  |  |  |  |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |  |  |  |  |
| 22 | CZK | Corona checa |  |  |  |  |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |  |  |  |  |
| 24 | RON | Leu Rumano |  |  |  |  |
| 25 | LVL | Lats Letones |  |  |  |  |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |  |  |  |  |
| 27 | EEK | Corona Estonia |  |  |  |  |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |  |  |  |  |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |  |  |  |  |
| 30 | COP | Peso Colombiano |  |  |  |  |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |  |  |  |  |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |  |  |  |  |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |  |  |  |  |
| 99 | OTR | Otras Divisas |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 2 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 3 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 4 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 5 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 6 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 7 | España |  | 33 | Brasil |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 9 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  | 52 | Croacia |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Sistema de Concertación** | |  | **Catálogo de Intermediación** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No aplica |  | 0 | Por cuenta propia |
| 1 | MEI |  | 1 | Banco de trabajo |
| 2 | SIPO |  | 9 | Otro |
| 3 | VAR |  |  |  |
| 4 | MEIPresval |  |  |  |
| 5 | Corros Monex |  |  |  |
| 6 | Bloomberg |  |  |  |
| 7 | Market Axess |  |  |  |
| 8 | Reuters |  |  |  |
| 99 | OTRO |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Derechos** | |  | **Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos**  **y Préstamo de Valores** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Dividendos en efectivo |  | 0 | Ninguna, el reporto o préstamo de valores no se encuentra garantizado |
| 2 | Dividendos en acciones |  | 1 | Caución bursátil |
| 3 | Escisión |  | 2 | Prenda |
| 4 | Fusión |  | 3 | Fideicomiso de garantía |
| 5 | Cambio de Valor Nominal |  | 4 | Depósito bancario de dinero |
| 6 | Split |  |  |  |
| 7 | Split Inverso |  |  |  |
| 8 | Cambio de emisora |  |  |  |
| 9 | Cambio de serie |  |  |  |
| 10 | Canjes |  |  |  |
| 11 | Derechos por Instrumentos Estructurados o Fibras |  |  |  |
| 12 | Suscripción de Acciones |  |  |  |
| 13 | Otro |  |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | **HR D** |  |  | **1056** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Operación** | | | |
| **Identificador** | **Clasificación** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 1 | 001-250 | Co | Compra |
| 2 | 501-750 | Ve | Venta |
| 3 | 251-400 | Ac | Compra por amortización |
| 4 | 751-900 | Av | Venta por amortización total o parcial |
| 5 | 401-500 | Gc | Compra por ejercicio de garantías |
| 6 | 901-999 | Gv | Venta por ejercicio de garantías |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Clase de Inversión Tercerizada** | |
| Identificador | **Descripción** |
| 0 | No aplica (solamente cuando no sea mandato) |
| 1 | Mercancías. |
| 2 | Renta Variable. |
| 3 | Deuda Extranjera |
| 4 | Tipos de Cambio. |
| 9 | Mixto. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Contrapartes** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 2001 | Banco de México |  | 82035 | Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 82037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 82039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 13005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 82042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 13006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 82043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |
| 13007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 82044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 13010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 82048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 13011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 82049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 13012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 82050 | Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra |
| 13013 | IXE Casa de Bolsa |  | 82051 | Casa de Bolsa Ve por Más |
| 13015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 13018 | Casa de Bolsa Arka |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 13019 | Value Casa de Bolsa |  | 701001 | Abasis |
| 13020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 701002 | American Express (Extranjero) |
| 13021 | Monex Casa de Bolsa |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 13026 | Vector Casa de Bolsa |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero) |
| 13027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 13032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 13040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |
| 13041 | Invex Casa de Bolsa |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 13104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 13105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 13106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 13109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 13114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 13117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 701014 | Cargill Financial Service International (Extranjero) |
| 13118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 13119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 13120 | UBS Casa de Bolsa |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 13121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 13122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 13123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 13124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 13125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 13126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 13127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 13129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 13130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 13131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 16031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 16035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England |
| 16040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 16041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |
| 16044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 16067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 16240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 16408 | B y B Casa de Cambio |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 16419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero) |
| 16507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 16533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 16587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 16629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 16712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |
| 16714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 16715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 16717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 16718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero) |
| 16719 | Unica Casa de Cambio |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |
| 25001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 25002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero) |
| 25007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 25013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |
| 25014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 37006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 37009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |
| 37019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 37135 | Nacional Financiera |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 37166 | Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 37168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |
| 40002 | Banco Nacional de México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 40012 | BBVA Bancomer |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero) |
| 40014 | Banco Santander |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 40017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 40021 | HSBC México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 40022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 40030 | Banco del Bajío |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 40032 | Ixe Banco |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 40036 | Banco Inbursa |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 40037 | Banco Interacciones |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 40042 | Banca Mifel |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 40044 | Scotiabank Inverlat |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 40058 | Banco Regional de Monterrey |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 40059 | Banco Invex |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 40060 | Bansi |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 40062 | Banca Afirme |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 40072 | Banco Mercantil del Norte |  | 801160 | Acciones Propias |
| 40102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 40103 | American Express Bank (México) |  | 801162 | Bank West |
| 40106 | Bank of America México |  | 801163 | Bcpbank Canada |
| 40108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 801164 | Bridgewater Bank |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 40110 | Banco J.P. Morgan |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 40112 | Banco Monex |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 40113 | Banco Ve por Más |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 40116 | ING Bank (México) |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 40124 | Deutsche Bank México |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 40126 | Banco Credit Suisse México |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 40127 | Banco Azteca |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 40128 | Banco Autofin México |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 40129 | Barclays Bank México |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |
| 40130 | Banco Compartamos |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 40131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 40132 | Banco Multiva |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |
| 40133 | Banco Actinver |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 40134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |
| 40136 | Banco Regional |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 40137 | BanCoppel |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 40138 | Banco Amigo |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |
| 40139 | UBS Bank México |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |
| 40140 | Banco Fácil |  | 801183 | Regions Bank |
| 40141 | Volkswagen Bank |  | 801184 | National City Bank |
| 40142 | El Banco Deuno |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 40143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801186 | State Street B&TC |
| 40144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 40145 | Banco Base |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 40160 | Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 46048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 47005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801191 | North Fork Bank |
| 76000 | Otros Operadores |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 76001 | Derfin |  | 801193 | Bank Of The West |
| 76008 | Stock & Price |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 76010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801195 | Northern TC |
| 76014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 76018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 76022 | Darka |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 76029 | Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 76043 | Timber Hill LLC. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 76044 | Enlace Derivados |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 76048 | Intercam Derivados |  | 801202 | Santander USA |
| 79001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801203 | CME Clearing |
| 79003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A. |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 79004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A. |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 79005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 79006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 79009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 79010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 79012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda |  | 801210 | Natixis |
| 79013 | Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda |  | 801211 | XP Securities LLC |
| 79014 | Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán |  | 801212 | INTL FCStone |
| 79015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A. |  | 801213 | LarrainVial Securities US LLC |
| 79016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801214 | HSBC Securities USA |
| 79017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801215 | Stone Financial Inc. |
| 79018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801216 | ICE Clearing |
| 79022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900000 | Otros Mandatarios o Administradores |
| 79023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A. |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 79024 | CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 79025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp. |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 79026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 900004 | Amundi Asset Management |
| 79027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 79028 | BBVA Bancomer USA |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 79029 | Dinero Express |  | 900008 | Ninety One PLC |
| 79030 | Banorte USA Corporation |  | 900009 | Alliance Bernstein |
| 79031 | INB Financial Corp. |  | 900011 | Fidelity International |
| 79032 | INB Delaware Corporation |  | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 79033 | Inter Nacional Bank |  | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 80000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 80001 | Acci Securities Incorporated |  | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 80004 | Afin Securities International Limited |  | 900016 | Vanguard Group |
| 80005 | Arka Securities Incorporated |  | 900017 | Natixis |
| 80008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 80009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 900019 | State Street Corporation |
| 80013 | Vectormex Incorporated |  | 900020 | DWS Investments |
| 80014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900021 | Sherpa Capital |
| 80015 | Vectormex International Incorporated |  | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 80019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900023 | FirstTrust |
| 80020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900024 | Baillie Gifford |
| 80021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900025 | UBS AG |
| 80022 | Valores Finamex Limited |  | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 80023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 80024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900028 | GAM Holding AG |
| 80025 | Monex Securities Incorporated |  | 900029 | Invesco Capital Management |
| 80026 | Invex Incorporated |  | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 80027 | GBM International Incorporated |  | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 80028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 80029 | Portfolio Investment Incorporated |  | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 80030 | Arka International, Corp. |  | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 80031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |  | 900035 | UTI Asset Management |
| 80032 | Banorte Asset Management,Inc. |  | 900036 | Nikko Asset Management |
| 80033 | Afin International Holdings,Inc. |  | 900037 | Global X |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 80034 | Banorte I, LLC. |  | 900038 | VanEck |
| 80037 | Invex International, S.A. |  | 900039 | KraneShares |
| 80038 | Invex Worldwide, S.A. |  | 900040 | ProShares |
| 80041 | Inbursa International, Inc. |  | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 80042 | Inbursa Securities, Inc. |  | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 80043 | IXE Holdings, Inc. |  | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 82004 | Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba. |  | 900044 | Man Group |
| 82006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |  | 900045 | Berenberg |
| 82008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |  | 900046 | Finamex |
| 82009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |  | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |
| 82010 | Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania. |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 82011 | Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur. |  | 920000 | Otros Socios Operadores |
| 82012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
| 82013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |
| 82014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |  | 950000 | Otras Plataformas Electrónicas de Negociación |
| 82016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |  | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 82025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A. |  | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 82027 | Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |  | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 82028 | Internacional Oficina de Representación en Madrid, España. |  |  |  |
| 82030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |
| 82031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Aviso de Recomposición** | |  | **Catálogo de Tipo de Depósito** | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** |
| 0 | No aplica recomposición |  | 1 | Depósitos en instituciones financieras |
| 1 | En caso de encontrarse en proceso de recomposición se opta por conservar el instrumento |  | 2 | Depósitos con custodios |
| 2 | En caso de encontrarse en proceso de recomposición se opta por vender el instrumento |  | 3 | Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados) |
|  |  |  | 4 | Depósitos en cámara de compensación  (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados). |
|  |  |  | 5 | Depósitos en garantía por derivados OTC |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

Si la cantidad es negativa, se anotará el signo negativo en la 1ª posición de la izquierda, si la cantidad es positiva se anotará un CERO en la 1ª posición de la izquierda.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

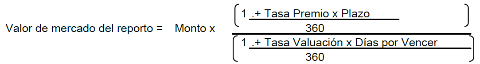
El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

El segundo bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha final del periodo.

5 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apostrofes; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

7 El valor de mercado del reporto se deberá calcular conforme a lo siguiente:



**Monto**: costo total inicial del reporto (precio sucio al inicio del reporto multiplicado por el número de títulos adquiridos en reporto).

**Tasa premio**: es la tasa pactada con la contraparte por la operación de reporto.

Plazo: es el plazo inicial pactado de la operación del reporto.

**Tasa de Valuación**: Se obtiene de la curva de reporto proporcionada por el Proveedor de Precios según los días por vencer del reporto y la calificación de la contraparte con la que se pacte la operación.

**Días por vencer**: Días que faltan para el vencimiento del reporto a la fecha del reporte.

8 La calificación de la contraparte, emisión o emisor se ubicará en alguna de cuatro calificaciones posibles, ésta clasificación es realizada por los Proveedores de Precios y será modificada por éstos conforme a sus procedimientos internos de clasificación y podrá ser diferente entre los diferentes Proveedores de Precios.

9 El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

10 Hora. El formato para la hora ser de 4 caracteres numéricos = "HHMM" donde:

       HH = hora

       MM = min

El huso horario, será el de la hora del centro de México.

11El Activo Total de la Sociedad de Inversión será el definido por la Circular CONSAR serie 15 vigente.

12 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

13 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

14 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

15 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas, en caso de no existir se anotará un CERO justificado a la izquierda.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

**Políticas a seguir en la transmisión de la información**

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.

II.     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

III.    Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.

IV.   La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

V.    En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:

       1° ISIN, de no existir éste,

       2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

       3° SEDOL.

       Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores, salvo en instrumentos provenientes de operaciones primarias, pendientes de liquidar, en donde estos identificadores aún no sean asignados y por tanto no existan.

VI.   En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las indicaciones de cada campo; de lo contrario se anotará un CERO y espacios en blanco.

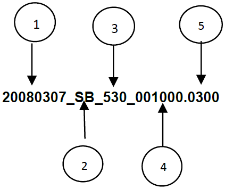
VII.   El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizan-do el programa GNUpg.

VIII.  El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCION** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 6 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicará para familia de SIEFORES. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será **Constante = "0300"**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefore XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de Siefore Básica Inicial, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá de encriptarse con el programa GNUpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20080307\_SB\_530\_001000.0300.gpg**

Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encriptarlo, sólo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20080307\_SB\_530\_001000.0300**

**NOTA:**No se tomará en cuenta la extensión .gpg, en la recuperación del acuse, como lo muestra el ejemplo, ni vendrá encriptado el acuse.

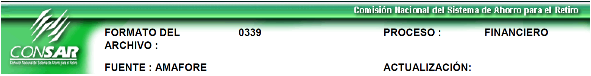
IX.   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

**Anexo 118**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE** **RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL** **REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 369 | DE 7:00 hrs a 10:00 hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** | |  |  |  | | | |  |
|  |  |  |  |  | | | |  |
| **ENCABEZADO:** Contiene información sobre las características del formato | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1668963.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000**".1 |
| 2 | Número de registros |  | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro |  | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = **Constante** "**369**".1 |
| 4 | Tipo de archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1672178.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante "0339**".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1674817.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = **Constante "005**".1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1677456.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Asociaciones), anexos. 1 |
| 7 | Fecha de información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1680095.png | F | 8 | 0 | 27 | 34 | Fecha de la Información que se reporta.3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 335 | 0 | 35 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1685477.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "101"**.1 |
| 2 | ID Vehículo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1688102.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada Vehículo, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | ISIN Vehículo |  | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo reportado.6 |
| 4 | CUSIP O CINS Vehículo |  | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Vehículo reportado.7 |
| 5 | SEDOL Vehículo |  | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Vehículo reportado.8 |
| 6 | Clave Vehículo |  | AN | 10 | 0 | 42 | 51 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Vehículo reportado.4 |
| 7 | Ticker Bloomberg Vehículo |  | AN | 20 | 0 | 52 | 71 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Vehículo reportado.9 |
| 8 | Ticker Reuters Vehículo |  | AN | 20 | 0 | 72 | 91 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Vehículo reportado.10 |
| 9 | ID del Patrocinador |  | N | 3 | 0 | 92 | 94 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Patrocinadores".1 |
| 10 | Tipo de Vehículo |  | N | 2 | 0 | 95 | 96 | Se deberá reportar el identificador del tipo de Vehículo que corresponda considerando su naturaleza preponderante según el "Catálogo de Tipos de Vehículo".1 |
| 11 | Nombre descriptivo Vehículo |  | AN | 60 | 0 | 97 | 156 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del Vehículo reportado.4 |
| 12 | Valor del Vehículo |  | N | 10 | 6 | 157 | 172 | Se deberá reportar el valor a mercado del Vehículo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información.1 |
| 13 | Divisa de Cotización |  | N | 2 | 0 | 173 | 174 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |
| 14 | Espacios en blanco |  | AN | 195 | 0 | 175 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE(S)** |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1697502.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "301"**.1 |
| 2 | ID Componente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1700141.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Tipo de Activo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1702780.png | N | 2 | 0 | 14 | 15 | Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo".1 |
| 4 | Tipo de Activo Subyacente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1705419.png | N | 2 | 0 | 16 | 17 | En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00".4 |
| 5 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1708058.png | AN | 12 | 0 | 18 | 29 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado.6 |
| 6 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1710697.png | AN | 9 | 0 | 30 | 38 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado.7 |
| 7 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1713336.png | AN | 7 | 0 | 39 | 45 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado.8 |
| 8 | Clave | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1715975.png | AN | 10 | 0 | 46 | 55 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado.4 |
| 9 | Ticker Bloomberg | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1718614.png | AN | 20 | 0 | 56 | 75 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al componente reportado.9 |
| 10 | Ticker Reuters | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1721253.png | AN | 20 | 0 | 76 | 95 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al componente reportado.10 |
| 11 | Nombre descriptivo del componente |  | AN | 50 | 0 | 96 | 145 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado.4 |
| 12 | ISIN subyacente |  | AN | 12 | 0 | 146 | 157 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.6 |
| 13 | CUSIP O CINS subyacente |  | AN | 9 | 0 | 158 | 166 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.7 |
| 14 | SEDOL subyacente |  | AN | 7 | 0 | 167 | 173 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.8 |
| 15 | Clave subyacente |  | AN | 10 | 0 | 174 | 183 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 16 | Ticker Bloomberg subyacente |  | AN | 20 | 0 | 184 | 203 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso.9 |
| 17 | Ticker Reuters subyacente |  | AN | 20 | 0 | 204 | 223 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso.10 |
| 18 | Nombre descriptivo subyacente |  | AN | 50 | 0 | 224 | 273 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 19 | País |  | N | 2 | 0 | 274 | 275 | En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países.1 |
| 20 | Nombre País |  | AN | 20 | 0 | 276 | 295 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 21 | Mercado |  | AN | 4 | 0 | 296 | 299 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 22 | País Regulador |  | N | 2 | 0 | 300 | 301 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, e deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países.1 |
| 23 | Nombre País Regulador |  | AN | 20 | 0 | 302 | 321 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En otro caso se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 24 | Divisa de cotización |  | N | 2 | 0 | 322 | 323 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25 | Clave divisa |  | AN | 3 | 0 | 324 | 326 | En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 26 | Sector |  | AN | 20 | 0 | 327 | 346 | Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo.4 |
| 27 | Influencia |  | N | 3 | 6 | 347 | 355 | Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del vehículo, medido en puntos porcentuales.1 |
| 28 | Calificadora Componente primera |  | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 29 | Calificación Homologada del Componente primera |  | N | 4 | 0 | 359 | 362 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 00001 |
| 30 | Calificadora Componente segunda |  | N | 3 | 0 | 363 | 365 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 31 | Calificación Homologada del Componente segunda |  | N | 4 | 0 | 366 | 369 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. 1 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | ADMINISTRADORAS | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 005 | ASOCIACIONES | AS |
| 007 | EMPRESAS OPERADORAS | EO |
| 012 | ENTIDAD RECEPTORA | ER |
| 013 | BANXICO | BX |
| 014 | PRESTADORAS DE SERVICIO | PS |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |
| 018 | INDEVAL | ID |
| 019 | CUSTODIOS | CS |
| 020 | INSTITUTOS | IN |
| 030 | VECTORES | VE |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidad (Asociaciones)** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 003 | Asociación Mexicana de Afores | AMAFORE |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |
| 2 | USD | Dólar Americano |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |
| 6 | JPY | Yen Japonés |
| 7 | EUR | Euros |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Activo** | |  | **Catálogo de Tipos de Activos subyacentes** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | No aplica |  | 01 | Acción |
| 01 | Acción |  | 02 | Mercancías |
| 02 | Mercancías |  | 03 | Renta Fija |
| 03 | Renta Fija |  | 04 | Vehículo Inmobiliario |
| 04 | Vehículo Inmobiliario |  | 05 | Divisas |
| 05 | Instrumentos Financieros Derivados |  | 99 | Otro |
| 99 | Otro |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Vehículo** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Accionario |
| 02 | Inmobiliario |
| 03 | Mercancías |
| 04 | Renta Fija |
| 05 | Mixto |
| 99 | Otro |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 2 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 3 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 4 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 5 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 6 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 7 | España |  | 33 | Brasil |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 9 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Patrocinadores** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 000 | Otro |
| 001 | BlackRock, Inc. |
| 002 | Barclays |
| 003 | JP Morgan |
| 004 | Morningstar |
| 005 | State Street |
| 006 | Vanguard |
| 007 | WisdomTree |
| 008 | Van Eck |
| 009 | First Trust |
| 010 | InvescoPowerShares |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |
| 99 | Otra |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | **HR D** |  |  | **1056** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal. Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

En caso de estar reportando tasas, se deberá hacerlo en forma de porcentaje con el número de decimales que estipule la longitud del campo.

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

5 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

6 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país.

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

7 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato

real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

8 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9 El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

10 El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de SFTP, a la carpeta AMAFORE/RECEPCION

II.     Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos aprobados (AMAFORE).

I.     Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

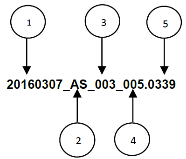
|  |  |
| --- | --- |
| **Tipo de Acción** | **Descripción** |
| Envío Normal SFTP | /AMAFORE/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse | /AMAFORE/TRANSMISION |

II.     El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| No. | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. **Constante = "AS"**. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave de Entidad que se reporta, |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que reporta **Constante = "005"**. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, **Constante = 0339**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

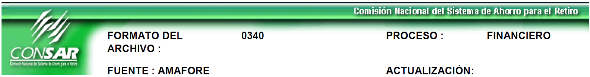
       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Banamex Custodia estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20160307\_AS\_003\_005.0339**

**Anexo 119**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información de la descomposición de índices accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE** **RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL** **REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 369 | DE 7:00 hrs a 10:00 hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** | |  |  |  | | | |  |
|  |  |  |  |  | | | |  |
| **ENCABEZADO:** Contiene información sobre las características del formato de transmisión | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1924144.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "**000**".1 |
| 2 | Número de registros |  | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro |  | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = Constante "**369**".1 |
| 4 | Tipo de archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1927359.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "**0340**".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1929998.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = **Constante "005**".1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1932637.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Asociaciones), anexos. 1 |
| 7 | Fecha de información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1935276.png | F | 8 | 0 | 27 | 34 | Fecha de la Información que se reporta.3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 335 | 0 | 35 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1940646.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "101"**.1 |
| 2 | ID índice | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1943271.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada índice, y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | ISIN índice |  | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del índice reportado.6 |
| 4 | CUSIP O CINS índice |  | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS índice reportado.7 |
| 5 | SEDOL índice |  | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del índice reportado.8 |
| 6 | Clave índice |  | AN | 10 | 0 | 42 | 51 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del índice reportado.4 |
| 7 | Ticker Bloomberg índice |  | AN | 20 | 0 | 52 | 71 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice reportado.9 |
| 8 | Ticker Reuters índice |  | AN | 20 | 0 | 72 | 91 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al índice reportado.10 |
| 9 | ID del Patrocinador |  | N | 3 | 0 | 92 | 94 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Patrocinadores".1 |
| 10 | Tipo de Índice |  | N | 2 | 0 | 95 | 96 | Se deberá reportar el identificador del tipo de índice que corresponda considerando su naturaleza preponderante, según el "Catálogo de Tipos de índice".1 |
| 11 | Nombre descriptivo índice |  | AN | 60 | 0 | 97 | 156 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del índice reportado.4 |
| 12 | Valor del Índice |  | N | 10 | 6 | 157 | 172 | Se deberá reportar el valor en puntos del índice al cierre de la fecha de reporte de información.1 |
| 13 | Divisa del Índice |  | N | 2 | 0 | 173 | 174 | Se deberá reportar el identificador de la divisa asociada al índice reportado de conformidad con el "Catálogo de Divisa"1 |
| 13 | Espacios en blanco |  | AN | 195 | 0 | 175 | 369 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE(S)** |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al índice del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del índice. El nivel de descomposición de cada uno de los índices debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1952657.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "301"**.1 |
| 2 | ID Componente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1955282.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Tipo de Activo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1957907.png | N | 2 | 0 | 14 | 15 | Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo".1 |
| 4 | Tipo de Activo Subyacente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1960532.png | N | 2 | 0 | 16 | 17 | En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00".4 |
| 5 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1963157.png | AN | 12 | 0 | 18 | 29 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado.6 |
| 6 | CUSIP O CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1965782.png | AN | 9 | 0 | 30 | 38 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado.7 |
| 7 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1968407.png | AN | 7 | 0 | 39 | 45 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado.8 |
| 8 | Clave | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1971032.png | AN | 10 | 0 | 46 | 55 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado.4 |
| 9 | Ticker Bloomberg | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1973657.png | AN | 20 | 0 | 56 | 75 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al componente reportado.9 |
| 10 | Ticker Reuters | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_1976282.png | AN | 20 | 0 | 76 | 95 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al componente reportado.10 |
| 11 | Nombre descriptivo del componente |  | AN | 50 | 0 | 96 | 145 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado.4 |
| 12 | ISIN subyacente |  | AN | 12 | 0 | 146 | 157 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.6 |
| 13 | CUSIP O CINS subyacente |  | AN | 9 | 0 | 158 | 166 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.7 |
| 14 | SEDOL subyacente |  | AN | 7 | 0 | 167 | 173 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.8 |
| 15 | Clave subyacente |  | AN | 10 | 0 | 174 | 183 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 16 | Ticker Bloomberg subyacente |  | AN | 20 | 0 | 184 | 203 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.9 |
| 17 | Ticker Reuters subyacente |  | AN | 20 | 0 | 204 | 223 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.10 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 18 | Nombre descriptivo subyacente |  | AN | 50 | 0 | 224 | 273 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 19 | País |  | N | 2 | 0 | 274 | 275 | En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países.1 |
| 20 | Nombre País |  | AN | 20 | 0 | 276 | 295 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 21 | Mercado |  | AN | 4 | 0 | 296 | 299 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 22 | País Regulador |  | N | 2 | 0 | 300 | 301 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, e deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países.1 |
| 23 | Nombre País Regulador |  | AN | 20 | 0 | 302 | 321 | En caso de En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En otro caso se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 24 | Divisa de cotización |  | N | 2 | 0 | 322 | 323 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |
| 25 | Clave divisa |  | AN | 3 | 0 | 324 | 326 | En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 26 | Sector |  | AN | 20 | 0 | 327 | 346 | Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista aluna justificación para realizar cambios al mismo.4 |
| 27 | Influencia |  | N | 3 | 6 | 347 | 355 | Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del índice, medido en puntos porcentuales.1 |
| 28 | Calificadora Componente primera |  | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 29 | Calificación Homologada del Componente primera |  | N | 4 | 0 | 359 | 362 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 00001 |
| 30 | Calificadora Componente segunda |  | N | 3 | 0 | 363 | 365 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segundo" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 31 | Calificación Homologada del Componente segunda |  | N | 4 | 0 | 366 | 369 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. 1 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | ADMINISTRADORAS | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 005 | ASOCIACIONES | AS |
| 007 | EMPRESAS OPERADORAS | EO |
| 012 | ENTIDAD RECEPTORA | ER |
| 013 | BANXICO | BX |
| 014 | PRESTADORAS DE SERVICIO | PS |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |
| 018 | INDEVAL | ID |
| 019 | CUSTODIOS | CS |
| 020 | INSTITUTOS | IN |
| 030 | VECTORES | VE |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidad (Asociaciones)** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 003 | Asociación Mexicana de Afores | AMAFORE |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |
| 2 | USD | Dólar Americano |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |
| 6 | JPY | Yen Japonés |
| 7 | EUR | Euros |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Activo** | |  | **Catálogo de Tipos de Activos Subyacentes** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | No aplica |  | 00 | No aplica |
| 01 | Acción |  | 01 | Acción |
| 02 | Mercancías |  | 02 | Mercancías |
| 03 | Renta Fija |  | 03 | Renta Fija |
| 04 | Vehículo Inmobiliario |  | 04 | Vehículo Inmobiliario |
| 05 | Instrumentos Financieros Derivados |  | 05 | Divisas |
| 99 | Otro |  | 99 | Otro |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Índice** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Accionario |
| 02 | Inmobiliario |
| 03 | Mercancías |
| 04 | Renta Fija |
| 05 | Mixto |
| 99 | Otro |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 2 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 3 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 4 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 5 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 6 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 7 | España |  | 33 | Brasil |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 9 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Patrocinadores** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 000 | Otro |
| 001 | BMV |
| 002 | MSCI Barra |
| 003 | Barclays |
| 004 | JP Morgan |
| 005 | Morningstar |
| 006 | Vanguard |
| 007 | WisdomTree |
| 008 | S&P Dow Jones |
| 009 | Nasdaq |
| 010 | Stoxx |
| 011 | FTSE |
| 012 | CreditSuissePowered by Holt |
| 013 | BNY Mellon |
| 014 | Center for Research in Security Prices |
| 015 | Russell |
| 016 | Keefe, Bruyette and Woods |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |
| 99 | Otra |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Local** | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | HR D |  |  | 1056 |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal. Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

En caso de estar reportando tasas, se deberá hacerlo en forma de porcentaje con el número de decimales que estipule la longitud del campo.

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

5 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

6 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país.

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

7 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

8 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9 El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

10 El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de SFTP, a la carpeta AMAFORE/RECEPCION

II.     Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos aprobados (AMAFORE).

I.     Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

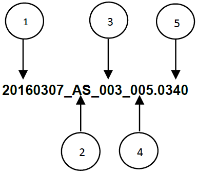
|  |  |
| --- | --- |
| **Tipo de Acción** | **Descripción** |
| Envío Normal SFTP | /AMAFORE/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse | /AMAFORE/TRANSMISION |

II.     El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. **Constante = "AS"**. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave de Entidad que se reporta, |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que reporta **Constante = "005"**. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, **Constante = 0340**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

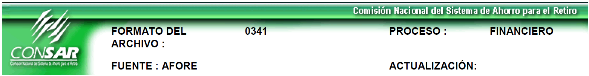
       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Banamex Custodia estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20160307\_AS\_003\_005.0340**

**Anexo 121**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene información de los funcionarios adscritos a las áreas que realizan actividades y labores en materia financiera dentro de las Sociedades de inversión, así como el detalle de las certificaciones en materia financiera que poseen dichos funcionarios. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE** **TRANSMISIÓN** |
| TRIMESTRAL | Último día hábil de los meses de marzo, junio, septiembre y diciembre. | 522 | 07:00 a 18:00 Hrs. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2178766.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro = **Constante "000".**1 |
| 2 | Tipo de Archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2181405.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Identificador de archivo = **Constante "0341".**1 |
| 3 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2184044.png | N | 3 | 0 | 8 | 10 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, **Constante = "001"**.1 |
| 4 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2186683.png | N | 3 | 0 | 11 | 13 | Clave de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Entidades (AFORES) anexo.1 |
| 5 | Fecha de Información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2189322.png | F | 8 | 0 | 14 | 21 | Fecha de la información, la cual será el penúltimo día hábil del trimestre que se reporta.3 |
| 6 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Número de caracteres por registro = **Constante** **"522"**.1 |
| 7 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 25 | 29 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 493 | 0 | 30 | 522 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| En este subencabezado, se deberá reportar la información relativa a cada cargo o puesto contemplado en los procesos de inversión en la estructura de la Administradora. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2196056.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante"101".**1 |
| 2 | ID Cargo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2198681.png | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador numérico definido por la Administradora, que sea único para cada puesto, y que no presente cambios a lo largo del tiempo.1 |
| 3 | Cargo |  | AN | 80 | 0 | 14 | 93 | Se deberá reportar el nombre del cargo o puesto.5 |
| 4 | Descripción del Cargo |  | AN | 255 | 0 | 94 | 348 | Se deberá reportar una breve descripción de las responsabilidades asociadas al cargo o puesto.5 |
| 5 | Área | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2201854.png | N | 2 | 0 | 349 | 350 | Se deberá reportar la Clave de Área a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Áreas.1 |
| 6 | Nombre Área |  | AN | 80 | 0 | 351 | 430 | En caso de que se reporte el identificador "*99 - Otras áreas de la Administradora*" en el campo "*Área*", se deberá reportar el nombre del Área a la que pertenece el cargo o puesto.5 |
| 7 | Subárea | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2204753.png | N | 2 | 0 | 431 | 432 | Se deberá reportar la Clave de la Subárea a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Subáreas.  En caso de que aplique más de una subárea se deberá reportar el identificador "*99 - Otras subáreas de la Administradora*". 1 |
| 8 | Nombre Subárea |  | AN | 80 | 0 | 433 | 512 | En caso de que se reporte el identificador "*99 - Otras subáreas de la Administradora*" en el campo "*Subárea*", se deberá reportar el nombre de la subárea, o en su caso nombres de las subáreas, a que pertenece el cargo o puesto.5 |
| 9 | ID Cargo del cargo de quien depende | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2207652.png | AN | 10 | 0 | 513 | 522 | Se deberá reportar el "*ID Cargo*" correspondiente al cargo al cual reporta, o del cual depende directamente en dirección vertical en la estructura de la Administradora.  Únicamente para el caso de cargos o puestos que no dependan directamente de otro cargo dentro de la estructura de la Administradora, como el Director General o el Contralor Normativo, este campo se deberá reportar vacío de conformidad con las especificaciones del mismo.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLES** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** En este detalle se deberá reportar la información del funcionario que ocupa el cargo o puesto reportado en el subencabezado del presente formato. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2212846.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante "301.**1 |
| 2 | ID funcionario | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2215471.png | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá anotar un identificador único por funcionario definido por la Administradora, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo.1 |
| 3 | Nombre | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2218096.png | AN | 40 | 0 | 14 | 53 | Se deberá anotar el nombre del funcionario.5 |
| 4 | Apellido Paterno | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2220721.png | AN | 40 | 0 | 54 | 93 | Se deberá anotar el apellido paterno del funcionario.5 |
| 5 | Apellido Materno | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2223346.png | AN | 40 | 0 | 94 | 133 | Se deberá anotar el apellido materno del funcionario.5 |
| 6 | Correo Electrónico Institucional | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2225971.png | AN | 50 | 0 | 134 | 183 | Se deberá anotar el correo electrónico institucional del funcionario.5 |
| 7 | Fecha de ingreso al cargo |  | F | 8 | 0 | 184 | 191 | Se deberá reportar la fecha en la que se tomó posesión del cargo.3 |
| 8 | Fecha de ingreso a la Administradora |  | F | 8 | 0 | 192 | 199 | Se deberá reportar la fecha de ingreso del funcionario a la Administradora.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 323 | 0 | 200 | 522 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de las certificaciones que posee el funcionario ocupante del puesto o cargo. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2231756.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante "302".**1 |
| 2 | ID funcionario | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2234395.png | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá anotar un identificador único por funcionario definido por la Administradora, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID funcionario" del "DETALLE 1".2 |
| 3 | Tipo de Certificación | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2237034.png | N | 2 | 0 | 14 | 15 | Se deberá reportar el identificador correspondiente al tipo de certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo Tipos de Certificaciones.1 |
| 4 | Certificación | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2239673.png | N | 2 | 0 | 16 | 17 | Se deberá reportar el identificador correspondiente a la Certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo de Certificaciones.1 |
| 5 | Identificador Certificación | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2242312.png | AN | 50 | 0 | 18 | 67 | Se deberá reportar el número o clave de identificación otorgada por la institución certificadora al funcionario, como por ejemplo, el "*CFA Institute ID*", otorgado por CFA a sus aplicantes.5 |
| 6 | Fecha de emisión de la certificación |  | F | 8 | 0 | 68 | 75 | Se deberá reportar la fecha de emisión de la certificación reportada.3 |
| 7 | Fecha fin vigencia |  | F | 8 | 0 | 76 | 83 | Se deberá reportar la fecha de fin de la vigencia de la certificación reportada.  Para el caso de las certificaciones concluidas con vigencia permanente se deberá llenar con ceros. 3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 439 | 0 | 84 | 522 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **CATÁLOGO (S)** |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Entidades (AFORES)** | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI Banorte |
| 534 | Profuturo |
| 538 | Principal |
| 544 | SURA |
| 550 | Inbursa |
| 552 | Citibanamex |
| 556 | Azteca |
| 562 | Invercap |
| 568 | Coppel |
| 578 | PensionISSSTE |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Áreas** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Dirección General |
| 02 | Contraloría Normativa del proceso de Inversiones |
| 03 | Inversiones |
| 04 | Riesgos |
| 05 | Administración y Finanzas |
| 99 | Otras áreas de la Administradora |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Subáreas** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Dirección General |
| 02 | Contraloría Normativa del proceso de Inversiones |
| 03 | Operación de Instrumentos Derivados |
| 04 | Inversiones Alternativas |
| 05 | Inversiones en Renta Fija |
| 06 | Inversiones en Renta Variable |
| 07 | Riesgo Mercado |
| 08 | Riesgo Crédito |
| 09 | Riesgo Liquidez |
| 10 | Riesgo Operativo |
| 11 | Confirmación |
| 12 | Liquidación |
| 13 | Contabilidad |
| 14 | Compliance y control interno |
| 15 | Custodia gestionada por la Administradora |
| 16 | Tesorería Siefores |
| 17 | Tecnologías de la Información del proceso de inversiones (TI) |
| 18 | Área de inversiones (sólo aplica al responsable de inversiones) |
| 19 | UAIR (sólo aplica al responsable de riesgos) |
| 99 | Otras subáreas de la Administradora |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo Tipos de Certificación** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Certificación general en materia financiera |
| 02 | Certificación para operaciones con Derivados |
| 03 | Certificación de Funcionarios para Instrumentos Estructurados |
| 04 | Certificación general en materia ASG |
| 05 | Refrendo a Certificación general en materia financiera |
| 06 | Refrendo a Certificación para operaciones con Derivados |
| 07 | Refrendo a Certificación de Funcionarios para Instrumentos Estructurados |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo Certificación** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Certificación genérica en materia de inversiones (Publicadas en la página de Internet de la Comisión) |
| 01 | Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 1 |
| 02 | Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 2 |
| 03 | Chartered Financial Analyst (CFA) |
| 04 | Financial Risk Manager (FRM-GARP) Nivel 1 |
| 05 | Financial Risk Manager (FRM-GARP) |
| 06 | Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 2 Exámenes |
| 07 | Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 3 Exámenes |
| 08 | Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) |
| 09 | Associate of the Society of Actuaries (ASA) 3 Exámenes |
| 10 | Associate of the Society of Actuaries (ASA) 3 |
| 11 | Fellow of the Society of Actuaries (FSA): Especialización en Quantitative Finance and Investment (QFI) |
| 12 | Claritas Investment Certificate (aplicado por CFA Institute) o The CFA Institute Investment Foundations |
| 13 | Certificación en Derivados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión) |
| 14 | Certificación en Instrumentos Estructurados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión) |
| 15 | Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) Nivel 1 |
| 16 | Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) |
| **17** | **Certified Environmental Social and Governance Analyst (CESGA)** |
| **18** | **Certificate in ESG Investing CFA Institute** |
| **19** | **GARP's Sustainability and Climate Risk (SCR)** |
| **99** | **Otros** |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Si la cantidad es negativa el signo ocupará la 1ª posición de la izquierda.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo y el segundo la fecha final del periodo.

5 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

**Políticas a seguir en la transmisión de la información**

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.

ll.     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

III.    Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).

IV.   La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

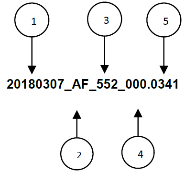
V.    El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

VI.   El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, **Constante = "AF**". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la clave tipo de entidad que se reporta conforme al catálogo de Entidades AFORES anexo al documento. |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será **Constante = "000**") |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será **Constante = "0341"**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2 y 3 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Afore BANAMEX estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá de encriptarse con el programa GNUpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20180307\_AF\_552\_000.0341.gpg**

       Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encriptarlo, sólo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20180307\_AF\_552\_000.0341**

**NOTA:**No se tomará en cuenta la extensión .gpg, en la recuperación del acuse, como lo muestra el ejemplo, ni vendrá encriptado el acuse.

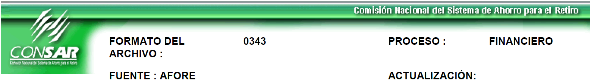
VII.   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

**Anexo 123**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene información de los **I**~~i~~nstrumentos ~~e~~**E**structurados en los que invierten los fondos que administra la AFORE, con la información acumulada al cierre del trimestre anterior al de la entrega del formato. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE** **TRANSMISIÓN** |
| TRIMESTRAL | Último día hábil de los meses de marzo, junio, septiembre y diciembre. | 506 | De 07:00 a 18:00 Hrs. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2371911.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000**".1 |
| 2 | Número de registros |  | N | 5 | 0 | 4 | 8 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = **Constante** "**506**".1 |
| 4 | Tipo de archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2375126.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante "0343**".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2377765.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, **Constante = "001"**.1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2380404.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (AFORES), anexo. 1 |
| 7 | Fecha de información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2383043.png | F | 8 | 0 | 22 | 29 | Fecha de la Información al último día hábil del trimestre que se reporta.3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 477 | 0 | 30 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO:** En este subencabezado se deberán reportar los datos de identificación de los **I**~~i~~nstrumentos Estructurados en los que invierten los fondos que administra la AFORE. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2389201.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "101"**.1 |
| 2 | ISIN Instrumento Estructurado | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2391840.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Estructurado reportado.7 |
| 3 | Tipo Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2394479.png | AN | 4 | 0 | 16 | 19 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado.5 |
| 4 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2397118.png | AN | 7 | 0 | 20 | 26 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado. 5 |
| 5 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2399757.png | AN | 7 | 0 | 27 | 33 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado.5 |
| 6 | Ticker Bloomberg del Instrumento Estructurado |  | AN | 20 | 0 | 34 | 53 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Instrumento Estructurado que es reportado.10 |
| 7 | Ticker Reuters de Instrumento Estructurado |  | AN | 20 | 0 | 54 | 73 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Instrumento Estructurado reportado.11 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 433 | 0 | 74 | 506 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:**En este detalle se deberá reportar la información general del **I**~~i~~nstrumento Estructurado reportado en subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2405570.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "301"**.1 |
| 2 | Nombre del Administrador del Instrumento Estructurado |  | AN | 70 | 0 | 4 | 73 | Se deberá anotar la razón social correspondiente al Administrador del Instrumento Estructurado reportado. 5 |
| 3 | Grupo al que pertenece el Administrador |  | AN | 70 | 0 | 74 | 143 | En caso de que el Administrador del Instrumento Estructurado pertenezca a un Grupo Financiero o empresarial en este campo se reportará la razón social de dicho Grupo. 5 |
| 4 | Nombre del Fiduciario del Instrumento Estructurado |  | N | 3 | 0 | 144 | 146 | Se deberá anotar el identificador de la razón social correspondiente al Fiduciario del Instrumento Estructurado, según el "Catálogo de fiduciarios". 1 |
| 5 | Representante común del Instrumento Estructurado |  | N | 3 | 0 | 147 | 149 | Se reportará el identificador de la razón social del Representante Común del Instrumento Estructurado, según el "Catálogo de Representante Común". 1 |
| 6 | Monto máximo de la emisión del Instrumento Estructurado |  | N | 15 | 2 | 150 | 166 | Se deberá anotar el monto máximo en pesos de la emisión del Instrumento Estructurado reportadoconsiderando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato.2 |
| 7 | Monto máximo de la emisión en la divisa del Instrumento Estructurado |  | N | 15 | 2 | 167 | 183 | Se deberá anotar el monto máximo de la emisión en la divisa del Instrumento Estructurado reportado.2 |
| 8 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 184 | 185 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se emitió el Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Divisa" anexo.  Cuando no exista identificador para la divisa del Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente.1 |
| 9 | Llamadas de capital **y/o** **derechos de** **suscripción** del Instrumento Estructurado |  | N | 1 | 0 | 186 | 186 | Se deberá reportar 1 si el Instrumento Estructurado está sujeto a llamadas de capitaly/o derechos de suscripción. En otro caso se deberá anotar 0. 1 |
| 10 | Capital llamado del Instrumento Estructurado |  | N | 15 | 2 | 187 | 203 | Se reportará el monto total llamado en pesos del Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato. Deberá ser la suma del monto colocado inicialmente más las llamadas de capital y/o derechos de suscripción realizadas por el Instrumento Estructurado y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. 2 |
| 11 | Cantidad de títulos en Circulación |  | N | 15 | 0 | 204 | 218 | Se reportará el número de títulos en circulación del Instrumento Estructurado (en unidades). 1 |
| 12 | Estrategia Preponderante |  | N | 2 | 0 | 219 | 220 | Se reportará el sector de la estrategia preponderante de inversión del Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Estrategia Preponderante" determinada con el Monto Invertido de los proyectos o inversiones a la fecha reportada, sin considerar la revaluación de los mismos.  Cuando no exista identificador para el sector preponderante de inversión del Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Estrategia Preponderante" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector de la estrategia preponderante. 1 |
| 13 | Fecha de Emisión |  | F | 8 | 0 | 221 | 228 | Fecha de la emisión del Instrumento Estructurado operado. 3 |
| 14 | Tipo de Instrumento Estructurado |  | N | 2 | 0 | 229 | 230 | Se reportará el tipo de Instrumento Estructurado según "Catálogo Tipo de Instrumento Estructurado". 1 |
| 15 | Valuador Independiente |  | N | 2 | 0 | 231 | 232 | Se reportará al valuador independiente de la valuación del instrumento reportada en el periodo según "Catálogo de Valuador Independiente".  Cuando no exista identificador para el valuador independiente en el "Catálogo de Valuador Independiente" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el nombre del valuador independiente. 1 |
| 16 | Serie adicional u optativa |  | N | 1 | 0 | 233 | 233 | Si el Instrumento Estructurado corresponde a una serie subsecuente, adicional u optativa de otro Instrumento Estructurado anotar 1.  En otro caso se deberá anotar 0. 1 |
| 17 | Identificador del Instrumento Estructurado del que es serie adicional |  | AN | 18 | 0 | 234 | 251 | Si se indica "1" en el campo "Serie adicional u optativa", entonces en este campo se debe poner el Tipo de Valor, Emisora y Serie del Instrumento Estructurado del que es serie adicional o el primer instrumento estructurado administrado bajo el mismo fideicomiso, respetando el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie.  En otro caso se deberá llenar con espacios. 5 |
| 18 | Observaciones |  | AN | 255 | 0 | 252 | 506 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos de Divisa, Estrategia Preponderante o del Valuador Independiente.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los proyectos o inversiones en los que participa el instrumento reportado en el subencabezado, así como los proyectos o inversiones desinvertidos y los recursos que no han sido invertidos, a la fecha de información. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2415177.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "302"**.1 |
| 2 | ID Inversión |  | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador definido por la Administradora, que sea único para cada proyecto de inversión reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo.5  Se deberá considerar cualquier proyecto de inversión, incluyendo los que se encuentren en fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar). El detalle de la composición de estos fondos se reportará en el "Detalle 3" que se presenta más adelante. |
| 3 | Identificador de la inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2418104.png | AN | 18 | 0 | 14 | 31 | En caso de que se trate de cuentas de depósito o activos financieros o valores que sean objeto de oferta pública, este campo se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del activo financiero o valor en que el Instrumento Estructurado tenga inversiones, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie.  Para el caso de reportos, este campo se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del activo financiero objeto de la operación de reporto al cierre de la fecha de información, respetando el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie.  Para el caso de depósitos en efectivo en pesos se deberá considerar que el tipo valor para estos depósitos es "EF", la emisora es "EFECTIV" y la serie "990101".  Para el caso de depósitos en efectivo en divisas distintas al peso, se deberá considerar el tipo de valor, emisora y series asignados por el proveedor de precios a la divisa del depósito.  En otro caso se deberá llenar con espacios. 5 |
| 4 | ISIN del instrumento en que el Instrumento Estructurado tiene inversión |  | AN | 12 | 0 | 32 | 43 | En caso de que exista, en particular en el caso de instrumentos objeto de oferta pública, se deberá anotar la clave del ISIN del activo financiero en el que el Instrumento Estructurado mantenga inversiones.  En caso de reportos, se deberá anotar la clave del ISIN del activo financiero objeto de la operación de reporto.7 |
| 5 | Empresa o proyecto promovido |  | AN | 70 | 0 | 44 | 113 | Se deberá anotar la razón social de la empresa o nombre del proyecto en donde se realizó la inversión. En el caso de instrumentos objeto de oferta pública, se deberá anotar el nombre del emisor o contraparte.  En caso de que la inversión sea en un fondo de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) se deberá anotar el nombre del fondo en el que participan y la empresa que lo administra.  En caso de que se trate de cuentas de depósito (Fondos de inversión de deuda, reportos, activos financieros de deuda gubernamental, etc.) se deberá anotar "Inversión Permitida o Temporal"5. |
| 6 | Tipo de proyecto de inversión |  | N | 2 | 0 | 114 | 115 | Se deberá anotar el tipo de proyecto de inversión que ha realizado el Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión".  Cuando no exista identificador para el proyecto de inversión en el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el tipo de proyecto de inversión del que se trate. 1 |
| 7 | Sector |  | N | 2 | 0 | 116 | 117 | Se deberá anotar el sector al que pertenece la empresa o proyecto promovido o financiado según el "Catálogo Sectorial".  Cuando no exista identificador para el sector al que pertenece la empresa o proyecto promovido en el "Catálogo Sectorial" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector al que pertenece.  En caso de que se trate de cuentas de depósito se deberá anotar el indicador "00" del "Catálogo Sectorial".1 |
| 8 | Monto Total Invertido |  | N | 10 | 2 | 118 | 129 | Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos2~~2~~ |
| 9 | Monto considerando la valuación independiente |  | N | 10 | 2 | 130 | 141 | Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato tomando en cuenta el valor actualizado por efecto de valuación .2 |
| 10 | Participación del Instrumento Estructurado en el proyecto de inversión |  | N | 3 | 2 | 142 | 146 | Porcentaje de participación del Instrumento Estructurado en la empresa o proyecto promovido. 2 |
| 11 | Participación del proyecto en el Instrumento Estructurado |  | N | 3 | 2 | 147 | 151 | Porcentaje de participación destinado a la empresa o proyecto promovido relativo al Monto Máximo de la Emisión (MME) del Instrumento Estructurado.2 |
| 12 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 152 | 153 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se realizan la inversión en la empresa o proyecto promovido según el "Catálogo de Divisa".  Cuando no exista identificador para la divisa en que se realiza la inversión en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente. 1 |
| 13 | País |  | N | 2 | 0 | 154 | 155 | Se deberá anotar el País preponderante al que está siendo destinada la inversión según el "Catálogo de Países".  Cuando no exista identificador para el país al que está siendo destinada la inversión en el "Catálogo de Países" se deberá utilizar el indicador "36" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el país correspondiente. 1 |
| 14 | Observaciones |  | AN | 255 | 0 | 156 | 410 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos Sectorial, Tipo de Proyecto de Inversión, Divisa y Países. 5 |
| 15 | Espacios en blanco |  | AN | 96 | 0 | 411 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros o proyectos promovidos, que componen los fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) reportados en el detalle 2, en caso de que aplique. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2431819.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "303"**.1 |
| 2 | ID Inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2434458.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar el identificador definido por la Administradora para el fondo de inversión reportado en el presente formato, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID Inversión" del "DETALLE 2" .5 |
| 3 | ID Componente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2437097.png | AN | 10 | 0 | 14 | 23 | Se deberá reportar un identificador definido por la Administradora, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambio a lo largo del tiempo.5  Para el caso de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional se deberá reportar el identificador compuesto "INVTMEX" + "XXX", donde "XXX" será el número de inversión comenzando por "001", en caso de existir más de una inversión indirecta en el instrumento deberá asignar el número consecutivo. |
| 4 | Empresa o proyecto promovido del fondo de inversión |  | AN | 70 | 0 | 24 | 93 | Se deberá anotar el nombre de la empresa o proyecto promovido por el componente del fondo de inversión.5 |
| 5 | Tipo de Componente o Proyecto de Inversión |  | N | 2 | 0 | 94 | 95 | Se deberá anotar el tipo de inversión del componente del fondo de inversión según el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión". Cuando no exista identificador para el tipo proyecto de inversión del componente del fondo de inversión en el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el tipo de proyecto de inversión del que se trate. 1 |
| 6 | Sector del componente o proyecto |  | N | 2 | 0 | 96 | 97 | Se deberá anotar el sector al que pertenece el componente del fondo de inversión según el "Catálogo Sectorial"  Cuando no exista identificador para el sector al que pertenece el componente del fondo de inversión en el "Catálogo Sectorial" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector al que pertenece. 1 |
| 7 | Monto Total Invertido |  | N | 10 | 2 | 98 | 109 | Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión.  Cuando se trate de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional reportadas con los identificadores compuestos del tipo "INVTMEX" + "XXX" en el ID 3 del presente DETALLE, se reportará el monto total invertido en pesos en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión considerando la inversión total realizada por co-inversionistas y/o fondos paralelos.  En ambos casos considerará el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato ~~y~~, sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. 2 |
| 8 | Monto Total Invertido en la divisa del Instrumento Estructurado |  | N | 15 | 2 | 110 | 126 | Se deberá anotar el monto total invertido en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión en la divisa del Instrumento Estructurado, sin considerar el valor actualizado por efecto de valuación2  Cuando se trate de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional reportadas con los identificadores compuestos del tipo "INVTMEX" + "XXX" en el ID 3 del presente DETALLE, se reportará en la divisa del Instrumento Estructurado el monto total invertido en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión considerando la inversión total realizada por co-inversionistas y/o fondos paralelos. |
| 9 | Participación del componente o proyecto en el fondo de inversión |  | N | 3 | 2 | 127 | 131 | Porcentaje de participación del componente o proyecto en el fondo de inversión. 2 |
| 10 | Participación del fondo de inversión en el proyecto de inversión |  | N | 3 | 2 | 132 | 136 | Se deberá anotar la participación del fondo relativo al total del proyecto de inversión o componente. 2 |
| 11 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 137 | 138 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se realiza la inversión en el componente o proyecto según el "Catálogo de Divisa".  Cuando no exista identificador para la divisa en que se realizan la inversión en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente. 1 |
| 12 | País |  | N | 2 | 0 | 139 | 140 | Se deberá anotar el País al que está siendo destinado el componente o proyecto del fondo de inversión según el "Catálogo de Países".  Cuando no exista identificador para el país al que está siendo destinado el componente o proyecto del fondo de inversión en el "Catálogo de Países" se deberá utilizar el indicador "36" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el país correspondiente.1 |
| 13 | Observaciones |  | AN | 255 | 0 | 141 | 395 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos Sectorial, Tipo de Proyecto de Inversión, Divisa y Países. 5 |
| 14 | Espacios en blanco |  | AN | 111 | 0 | 396 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los gastos o comisiones devengados del Instrumento Estructurado reportado en subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2449862.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "304"**.1 |
| 2 | Número Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2452501.png | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá señalar un número consecutivo para cada concepto de comisión.1 |
| 3 | Clasificación del Pago |  | N | 2 | 0 | 14 | 15 | Se deberá anotar el identificador de la clasificación del pago, de acuerdo con el "Catálogo de Clasificación de Pago". 1 |
| 4 | Monto pagado |  | N | 15 | 2 | 16 | 32 | Se deberá anotar el monto en pesos pagado al Administrador en el periodo de revisión considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato. 2 |
| 5 | Concepto de Pago |  | N | 2 | 0 | 33 | 34 | Se deberá anotar el concepto del pago realizado mencionado en el punto 2 anterior de acuerdo con el "Catálogo de Concepto de Comisiones".  Cuando no exista identificador para el concepto del pago en el "Catálogo de Concepto de Comisiones" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el concepto que describa el pago correspondiente. 1 |
| 6 | Observaciones |  | AN | 255 | 0 | 35 | 289 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en el Catálogo de Concepto de Comisiones.5 |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 217 | 0 | 290 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 5:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los Coinversionistas que participan en cada una de las inversiones o proyectos promovidos reportados en el Detalle 2 por el instrumento Estructurado reportado en subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2458876.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "305"**.1 |
| 2 | ID Inversión | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2461501.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar el identificador definido por la Administradora para el proyecto de inversión reportado en el presente, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID Inversión" del DETALLE 2 .5 |
| 3 | Número Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2464126.png | N | 10 | 0 | 14 | 23 | Se deberá señalar un número consecutivo para cada Coinversitonista.1 |
| 4 | Tipo de Coinversionista |  | N | 2 | 0 | 24 | 25 | Se deberá anotar el tipo de coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado de acuerdo con el "Catálogo de Tipo de Coinversionista".  Cuando no exista identificador para el tipo de coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Tipo de Coinversionista" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el concepto que describa el pago correspondiente. 1  Cuando no exista coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado, se deberá utilizar el indicador "99" contenido en el "Catálogo de Tipo de Coinversionista". |
| 5 | Participación del Tipo de Coinversionista en el proyecto |  | N | 3 | 2 | 26 | 30 | Se deberá reportar el porcentaje de la participación del "Tipo de Coinversionista" reportado en el punto anterior en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado.  En el caso de que existan dos o más coinversionistas que sean parte de un mismo Tipo de Coinversionistas se deberá sumar el porcentaje de participación de todos. 2 |
| 6 | Observaciones |  | AN | 255 | 0 | 31 | 285 | Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en el formato en el Catálogo de Tipo de Coinversionista. 5 |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 221 | 0 | 286 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 6:** En este detalle, se deberá incorporar la información de las llamadas de capital y/o derechos de suscripción realizados del Instrumento Estructurado reportado en subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2470171.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "306"**.1 |
| 2 | Número de llamada de capital y/o derecho de suscripción | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2472810.png | N | 3 | 0 | 4 | 6 | Se deberá señalar un número consecutivo por cada llamada de capital y/o derecho de suscripción realizada del Instrumento Estructurado señalado en el subencabezado, el cual se incrementará por cada nueva llamada de capital,  El número de llamada de capital y/o derecho de suscripción deberá iniciar en 1. 1 |
| 3 | Fecha de Emisión de la llamada de capital y/o derecho de suscripción |  | F | 8 | 0 | 7 | 14 | Fecha de emisión de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. 3 |
| 4 | Fecha Ex-Derecho |  | F | 8 | 0 | 15 | 22 | Fecha Ex-Derecho de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. 3 |
| 5 | Fecha de liquidación de la llamada de capital y/o derecho de suscripción |  | F | 8 | 0 | 23 | 30 | Fecha de liquidación de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. 3 |
| 6 | Cantidad de Títulos |  | N | 15 | 0 | 31 | 45 | Cantidad de títulos emitidos en llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. 1 |
| 7 | Valor unitario a mercado |  | N | 9 | 6 | 46 | 60 | En este campo se debe poner el valor unitario de mercado de los títulos emitidos en la llamada de capital y/o derecho de suscripción. 2 |
| 8 | Monto emitido de la llamada de capital y/o derecho de suscripción |  | N | 15 | 2 | 61 | 77 | Monto total de la llamada de capital y/o derecho de suscripción expresada en pesos mexicanos considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. 2 |
| 9 | Monto de la llamada de capital y/o derecho de suscripción en la divisa del Instrumento Estructurado |  | N | 15 | 2 | 78 | 94 | Monto total de la llamada de capital y/o derecho de suscripción expresada en la divisa de emisión del Instrumento Estructurado. 2 |
| 10 | Espacios en blanco |  | AN | 412 | 0 | 95 | 506 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **CATÁLOGOS(S)** |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Entidades (AFORE)** | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI Banorte |
| 534 | Profuturo |
| 538 | Principal |
| 544 | SURA |
| 550 | Inbursa |
| 552 | Citibanamex |
| 556 | Azteca |
| 562 | Invercap |
| 568 | Coppel |
| 578 | PensionISSSTE |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 2 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 3 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 4 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 5 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 6 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 7 | España |  | 33 | Brasil |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 9 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 1 | MXP | Peso |
| 2 | USD | Dólar Americano |
| 3 | UDI | Unidades de Inversión |
| 6 | JPY | Yen Japonés |
| 7 | EUR | Euros |
| 8 | AUD | Dólar Australiano |
| 9 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi Chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo Sectorial** | |
| **Id** | **Descripción** |
| 00 | Otros |
| 01 | Agricultura, ganadería, aprovechamientos forestal, caza y pesca |
| 02 | Minería |
| 03 | Electricidad, agua y suministro de gas por ductos al consumidor final |
| 04 | Construcción |
| 05 | Industrias manufactureras |
| 06 | Comercio al por mayor |
| 07 | Comercio al por menor |
| 08 | Transportes, correos y almacenamiento |
| 09 | Información en medios masivos |
| 10 | Servicios financieros y de seguros |
| 11 | Servicios inmobiliarios y de alquiler de bienes inmuebles e intangibles |
| 12 | Servicios profesionales, científicos y técnicos |
| 13 | Dirección de corporativos y empresas |
| 14 | Servicios de apoyo a los negocios y manejo de desechos y servicios de remediación |
| 15 | Servicios educativos |
| 16 | Servicios de salud y de asistencia social |
| 17 | Servicios de esparcimiento culturales y deportivos, y otros servicios recreativos |
| 18 | Servicios de alojamiento temporal y de preparación de alimentos y bebidas |
| 19 | Otros servicios excepto actividades del gobierno |
| 20 | Actividades del gobierno y de organismos internacionales y extraterritoriales |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Instrumento Estructurado** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Otro |
| 01 | CKD |
| 02 | CERPI |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Estrategia Preponderante** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Otro |
| 01 | Inmobiliario Vivienda |
| 02 | Inmobiliario Comercial |
| 03 | Inmobiliario mixto |
| 04 | Infraestructura y energía en desarrollo |
| 05 | Infraestructura y energía en operación |
| 06 | Capital Privado |
| 07 | Capital Emprendedor |
| 08 | Activos Financieros |
| 09 | Fondo de Fondos |
| 10 | Crédito |
| 11 | Inmobiliario Industrial |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Valuador Independiente** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Otro |
| 01 | 414 Capital Inc. |
| 02 | Deloitte |
| 03 | PricewaterhouseCooper (PwC) |
| 04 | KPMG |
| 05 | Quantit |
| 06 | Valuación, Análisis y Riesgos (VAR) |
| 07 | Duff & Phelps |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Otro |
| 01 | Capital |
| 02 | Préstamos |
| 03 | Deuda |
| 04 | Bonos corporativos |
| 05 | Bonos de Alto Rendimiento |
| 06 | Instrumentos híbridos y deuda convertible |
| 07 | Deuda con títulos opcionales (warrants) |
| 08 | Financiamientos respaldados con activos (excluyendo carteras de crédito) |
| 09 | Deuda mezzanine |
| 10 | Carteras de consumo |
| 11 | Carteras de empresas |
| 12 | Activos emproblemados (Distressed Assets) |
| 13 | Portafolios de Créditos en Cartera Vencida |
| 14 | Portafolios de Créditos originados por terceros |
| 15 | Derechos derivados de contratos de factoraje |
| 16 | Derechos de cobro, obligaciones y derechos fideicomisarios |
| 17 | Fondo de Fondos |
| 18 | Sociedades de inversión de renta fija |
| 19 | Sociedades de inversión de renta variable |
| 20 | Otras sociedades de inversión |
| 21 | Instrumento de Renta Fija negociadas a través de bolsas de valores |
| 22 | Instrumento de Renta Variable negociadas a través de bolsas de valores |
| 23 | Vehículos de Inversión Inmobiliaria o FIBRAS negociadas a través de bolsas de valores |
| 24 | **I**~~i~~nstrumentos objeto de oferta pública |
| 25 | Efectivo |
| 26 | Inversión temporal en valores |
| 27 | Inversión temporal en sociedades o fondos de inversión permitidos |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Representante Común** | |
| **Id** | **Descripción** |
| 000 | Otro |
| 001 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple. |
| 002 | Banco Invex, S.A., Institución de Banca Múltiple |
| 003 | Monex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Monex Grupo Financiero |
| 004 | Deutsche Bank México, S.A., Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria. |
| 005 | The Bank of New York Mellon, S.A., Institución de Banca Múltiple |
| 006 | HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple |
| 007 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |
| 008 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de fiduciarios** | |
| **Id** | **Descripción** |
| 000 | Otro |
| 001 | Banco Invex, S.A., Institución de Banca Múltiple, Invex Grupo Financiero. |
| 002 | Banco Nacional de México, S.A. |
| 003 | HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple |
| 004 | The Bank of New York Mellon, S.A., Institución de Banca Múltiple |
| 005 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple. |
| 006 | Deutsche Bank México, S.A., Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria. |
| 007 | Bank of America, S.A.s Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria |
| 008 | BBVA Bancomer Servicios, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero BBVA Bancomer, Dirección Fiduciaria. |
| 009 | Banco Monex, S.A., Institución de Banca Múltiple, Monex Grupo Financiero |
| 010 | Banco Actinver, S.A. Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Actinver |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Clasificación de Pago** | |
| **Id** | **Descripción** |
| 00 | Cuando el pago corresponda a gastos administrativos**~~,~~** previamente pactados, que sean revelados en el Prospecto de Colocación tales como: Comisión por administración, administración de las inversiones o por el desempeño del Administrador, Gastos de Emisión y/o Mantenimiento del Instrumento Estructurado |
| 01 | Cuando el pago corresponda a los costos del Proyecto o Inversión, y sea consolidado con el costo de adquisición de los activos subyacentes adquiridos, que no sea pagado a Entidades relacionadas, |
| 02 | Cuando el pago corresponda a los gastos relacionados al Proyecto o Inversión, con cargo al Fideicomiso, que no sea pagado a Entidades relacionadas, |
| 03 | Cuando el pago corresponda a los costos del Proyecto o Inversión, y sea consolidados con el costo de adquisición de los activos subyacentes, que sea pagado a Entidades relacionadas. |
| 04 | Cuando el pago corresponda a los gastos relacionados al Proyecto o Inversión, con cargo al Fideicomiso, que sea pagado a Entidades relacionadas. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Concepto de Comisiones\*** | | |
| **Identificador** | **Concepto** | **Descripción Concepto** |
| 01 | Comisión por Administración (Inversión) | Monto efectivamente pagado durante el periodo de inversión al administrador por concepto de comisión por administración definido en el prospecto del instrumento estructurado (no incluye los gastos pagados a un tercero por la administración de inversiones).  En el caso de Instrumentos Estructurados, que a su vez invierta en otros fondos de inversión, se deberá reportar el monto efectivamente pagado durante el periodo de inversión por concepto de comisión por administración del administrador del Fideicomiso y la comisión por administración pagada a los Fondos Subyacentes. |
| 02 | Comisión por Administración. (Desinversión) | Monto efectivamente pagado una vez concluido el periodo de inversión al administrador por concepto de comisión por administración definido en el prospecto del instrumento estructurado. |
| 03 | Pagos para administrar las inversiones. | Monto pagado a terceros expertos en materias o áreas que permitan verificar la viabilidad de los proyectos o inversiones del instrumento estructurado; así como los servicios pagados para identificar oportunidades de inversión. |
| 04 | Comisión por desempeño pagado al administrador del instrumento estructurado. | Monto pagado al administrador por los rendimientos que produzcan las inversiones aprobadas una vez distribuido el rendimiento preferente (Carried interest/Carry). |
| 05 | Pago de derechos para registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL | Monto pagado por los derechos para registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores, e INDEVAL relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 06 | Pago para mantener los derechos de registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL | Monto pagado para mantener los derechos de registro y listado en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL. |
| 07 | Pagos por Intermediación Devengados | Monto acumulado devengado de los gastos de intermediación y colocación relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado, el cual deberá amortizarse o devengarse linealmente en 6 años. |
| 08 | Pago al Agente Estructurador por la emisión inicial Devengado | Monto acumulado devengado al Agente Estructurador relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado, el cual deberá amortizarse o devengarse linealmente en 6 años. |
| 09 | Pago al Representante Común por la emisión inicial | Monto pagado al Representante Común relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 10 | Pago al Representante Común por mantenimiento de la emisión | Monto pagado al Representante común por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 11 | Pago al Fiduciario por emisión inicial | Monto pagado al Fiduciario relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 12 | Pago al Fiduciario por mantenimiento de la emisión | Monto pagado al Fiduciario por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 13 | Pago a Auditor Externo por la emisión inicial | Monto pagado al Auditor Externo relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 14 | Pago a Auditor Externo por mantenimiento de la emisión | Monto pagado al auditor externo por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 15 | Pago a Asesores Fiscales por la emisión inicial | Monto pagado a los Asesores Fiscales relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 16 | Pago a Asesores Fiscales por mantenimiento de la emisión | Monto pagado a los Asesores Fiscales por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 17 | Pagos Legales de la emisión inicial | Monto pagado por los gastos de asesoría legal relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 18 | Pagos Legales por mantenimiento de la emisión | Monto pagado por los gastos de asesoría legal por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 19 | Pagos Legales relacionados con las inversiones | Monto pagado por los gastos o costos de asesoría legal relacionados con las inversiones del instrumento estructurado. |
| 20 | Pagos por Promoción e Impresión | Monto pagado por los gastos de promoción e impresión relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 21 | Pagos a Otros Asesores por la emisión inicial | Monto pagado a otros asesores relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 22 | Pagos a Otros Asesores por mantenimiento de la emisión | Monto pagado a otros asesores relacionados con el mantenimiento del instrumento estructurado |
| 23 | Pagos a Otros Asesores relacionados con las inversiones | Monto pagado a otros asesores relacionados con las inversiones del instrumento estructurado. |
| 24 | Pagos por viajes y viáticos | Monto pagado por concepto de viajes o viáticos relacionados con las inversiones del instrumento estructurado. |
| 25 | Pago de Honorarios y Gastos Notariales | Monto pagado por concepto de Honorarios y Gastos Notariales relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 26 | Pago por Asesoría Contable y/o financiera por la emisión inicial | Monto pagado por concepto de asesoría contable o financiera relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 27 | Pago por Asesoría Contable y/o financiera por mantenimiento de la emisión | Monto pagado por concepto de asesoría contable o financiera relacionado con el mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 28 | Pago por Asesoría Contable y/o financiera relacionado con las inversiones | Monto pagado por concepto de asesoría contable y/o financiera relacionado con las inversiones del instrumento estructurado. |
| 29 | Pago al Valuador Independiente | Monto pagado al Valuador Independiente por la emisión inicial o por mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 30 | Pago al Proveedor de Precios | Monto pagado al Proveedor de Precios por la emisión inicial o por mantenimiento del instrumento estructurado. |
| 31 | Gastos relacionados con las llamadas de capital y/o derechos de suscripción del instrumento estructurado | Monto pagado por los gastos relacionados con las llamadas de capital y/o derechos de suscripción del instrumento estructurado. |
| 32 | Pagos relacionados con el Desarrollo de los proyectos. | Monto pagado por los gastos o costos de Inversión relacionados con el desarrollo de los proyectos inmobiliarios y/o de infraestructura. |
| 33 | Pagos relacionados con la Construcción. | Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la construcción de desarrollos inmobiliarios y/o de infraestructura. |
| 34 | Pagos relacionados con la adquisición. | Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la adquisición de desarrollos inmobiliarios y/o de infraestructura. |
| 35 | Pagos relacionados con el arrendamiento. | Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con el arrendamiento de activos derivado de las inversiones del instrumento estructurado. |
| 36 | Pagos relacionados con la contratación y renovación de primas de seguros. | Monto pagado por la contratación y renovación de primas de seguros relacionadas con las inversiones, por ejemplo, seguros contra daños y seguros de propiedad (según aplique). |
| 37 | Pagos relacionados con el corretaje inmobiliario | Monto pagado por los gastos o costos de inversiones relacionados con el corretaje inmobiliario. |
| 38 | Pagos relacionados con la valuación del inmueble. | Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la valuación del inmueble. |
| 39 | Pagos operativos de las inversiones | Monto pagado relacionado con la operación y mantenimiento de los proyectos inmobiliarios y/o de infraestructura. |
| 40 | Pagos por Desinversión | Monto pagado por el análisis, implementación y cierre de una potencial desinversión o de una desinversión, incluyendo cualesquiera indemnizaciones pagaderas respecto de esta. Ejemplos: Gastos o costos relacionados con IPO, Brokers, etc. |
| 41 | Seguros y Garantías relacionados con el Administrador | Monto pagado por los gastos o costos para cubrir seguros y/o garantías relacionadas con el administrador del instrumento estructurado, por ejemplo, el "Seguro de Responsabilidad Profesional".  Esta categoría no se relaciona con los seguros o garantías relacionados con las inversiones realizadas. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 42 | Impuestos | Monto pagado por concepto de impuestos por la gestión del instrumento estructurado, esta categoría no está relacionada con el pago de impuestos por las inversiones realizadas por el instrumento estructurado. |
| 43 | Impuestos relacionados con las inversiones | Monto pagado por concepto de impuestos relacionados con las inversiones realizadas por el instrumento estructurado. |
| 44 | Intereses a cargo | Monto pagado por intereses a cargo del instrumento estructurado. |
| 45 | Depreciación y amortización | Monto pagado por la depreciación o amortización (cuando aplique). |
| 46 | Contraprestación pagada al Comité Técnico | Monto pagado por concepto de cualquier compensación derivada por la gestión del Comité Técnico. |
| 47 | Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas | Monto pagado en el desarrollo, negociación y estructuración de una posible Inversión que finalmente no fue realizada, tales como gastos relacionados con la participación en asociaciones industriales, conferencias o juntas similares con fines de evaluar potenciales oportunidades de Inversión, desarrollar ideas de Inversión, y para identificar temas y tendencias en industrias, sectores o geografías, que sean distintos a los pagos de inversiones no viables por disolución, por depósitos o anticipos de efectivo y/o por viajes y viáticos. |
| 48 | Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por disolución (break up fees) | Monto pagado por comisiones por disolución (break up fees) pagaderos por el Fideicomiso en relación con, o montos pagados como penalidad por no consumar una Inversión que finalmente no sea realizada. |
| 49 | Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por depósitos o anticipos de efectivo | Depósitos o anticipos de efectivo u otros activos que se pierdan en relación con una potencial Inversión que finalmente no sea realizada. |
| 50 | Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por viaje y viáticos | Monto pagado por concepto de viajes o viáticos relacionados con cualquier potencial Inversión que finalmente no sea realizada. |
| 51 | Pagos de Intermediación Iniciales | Monto total correspondiente a los gastos de intermediación y colocación relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 52 | Pago al Agente Estructurador por la emisión inicial | Monto total correspondiente al pago del Agente Estructurador relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado. |
| 00 | Otros Pagos | Otros gastos o costos realizados con el instrumento estructurado que no se encuentran en los puntos anteriores. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Coinversionista** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | Otro |
| 01 | Persona Física |
| 02 | Empresas |
| 03 | Bancos u otras instituciones financieras |
| 04 | Aseguradoras |
| 05 | Family Office |
| 06 | Instituciones de Desarrollo/Organismos multilaterales |
| 07 | Fideicomisos/Fundaciones/Universidades |
| 08 | Fondo de Capital Privado |
| 09 | Fondos de Pensiones |
| 10 | Fondos Soberanos |
| 11 | Certificados Bursátiles de Capital de Desarrollo (CKD) |
| 12 | Certificados Bursátiles Fiduciarios de Proyectos de Inversión (CERPI) |
| 13 | Administrador del Instrumento Estructurado o Subsidiaria del mismo o Entidad relacionada del mismo |
| 99 | Sin Coinversionista |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

En caso de estar reportando tasas, se deberá hacerlo en forma de porcentaje con el número de decimales que estipule la longitud del campo.

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo y el segundo la fecha final del periodo.

5 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

**Políticas a seguir en la transmisión de la información**

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.

ll.     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

III.    Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).

IV.   La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

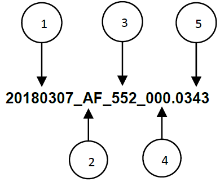
V.    El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

VI.   El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| No. | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, **Constante = "AF**". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave de Entidades AFORE que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será **Constante = "000**") |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será **Constante = "0343"**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2 y 3 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Afore BANAMEX estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá de encriptarse con el programa GNUpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20180307\_AF\_552\_000.0343.gpg**

       Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encriptarlo, sólo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20180307\_AF\_552\_000.0343**

**NOTA:**No se tomará en cuenta la extensión .gpg, en la recuperación del acuse, como lo muestra el ejemplo, ni vendrá encriptado el acuse.

VII.   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

**Anexo 141**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene información de los movimientos y la participación de las Siefores en Fondos Mutuos que son operados a través de Intermediarios Financieros (Plataformas de Negociación Electrónicas, Administradores o Patrocinadores del Fondo Mutuo) distintos a los Custodios Internacionales y otros aspectos de los Fondos Mutuos. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 147 | 08:30 a 10:00 Hrs |

|  |
| --- |
| **ENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2643940.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = **Constante "000"**1 |
| 2 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 4 | 8 | Número de registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = **Constante** "**147**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2646987.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) = **Constante "0345".**1 |
| 5 | Fecha de la Información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2649570.png | F | 8 | 0 | 16 | 23 | Fecha de la operación al cierre del día hábil previo al que se reporta.3 |
| 6 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2652153.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipo de Entidad anexo.= **Constante "034"**1 |
| 7 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2654736.png | N | 3 | 0 | 27 | 29 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo Entidad Contrapartes, anexo. 1 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 118 | 0 | 30 | 147 | Vacíos.6 |

|  |
| --- |
| **SUBENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2659864.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". 1 |
| 2 | Tipo de Entidad Reportada | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2662461.png | N | 3 | 0 | 4 | 6 | Se deberá reporta la Clave del Tipo de Entidades reportada de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 3 | Entidad Reportada | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2665058.png | N | 3 | 0 | 7 | 9 | Se deberá reportar la Clave de Entidad reportada de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo.1 |
| 4 | Subtipo de Entidad Reportada | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2667655.png | N | 6 | 0 | 10 | 15 | Se deberá anotar la Clave del Subtipo de Entidad reportada de acuerdo al Catálogo de Subtipo de Entidades, anexo.1 |
| 5 | Número de Cuenta del Cliente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2670252.png | AN | 20 | 0 | 16 | 35 | Se deberá anotar el número de cliente de la Siefore, únicamente para ser llenado por el Intermediario Financiero.5 |
| 6 | Espacios en blanco |  | AN | 112 | 0 | 36 | 147 | Vacíos.6 |

|  |
| --- |
| **DETALLE(S)** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** MOVIMIENTOS DE FONDOS MUTUOS EN EL DÍA | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2675534.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". 1 |
| 2 | Entradas/Salidas | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2678131.png | AN | 1 | 0 | 4 | 4 | Se deberá anotar la clave de la operación realizada ("E" para valores recibidos o "S" para valores entregados por la Siefore)5. |
| 3 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2680728.png | N | 10 | 0 | 5 | 14 | Se deberá señalar un número consecutivo para cada movimiento de Fondos Mutuos en el día. |
| 4 | Tipo de Movimiento |  | AN | 1 | 0 | 15 | 15 | Se deberá anotar la clave que indica el tipo de movimiento realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento.5 |
| 5 | Código ISIN Fondo Mutuo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2683571.png | AN | 12 | 0 | 16 | 27 | Se deberá anotar el código ISIN del Fondo Mutuo. 7 |
| 6 | Ticker Bloomberg Fondo Mutuo |  | AN | 20 | 0 | 28 | 47 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado.11 |
| 7 | Ticker Reuters del Fondo Mutuo |  | AN | 20 | 0 | 48 | 67 | En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado.12 |
| 8 | ID del Administrador |  | N | 6 | 0 | 68 | 73 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo Entidad Contrapartes".1 |
| 9 | Nombre corto del Administrador |  | AN | 20 | 0 | 74 | 93 | Se deberá anotar el nombre corto del Administrador a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para el Administrador en el "Catálogo Entidad Contrapartes".  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 10 | Unidades operadas |  | N | 20 | 6 | 94 | 119 | Se deberán anotar las unidades operadas del Fondo Mutuo. 2 |
| 11 | Monto de Liquidación |  | N | 20 | 6 | 120 | 145 | Se deberá anotar el total del monto de liquidación de la operación en la Divisa del Fondo Mutuo. 2 |
| 12 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 146 | 147 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisa, anexo. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** PARTICIPACIÓN EN FONDOS MUTUOS | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2690186.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". 1 |
| 2 | Código ISIN Fondo Mutuo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2692783.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar el código ISIN del Fondo Mutuo. 7 |
| 3 | Ticker Bloomberg Fondo Mutuo |  | AN | 20 | 0 | 16 | 35 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado.11 |
| 4 | Ticker Reuters del Fondo Mutuo |  | AN | 20 | 0 | 36 | 55 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado.12 |
| 5 | Participación Inicial |  | N | 20 | 6 | 56 | 81 | Es la cantidad de unidades iniciales que se tienen en cartera del Fondo Mutuo. (Debe coincidir con la Participación Actual del día anterior). 2 |
| 6 | Participación Actual |  | N | 20 | 6 | 82 | 107 | Se deberá anotar la cantidad de unidades iniciales que se tienen en cartera del Fondo Mutuo, al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 7 | Porcentaje de Participación |  | N | 3 | 4 | 108 | 114 | Se deberá anotar el porcentaje de participación actual en relación a los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información. 2 |
| 8 | Valor del Fondo Mutuo |  | N | 20 | 6 | 115 | 140 | Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 9 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 141 | 142 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa del Fondo Mutuo según el Catálogo de Divisa, anexo.1 |
| 10 | Espacios en blanco |  | AN | 5 | 0 | 143 | 147 | Vacíos6 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 007 | EMPRESAS OPERADORAS | EO |
| 011 | ICEFAS | IC |
| 013 | BANXICO | BX |
| 014 | PRESTADORAS DE SERVICIO | PT |
| 016 | COMISIONES | CM |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |
| 018 | S. D. INDEVAL | ID |
| 019 | CUSTODIOS DE LAS SIEFORES | CS |
| 020 | INSTITUTOS | IN |
| 030 | PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS | VP |
| 034 | INTERMEDIARIOS FINANCIEROS | IF |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo Entidad Contrapartes** | | |
| **Clave** | **Identificador** | **Descripción** |
| 001 | 900000 | Otros |
| 002 | 900001 | Schroders Plc. |
| 003 | 900002 | Blackrock Inc. |
| 004 | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 005 | 900004 | Amundi Asset Management |
| 006 | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 008 | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 009 | 900008 | Ninety One PLC |
| 010 | 900009 | Alliance Bernstein |
| 012 | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 013 | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 014 | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 015 | 900011 | Fidelity International |
| 016 | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 017 | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 018 | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 019 | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 020 | 900016 | Vanguard Group |
| 021 | 900017 | Natixis |
| 022 | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 023 | 900019 | State Street Corporation |
| 024 | 900020 | DWS Investments |
| 025 | 900021 | Sherpa Capital |
| 026 | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 027 | 900023 | FirstTrust |
| 028 | 900024 | Baillie Gifford |
| 029 | 900025 | UBS AG |
| 030 | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 031 | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 032 | 900028 | GAM Holding AG |
| 033 | 900029 | Invesco Capital Management |
| 034 | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 035 | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 036 | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 037 | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 038 | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 039 | 900035 | UTI Asset Management |
| 040 | 900036 | Nikko Asset Management |
| 041 | 900037 | Global X |
| 042 | 900038 | VanEck |
| 043 | 900039 | KraneShares |
| 044 | 900040 | ProShares |
| 045 | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 046 | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 047 | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 048 | 900044 | Man Group |
| 049 | 900045 | Berenberg |
| 050 | 900046 | Finamex |
| 051 | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Básicas)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Voluntarias)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI BANORTE |  | 634 | PROFUTURO |
| 534 | PROFUTURO |  | 644 | SURA |
| 538 | PRINCIPAL |  | 652 | CITIBANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | CITIBANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 568 | COPPEL |  |  |  |
| 578 | PENSIONISSSTE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Aportaciones Complementarias)** | |  | **Catálogo de Entidades**  **(SIEFORES Previsión Social)** | |
| **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |  | **Clave de** **Entidad** | **Descripción** |
| 334 | PROFUTURO |  | 430 | XXI BANORTE |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 000090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001000 | Siefore Inicial | Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE. |
| 002 | 538 | 001000 | Siefore Inicial | Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001000 | Siefore Inicial | Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001000 | Siefore Inicial | Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001000 | Siefore Inicial | Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001000 | Siefore Inicial | Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001955 | Siefore Básica 55-59 | Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001960 | Siefore Básica 60-64 | Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001965 | Siefore Básica 65-69 | Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001970 | Siefore Básica 70-74 | Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001975 | Siefore Básica 75-79 | Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001980 | Siefore Básica 80-84 | Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001985 | Siefore Básica 85-89 | Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001990 | Siefore Básica 90-94 | Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 000001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 004 | 430 | 000001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 000004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 000010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 000003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 000002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 000001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Movimiento** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| R | Operación de Reporto |
| T | Traspaso sin liquidación |
| V | Operación de compra o venta |
| P | Préstamos de Valores |
| G | Garantías entregadas |
| D | Derechos en especie |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Clave** |
| 1 | Peso | MXP |
| 2 | Dólar Americano | USD |
| 3 | Unidades de Inversión | UDI |
| 6 | Yen Japonés | JPY |
| 7 | Euros | EUR |
| 8 | Dólar Australiano | AUD |
| 9 | Dólar Canadiense | CAD |
| 10 | Franco Suizo | CHF |
| 11 | Libra Esterlina | GBP |
| 12 | Dólar de Hong Kong | HKD |
| 13 | Corona Danesa | DKK |
| 14 | Corona Sueca | SEK |
| 15 | Corona Noruega | NOK |
| 16 | Real Brasileño | BRL |
| 17 | Shekel Israelí | ILS |
| 18 | Peso Chileno | CLP |
| 19 | Rupia | INR |
| 20 | Renminbi Chino | CNY |
| 21 | Zloty Polaco | PLN |
| 22 | Corona checa | CZK |
| 23 | Florín Húngaro | HUF |
| 24 | Leu Rumano | RON |
| 25 | Lats Letones | LVL |
| 26 | Litas Lituanas | LTL |
| 27 | Corona Estonia | EEK |
| 28 | Lev Búlgaro | BGN |
| 29 | Corona Islandesa | ISK |
| 30 | Peso Colombiano | COP |
| 31 | Won Surcoreano | KRW |
| 32 | Nuevo Sol Peruano | PEN |
| 33 | Dólar de Singapur | SGD |
| 99 | Otras Divisas | OTR |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales..

Si la cantidad es negativa, se anotará el signo negativo en la 1ª posición de la izquierda, si la cantidad es positiva se anotará un CERO en la 1ª posición de la izquierda.

Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

3Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

4 Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

El segundo bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha final del periodo.

5Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos**y sin apostrofes**; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

6Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

7 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

8 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of

London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

10 Estos campos serán considerados opcionales sólo si se llenó alguno de los campos de código ISIN o CUSIP o SEDOL, de lo contrario se llenarán los espacios vacíos con un CERO justificado a la izquierda y espacios.

11 El Ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

12El Ticker de Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

Políticas a seguir en la transmisión de la información

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

**I.**     Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Intermediarios Financieros (Plataformas de Negociación Electrónicas, Administradores o Patrocinadores del Fondo Mutuo) distintos a los Custodios Internacionales de las Siefores.

**II.**     Las rutas en envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por SFTP, las cuales serán asignadas a cada Intermediario Financiero (Plataforma de Negociación Electrónica, Administrador o Patrocinador del Fondo Mutuo) una vez que cumplan con los requisitos establecidos en las Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro.

**III.**    En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:

       1° ISIN, de no existir éste,

       2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

       3° SEDOL.

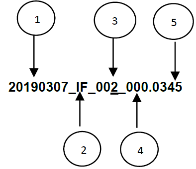
       Será obligatorio contar con por lo menos uno de ellos.

**IV.**   El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Intermediarios Financieros a CONSAR se compone de lo siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. **Constante = "IF"**. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la clave del Catálogo de Entidad Contrapartes anexo al documento. |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicará para familia de SIEFORES) |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, **Constante = 0345**. |

**NOTA**: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad "Schroders Plc." (Intermediario Financiero), estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20190307\_IF\_002\_000.0345**

**Anexo 143**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada.-**Este archivo contiene Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del tercer día hábil anterior al de entrega del formato. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| SEMANAL | ÚLTIMO DÍA HÁBIL DE LA SEMANA | 369 | De 7:00 a 18:00 Hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** | |  |  |  | | | |  |
|  |  |  |  |  | | | |  |
| **ENCABEZADO:**Contiene información sobre las características del formato. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2865335.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000".1 |
| 2 | Número de registros | - | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro | - | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = Constante "369".1 |
| 4 | Tipo de archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2868550.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0356".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2871189.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = Constante "034".1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2873828.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidad Contrapartes, anexos. 1 |
| 7 | Fecha de información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2876467.png | F | 8 | 0 | 27 | 34 | Fecha de la Información que se reporta.3 |
| 8 | Espacios en blanco | - | AN | 335 | 0 | 35 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2881851.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101".1 |
| 2 | ID Vehículo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2884490.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada Vehículo, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Espacios en blanco | - | AN | 354 | 0 | 16 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE(S)** |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DETALLE 1: En este detalle se deberá incorporar la información del Vehículo reportado en el Subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2890044.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301".1 |
| 2 | ISIN Vehículo | - | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo reportado.6 |
| 3 | CUSIP O CINS Vehículo | - | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Vehículo reportado.7 |
| 4 | SEDOL Vehículo | - | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Vehículo reportado.8 |
| 5 | Clave Vehículo | - | AN | 10 | 0 | 32 | 41 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Vehículo reportado.4 |
| 6 | Ticker Bloomberg Vehículo | - | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Vehículo reportado.9 |
| 7 | Ticker Reuters Vehículo | - | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Vehículo reportado.10 |
| 8 | ID del Patrocinador | - | N | 3 | 0 | 82 | 84 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Entidad Contrapartes".1 |
| 9 | Tipo de Vehículo | - | N | 2 | 0 | 85 | 86 | Se deberá reportar el identificador del tipo de Vehículo que corresponda considerando su naturaleza preponderante según el "Catálogo de Tipos de Vehículo".1 |
| 10 | Nombre descriptivo Vehículo | - | AN | 60 | 0 | 87 | 146 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del Vehículo reportado.4 |
| 11 | Valor del Vehículo | - | N | 20 | 6 | 147 | 172 | Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Vehículo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 12 | Divisa de Cotización | - | N | 2 | 0 | 173 | 174 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del vehículo reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |
| 13 | Valor del Fondo Primario | - | N | 20 | 6 | 175 | 200 | En caso de que el vehículo de inversión sea una serie de un fondo primario reportar el valor de los activos administrados de dicho fondo primario en la divisa de cotización. 2  En caso contrario reportar el "Valor del vehículo" del ID 12 anterior |
| 14 | País Regulador | - | N | 2 | 0 | 201 | 202 | Se reportará el identificador del país regulador del vehículo según el Catálogo de Países 1 |
| 15 | Mercado | - | AN | 6 | 0 | 203 | 208 | Se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el vehículo conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  Si el vehículo cuenta con más de un mercado de cotización, se deberá reportar el mercado en que cuente con mayor volumen operado 4. |
| 16 | Ratio de Gastos Totales | - | N | 3 | 2 | 209 | 213 | Se deberá reportar el valor del ratio de gastos totales (Total Expense Ratio) del vehículo al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 17 | Nombre del Índice o Subíndice de referencia | - | AN | 80 | 0 | 214 | 293 | Se deberá reportar el nombre del Índice o Subíndice de referencia que replica el vehículo. 4 |
| 18 | Ticker Bloomberg del Índice o Subíndice de referencia | - | AN | 20 | 0 | 294 | 313 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice o subíndice de referencia que replica el vehículo reportado.9 |
| 19 | Proveedor del Índice o Subíndice de referencia | - | N | 2 | 0 | 314 | 315 | Se deberá reportar el ID del proveedor del Índice o subíndice de referencia que replica el vehículo según el Catálogo de "Proveedores de Índices".1 |
| 20 | Observaciones | - | AN | 40 | 0 | 316 | 355 | En caso de reportar 99 en el campo "Proveedor de Índices" se deberá reportar el nombre de dicho proveedor en el presente campo. 4 |
| 21 | Espacios en blanco | - | AN | 14 | 0 | 356 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:**En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el Subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2901605.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302".1 |
| 2 | ID Componente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_2904244.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Tipo de Activo | - | N | 2 | 0 | 16 | 17 | Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo".1 |
| 4 | Tipo de Activo Subyacente | - | N | 2 | 0 | 18 | 19 | En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00".4 |
| 5 | ISIN | - | AN | 12 | 0 | 20 | 31 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado.6 |
| 6 | CUSIP O CINS | - | AN | 9 | 0 | 32 | 40 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado.7 |
| 7 | SEDOL | - | AN | 7 | 0 | 41 | 47 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado.8 |
| 8 | Clave | - | AN | 10 | 0 | 48 | 57 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado.4 |
| 9 | Ticker Bloomberg | - | AN | 20 | 0 | 58 | 77 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al componente reportado.9 |
| 10 | Ticker Reuters | - | AN | 20 | 0 | 78 | 97 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al componente reportado.10 |
| 11 | Nombre descriptivo del componente | - | AN | 48 | 0 | 98 | 145 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado.4 |
| 12 | ISIN subyacente | - | AN | 12 | 0 | 146 | 157 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.6 |
| 13 | CUSIP O CINS subyacente | - | AN | 9 | 0 | 158 | 166 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.7 |
| 14 | SEDOL subyacente | - | AN | 7 | 0 | 167 | 173 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.8 |
| 15 | Clave subyacente | - | AN | 10 | 0 | 174 | 183 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 16 | Ticker Bloomberg subyacente | - | AN | 20 | 0 | 184 | 203 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.9 |
| 17 | Ticker Reuters subyacente | - | AN | 20 | 0 | 204 | 223 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.10 |
| 18 | Nombre descriptivo subyacente | - | AN | 50 | 0 | 224 | 273 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 19 | País | - | N | 2 | 0 | 274 | 275 | En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.1 |
| 20 | Nombre País | - | AN | 20 | 0 | 276 | 295 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 21 | Mercado | - | AN | 4 | 0 | 296 | 299 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 22 | País Regulador | - | N | 2 | 0 | 300 | 301 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, e deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.1 |
| 23 | Nombre País Regulador | - | AN | 20 | 0 | 302 | 321 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En otro caso se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 24 | Divisa de cotización | - | N | 2 | 0 | 322 | 323 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |
| 25 | Clave divisa | - | AN | 3 | 0 | 324 | 326 | En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 26 | Sector | - | AN | 20 | 0 | 327 | 346 | Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo.4 |
| 27 | Influencia | - | N | 3 | 6 | 347 | 355 | Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del vehículo, medido en puntos porcentuales.  Para el caso de los instrumentos derivados deberá reportar la influencia con relación al valor nocional y en el sentido en el que vaya la posición (Si es larga el valor de la influencia deberá ser positivo y si es corta el valor de la influencia deberá ser un valor negativo)2 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 28 | Calificadora Componente primera | - | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 29 | Calificación Homologada del Componente primera | - | N | 4 | 0 | 359 | 362 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000.1 |
| 30 | Calificadora Componente segunda | - | N | 3 | 0 | 363 | 365 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. 1 |
| 31 | Calificación Homologada del Componente segunda | - | N | 4 | 0 | 366 | 369 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000.1 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 007 | EMPRESAS OPERADORAS | EO |
| 011 | ICEFAS | IC |
| 013 | BANXICO | BX |
| 014 | PRESTADORAS DE SERVICIO | PT |
| 016 | COMISIONES | CM |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |
| 018 | S. D. INDEVAL | ID |
| 019 | CUSTODIOS DE LAS SIEFORES | CS |
| 020 | INSTITUTOS | IN |
| 030 | PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS | VP |
| 034 | INTERMEDIARIOS FINANCIEROS | IF |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo Entidad Contrapartes** | | |
| **Clave** | **Identificador** | **Descripción** |
| 001 | 900000 | Otros |
| 002 | 900001 | Schroders Plc. |
| 003 | 900002 | Blackrock Inc. |
| 004 | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 005 | 900004 | Amundi Asset Management |
| 006 | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 008 | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 009 | 900008 | Ninety One PLC |
| 010 | 900009 | Alliance Bernstein |
| 012 | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 013 | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 014 | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 015 | 900011 | Fidelity International |
| 016 | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 017 | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 018 | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 019 | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 020 | 900016 | Vanguard Group |
| 021 | 900017 | Natixis |
| 022 | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 023 | 900019 | State Street Corporation |
| 024 | 900020 | DWS Investments |
| 025 | 900021 | Sherpa Capital |
| 026 | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 027 | 900023 | FirstTrust |
| 028 | 900024 | Baillie Gifford |
| 029 | 900025 | UBS AG |
| 030 | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 031 | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 032 | 900028 | GAM Holding AG |
| 033 | 900029 | Invesco Capital Management |
| 034 | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 035 | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 036 | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 037 | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 038 | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 039 | 900035 | UTI Asset Management |
| 040 | 900036 | Nikko Asset Management |
| 041 | 900037 | Global X |
| 042 | 900038 | VanEck |
| 043 | 900039 | KraneShares |
| 044 | 900040 | ProShares |
| 045 | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 046 | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 047 | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 048 | 900044 | Man Group |
| 049 | 900045 | Berenberg |
| 050 | 900046 | Finamex |
| 051 | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 01 | MXP | Peso |
| 02 | USD | Dólar Americano |
| 03 | UDI | Unidades de Inversión |
| 06 | JPY | Yen Japonés |
| 07 | EUR | Euros |
| 08 | AUD | Dólar Australiano |
| 09 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Activo** | |  | **Catálogo de Tipos de Activos subyacentes** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | No aplica |  | 01 | Acción |
| 01 | Acción |  | 02 | Mercancías |
| 02 | Mercancías |  | 03 | Renta Fija |
| 03 | Renta Fija |  | 04 | Inmobiliario11 |
| 04 | Inmobiliario11 |  | 05 | Divisas |
| 05 | Instrumentos Financieros Derivados |  | 99 | Otro |
| 06 | Vehículos de Inversión12 |  |  |  |
| 07 | Fondo Mutuo |  |  |  |
| 08 | Reportos |  |  |  |
| 09 | Préstamo de Valores |  |  |  |
| 10 | Efectivo |  |  |  |
| 99 | Otro |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Vehículo** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Accionario |
| 02 | Inmobiliario11 |
| 03 | Mercancías |
| 04 | Renta Fija |
| 05 | Mixto |
| 99 | Otro |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 02 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 03 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 04 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 05 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 06 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 07 | España |  | 33 | Brasil |
| 08 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 09 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  | 52 | Croacia |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |
| 99 | Otra |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| Calificaciones Corto Plazo en Escala Local | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | HR D |  |  | 1056 |
| Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| Calificaciones Corto Plazo en Escala Global | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Proveedores de Índices** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | FTSE |  | 17 | InteractiveData |
| 02 | Barclays |  | 18 | SocieteGeneral |
| 03 | NYSE |  | 19 | IPOX |
| 04 | ICE |  | 20 | Stoxx |
| 05 | BolsaMexico |  | 21 | JohnHancock |
| 06 | WisdomTree |  | 22 | BolsaJapon |
| 07 | CRSP |  | 23 | Morningstar |
| 08 | BolsaAlemania |  | 24 | BolsaFrancia |
| 09 | SPDJI |  | 25 | Russell |
| 10 | Nasdaq |  | 26 | ScientificBeta |
| 11 | MSCI |  | 27 | Solactive |
| 12 | GoldmanSachs |  | 28 | SSGA |
| 13 | BolsaEspana |  | 29 | Valmer |
| 14 | INDXX |  | 30 | Tokio Stock Exchange |
| 15 | iBoxx |  | 99 | Otro |
| 16 | ISE |  |  |  |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal. Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

En caso de estar reportando tasas, se deberá hacerlo en forma de porcentaje con el número de decimales que estipule la longitud del campo.

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apostrofes; en caso de no existir, se anotará un espacio vacío. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

5 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

6 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país.

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

7 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

8 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9 El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

10 El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

11 Hace referencia a FIBRAS, REITS o similares.

12 Hace referencia a ETFs de cualquier tipo de subyacente o Vehículos inmobiliarios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     Él envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del protocolo de transferencia de archivos SFTP.

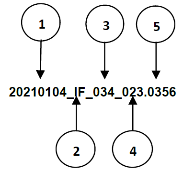
II.     Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos.

III.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **Tipo de Dato** | **Descripción** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. Constante = "IF". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave' del Catálogo tipo de entidad anexo al documento. Constante: 034 |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave' del Catálogo Entidad Contraparte anexo al documento. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0356. |

**NOTA:**La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

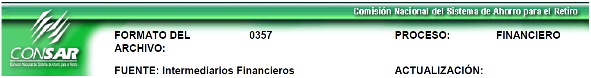
       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la entidad State Street Corporation (Intermediario Financiero) estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20210104\_IF\_034\_023.0356**

**Anexo 144**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| Información de Tipo Agregada. - Este archivo contiene la última información pública disponible de la composición de Fondos Mutuos, al cierre del último día hábil correspondiente a dos meses anteriores a la entrega del formato. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| MENSUAL | QUINTO DÍA HÁBIL DEL MES | 369 | De 7:00 a 18:00 Hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ENCABEZADO** | |  | |  |  | | | |  |
|  |  | |  |  |  | | | |  |
| ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato de transmisión. | | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3122168.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000".1 |
| 2 | Número de registros | | - | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro | | - | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = Constante "369".1 |
| 4 | Tipo de archivo | | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3125383.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0357".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3128022.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = Constante "034".1 |
| 6 | Entidad | | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3130661.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo Entidad Contrapartes, anexos. 1 |
| 7 | Fecha de información | | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3133300.png | F | 8 | 0 | 27 | 34 | Fecha de la Información que se reporta.3 |
| 8 | Espacios en blanco | | - | AN | 335 | 0 | 35 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3138676.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101".1 |
| 2 | ID Fondo Mutuo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3141301.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá reportar un identificador definido por el proveedor de la información, que sea único para cada Fondo Mutuo, y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Espacios en blanco | - | AN | 354 | 0 | 16 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE(S)** |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información del Fondo Mutuo reportado en el Subencabezado. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3146827.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301".1 |
| 2 | ISIN Fondo Mutuo | - | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Fondo Mutuo reportado.6 |
| 3 | CUSIP O CINS Fondo Mutuo | - | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Fondo Mutuo reportado.7 |
| 4 | SEDOL Fondo Mutuo | - | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Fondo Mutuo reportado.8 |
| 5 | Clave Fondo Mutuo | - | AN | 10 | 0 | 32 | 41 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Fondo Mutuo reportado.4 |
| 6 | Ticker Bloomberg Fondo Mutuo | - | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado.9 |
| 7 | Ticker Reuters Fondo Mutuo | - | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado.10 |
| 8 | ID del Administrador | - | N | 3 | 0 | 82 | 84 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al administrador que reporta la información, según el "Catálogo de Entidad Contrapartes".1 |
| 9 | Tipo de Fondo Mutuo | - | N | 2 | 0 | 85 | 86 | Se deberá reportar el identificador del tipo de Fondo Mutuo que corresponda considerando su naturaleza preponderante, según el "Catálogo de Tipos de Vehículo".1 |
| 10 | Nombre descriptivo del Fondo Mutuo | - | AN | 60 | 0 | 87 | 146 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del Fondo Mutuo reportado.4 |
| 11 | Valor del Fondo Mutuo | - | N | 20 | 6 | 147 | 172 | Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 12 | Valor Unitario | - | N | 10 | 6 | 173 | 188 | En este campo se debe reportar el precio unitario de cada acción del Fondo Mutuo a la fecha del reporte de información.2 |
| 13 | Valor del Fondo Primario | - | N | 20 | 6 | 189 | 214 | En caso de que el fondo mutuo sea una serie de un fondo primario reportar el valor de los activos administrados de dicho fondo primario en la divisa de cotización.2  En caso contrario reportar el "Valor del Fondo Mutuo" del ID 12 anterior |
| 14 | Divisa del Fondo Mutuo | - | N | 2 | 0 | 215 | 216 | Se deberá reportar el identificador de la divisa asociada al Fondo Mutuo reportado de conformidad con el "Catálogo de Divisa1 |
| 15 | Ratio de Gastos Totales | - | N | 3 | 4 | 217 | 223 | Se deberá reportar el valor del ratio de gastos totales (Total Expense Ratio) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información.2 |
| 16 | País regulador | - | N | 2 | 0 | 224 | 225 | Se deberá indicar el país de origen del organismo encargado de regular el Fondo Mutuo, conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "36" del Catálogo de Países.1 |
| 17 | Nombre País regulador | - | AN | 20 | 0 | 226 | 245 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos4 |
| 18 | Nombre del Índice o Subíndice de referencia | - | AN | 50 | 0 | 246 | 295 | Se deberá reportar el nombre del Índice o Subíndice de referencia del Fondo Mutuo. 4 |
| 19 | Ticker Bloomberg del Índice o Subíndice de referencia | - | AN | 20 | 0 | 296 | 315 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice o subíndice del Fondo Mutuo.9 |
| 20 | Proveedor del Índice o Subíndice de referencia | - | N | 2 | 0 | 316 | 317 | Se deberá reportar el ID del proveedor del Índice o subíndice del Fondo Mutuo según el Catálogo de "Proveedores de Índices".1 |
| 21 | Observaciones | - | AN | 40 | 0 | 318 | 357 | En caso de reportar 99 en el campo "Proveedor de Índices" se deberá reportar el nombre de dicho proveedor en el presente campo.4 |
| 22 | Espacios en blanco | - | AN | 12 | 0 | 358 | 369 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DETALLE 2: En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Fondo Mutuo del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Fondo Mutuo. El nivel de descomposición de cada uno de los Fondo Mutuos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3158676.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302".1 |
| 2 | ID Componente | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3161315.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá reportar un identificador definido por el proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo.4 |
| 3 | Tipo de Activo | - | N | 2 | 0 | 16 | 17 | Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo".1 |
| 4 | Tipo de Activo Subyacente | - | N | 2 | 0 | 18 | 19 | En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00".1 |
| 5 | ISIN | - | AN | 12 | 0 | 20 | 31 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado.6 |
| 6 | CUSIP O CINS | - | AN | 9 | 0 | 32 | 40 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado.7 |
| 7 | SEDOL | - | AN | 7 | 0 | 41 | 47 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado.8 |
| 8 | Clave | - | AN | 10 | 0 | 48 | 57 | En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado.4 |
| 9 | Ticker Bloomberg | - | AN | 20 | 0 | 58 | 77 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al componente reportado.9 |
| 10 | Ticker Reuters | - | AN | 20 | 0 | 78 | 97 | En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al componente reportado.10 |
| 11 | Nombre descriptivo del componente | - | AN | 48 | 0 | 98 | 145 | Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado.4 |
| 12 | ISIN subyacente | - | AN | 12 | 0 | 146 | 157 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.6 |
| 13 | CUSIP O CINS subyacente | - | AN | 9 | 0 | 158 | 166 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.7 |
| 14 | SEDOL subyacente | - | AN | 7 | 0 | 167 | 173 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.8 |
| 15 | Clave subyacente | - | AN | 10 | 0 | 174 | 183 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 16 | Ticker Bloomberg subyacente | - | AN | 20 | 0 | 184 | 203 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.9 |
| 17 | Ticker Reuters subyacente | - | AN | 20 | 0 | 204 | 223 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista.  Se deberá dejar vacío en otro caso.10 |
| 18 | Nombre descriptivo subyacente | - | AN | 50 | 0 | 224 | 273 | Para el caso en el que el componente que se reportea sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado.  Se deberá dejar vacío en otro caso.4 |
| 19 | País | - | N | 2 | 0 | 274 | 275 | En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.1 |
| 20 | Nombre País | - | AN | 20 | 0 | 276 | 295 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. 4 |
| 21 | Mercado | - | AN | 4 | 0 | 296 | 299 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 22 | País Regulador | - | N | 2 | 0 | 300 | 301 | En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado de regular el valor, conforme al "Catálogo de Países".  En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países".  En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.1 |
| 23 | Nombre País Regulador | - | AN | 20 | 0 | 302 | 321 | En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.  En otro caso se deberán reportar espacios vacíos. 4 |
| 24 | Divisa de cotización | - | N | 2 | 0 | 322 | 323 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 25 | Clave divisa | - | AN | 3 | 0 | 324 | 326 | En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes".  En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.4 |
| 26 | Sector | - | AN | 20 | 0 | 327 | 346 | Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo.4 |
| 27 | Influencia | - | N | 3 | 6 | 347 | 355 | Se deberá anotar la influencia o porcentaje de participación del Componente dentro del Fondo Mutuo, medido en puntos porcentuales.2  Para el caso de los instrumentos derivados deberá reportar la influencia con relación al valor nocional y en el sentido en el que vaya la posición (Si es larga el valor de la influencia deberá ser positivo y si es corta el valor de la influencia deberá ser un valor negativo). |
| 28 | Calificadora Componente primera | - | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000.1 |
| 29 | Calificación Homologada del Componente primera | - | N | 4 | 0 | 359 | 362 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000.1 |
| 30 | Calificadora Componente segunda | - | N | 3 | 0 | 363 | 365 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000.1 |
| 31 | Calificación Homologada del Componente segunda | - | N | 4 | 0 | 366 | 369 | Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  En otro caso se deberá anotar 0000.1 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Catálogo de Tipos de Entidades | | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BÁSICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL | PS |
| 007 | EMPRESAS OPERADORAS | EO |
| 011 | ICEFAS | IC |
| 013 | BANXICO | BX |
| 014 | PRESTADORAS DE SERVICIO | PT |
| 016 | COMISIONES | CM |
| 017 | SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS | AV |
| 018 | S. D. INDEVAL | ID |
| 019 | CUSTODIOS DE LAS SIEFORES | CS |
| 020 | INSTITUTOS | IN |
| 030 | PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS | VP |
| 034 | INTERMEDIARIOS FINANCIEROS | IF |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Catálogo Entidad Contrapartes | | |
| **Clave** | **Identificador** | **Descripción** |
| 001 | 900000 | Otros |
| 002 | 900001 | Schroders Plc. |
| 003 | 900002 | Blackrock Inc. |
| 004 | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 005 | 900004 | Amundi Asset Management |
| 006 | 900005 | Nomura Holdings, Inc . |
| 008 | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 009 | 900008 | Ninety One PLC |
| 010 | 900009 | Alliance Bernstein |
| 012 | 950001 | Allfunds Bank, S.A.U. |
| 013 | 950002 | Fundvest, Pershing LLC |
| 014 | 950003 | MFEX Mutual Funds Exchange AB |
| 015 | 900011 | Fidelity International |
| 016 | 900012 | J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| 017 | 900013 | Pictet Asset Management (Europe) S.A. |
| 018 | 900014 | Goldman Sachs Asset Management International |
| 019 | 900015 | Morgan Stanley Investment Management Inc |
| 020 | 900016 | Vanguard Group |
| 021 | 900017 | Natixis |
| 022 | 900018 | WisdomTree Investments, Inc. |
| 023 | 900019 | State Street Corporation |
| 024 | 900020 | DWS Investments |
| 025 | 900021 | Sherpa Capital |
| 026 | 900022 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA) |
| 027 | 900023 | FirstTrust |
| 028 | 900024 | Baillie Gifford |
| 029 | 900025 | UBS AG |
| 030 | 900026 | AXA Invesment Managers |
| 031 | 900027 | BNP Paribas Asset Management |
| 032 | 900028 | GAM Holding AG |
| 033 | 900029 | Invesco Capital Management |
| 034 | 900030 | Janus Henderson Investors |
| 035 | 900031 | Jupiter Asset Management Limited |
| 036 | 900032 | NN Investment Partners B.V. |
| 037 | 900033 | Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO") |
| 038 | 900034 | Columbia Threadneedle Investments |
| 039 | 900035 | UTI Asset Management |
| 040 | 900036 | Nikko Asset Management |
| 041 | 900037 | Global X |
| 042 | 900038 | VanEck |
| 043 | 900039 | KraneShares |
| 044 | 900040 | ProShares |
| 045 | 900041 | Brown Advisory (Ireland) Limited |
| 046 | 900042 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |
| 047 | 900043 | Acadian Asset Management LLC |
| 048 | 900044 | Man Group |
| 049 | 900045 | Berenberg |
| 050 | 900046 | Finamex |
| 051 | 900047 | ODDO BHF Asset Management SAS |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 01 | MXP | Peso |
| 02 | USD | Dólar Americano |
| 03 | UDI | Unidades de Inversión |
| 06 | JPY | Yen Japonés |
| 07 | EUR | Euros |
| 08 | AUD | Dólar Australiano |
| 09 | CAD | Dólar Canadiense |
| 10 | CHF | Franco Suizo |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |
| 12 | HKD | Dólar Hong Kong |
| 13 | DKK | Corona Danesa |
| 14 | SEK | Corona Sueca |
| 15 | NOK | Corona Noruega |
| 16 | BRL | Real Brasileño |
| 17 | ILS | Shekel Israelí |
| 18 | CLP | Peso Chileno |
| 19 | INR | Rupia |
| 20 | CNY | Renminbi chino |
| 21 | PLN | Zloty Polaco |
| 22 | CZK | Corona checa |
| 23 | HUF | Florín Húngaro |
| 24 | RON | Leu Rumano |
| 25 | LVL | Lats Letones |
| 26 | LTL | Litas Lituanas |
| 27 | EEK | Corona Estonia |
| 28 | BGN | Lev Búlgaro |
| 29 | ISK | Corona Islandesa |
| 30 | COP | Peso Colombiano |
| 31 | KRW | Won Surcoreano |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Activo** | |  | **Catálogo de Tipos de Activos subyacentes** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 00 | No aplica |  | 01 | Acción |
| 01 | Acción |  | 02 | Mercancías |
| 02 | Mercancías |  | 03 | Renta Fija |
| 03 | Renta Fija |  | 04 | Inmobiliario11 |
| 04 | Inmobiliario11 |  | 05 | Divisas |
| 05 | Instrumentos Financieros Derivados |  | 99 | Otro |
| 06 | Vehículos de Inversión12 |  |  |  |
| 07 | Fondo Mutuo |  |  |  |
| 08 | Reportos |  |  |  |
| 09 | Préstamo de Valores |  |  |  |
| 10 | Efectivo |  |  |  |
| 99 | Otro |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Vehículo** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Accionario |
| 02 | Inmobiliario11 |
| 03 | Mercancías |
| 04 | Renta Fija |
| 05 | Mixto |
| 99 | Otro |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Alemania |  | 27 | Hungría |
| 02 | Australia |  | 28 | Letonia |
| 03 | Austria |  | 29 | Lituania |
| 04 | Bélgica |  | 30 | Malta |
| 05 | Canadá |  | 31 | República Checa |
| 06 | Dinamarca |  | 32 | Suecia |
| 07 | España |  | 33 | Brasil |
| 08 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 34 | China |
| 09 | Finlandia |  | 35 | India |
| 10 | Francia |  | 36 | Otro |
| 11 | Grecia |  | 37 | Rumanía |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 38 | Noruega |
| 13 | Hong Kong |  | 39 | Chile |
| 14 | Irlanda |  | 40 | Israel |
| 15 | Italia |  | 41 | Bulgaria |
| 16 | Japón |  | 42 | Colombia |
| 17 | Luxemburgo |  | 43 | Corea del Sur |
| 18 | México |  | 44 | Islandia |
| 19 | Polonia |  | 45 | Perú |
| 20 | Portugal |  | 46 | Singapur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 47 | Malasia |
| 22 | Suiza |  | 48 | Nueva Zelanda |
| 23 | Chipre |  | 49 | Sudáfrica |
| 24 | Eslovaquia |  | 50 | Tailandia |
| 25 | Eslovenia |  | 51 | Taiwán |
| 26 | Estonia |  | 52 | Croacia |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | | |
| **Identificador** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | Standard & Poor's, S.A. de C.V. | S&P |
| 4 | Fitch México, S.A. de C.V. | FITCH |
| 5 | Moody's de México SA de CV | MOODY'S |
| 6 | HR Ratings de México S.A. de C.V. | HR Ratings |
| 7 | Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V. | Verum |
| 8 | DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V. | DBRS Ratings México |
| 99 | Otra |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | | | |
| **Fitch IBCA** | **Moody's** | **Standard &** **Poor's** | **HR Ratings** | **VERUM** | **DBRS Ratings** **México** | **Identificador** |
| Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local | | | | | | |
| AAA (mex) | AAA.mx | mxAAA | HR AAA | AAA/M | AAA.MX | 1000 |
| AA+ (mex) | AA+.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | AA.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | AA-.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A+.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A-.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | BBB+.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | BBB.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | BBB-.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | BB+.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | BB.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | BB-.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B+.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B-.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | CCC+.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | CCC.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | CCC-.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | CC.mx | mxCC | HR C | C/M | CC.MX | 1019 |
| C (mex) | C.mx | mxC | HR C- |  | C.MX | 1020 |
| D (mex) |  | mxD | HR D | D/M | D.MX | 1021 |
| Calificaciones Corto Plazo en Escala Local | | | | | | |
| F1+ (mex) | ML A-1.mx | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | ML A-2.mx | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | ML A-3.mx | mxA-2 | HR2 | 2/M | R-1.MX(bajo) | 1024 |
| F3 (mex) |  | mxA-3 | HR3 | 3/M | R-2.MX - R-3.MX | 1025 |
| B (mex) | ML B.mx | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) | ML C.mx | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
|  |  |  | HR D |  |  | 1056 |
| Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global | | | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) |  | AAA | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) |  | AA(high) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) |  | AA | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) |  | AA(low) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) |  | A(high) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) |  | A | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) |  | A(low) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) |  | BBB(high) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) |  | BBB | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) |  | BBB(low) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) |  | BB(high) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) |  | BB | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) |  | BB(low) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) |  | B(high) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) |  | B | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) |  | B(low) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) |  | CCC(high) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  |  | CCC | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  |  | CCC(low) | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) |  | CC | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) |  | C | 1048 |
| D | D | D | HR D (G) |  | D | 1049 |
| Calificaciones Corto Plazo en Escala Global | | | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) |  | R-1(high) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) |  | R-1(middle) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) |  | R-1(low) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) |  | R-2 - R-3 | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) |  | R-4 - R-5 | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) |  | D | 1055 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Proveedores de Índices** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | FTSE |  | 17 | InteractiveData |
| 02 | Barclays |  | 18 | SocieteGeneral |
| 03 | NYSE |  | 19 | IPOX |
| 04 | ICE |  | 20 | Stoxx |
| 05 | BolsaMexico |  | 21 | JohnHancock |
| 06 | WisdomTree |  | 22 | BolsaJapon |
| 07 | CRSP |  | 23 | Morningstar |
| 08 | BolsaAlemania |  | 24 | BolsaFrancia |
| 09 | SPDJI |  | 25 | Russell |
| 10 | Nasdaq |  | 26 | ScientificBeta |
| 11 | MSCI |  | 27 | Solactive |
| 12 | GoldmanSachs |  | 28 | SSGA |
| 13 | BolsaEspana |  | 29 | Valmer |
| 14 | INDXX |  | 30 | Tokio Stock Exchange |
| 15 | iBoxx |  | 99 | Otro |
| 16 | ISE |  |  |  |

|  |
| --- |
|  |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal. Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

En caso de estar reportando tasas, se deberá hacerlo en forma de porcentaje con el número de decimales que estipule la longitud del campo.

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apostrofes; en caso de no existir, se anotará un espacio vacío. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

5 Espacios en Blanco (Vacíos). Sirve para rellenar el espacio sobrante del registro con respecto a la longitud máxima, esto con el fin de que no contenga información fuera de la especificada.

6 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país.

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

7 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

8 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9 El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

10 El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

11 Hace referencia a FIBRAS, REITS o similares.

12 Hace referencia a ETFs de cualquier tipo de subyacente o Vehículos inmobiliarios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

I.     El envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del protocolo de transferencia de archivos SFTP.

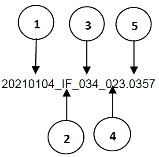
II.     Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Fondos Mutuos.

III.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | Tipo de Dato | Descripción |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. Constante = "IF". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la clave del Catálogo tipo de entidad anexo al documento. Constante = "034". |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la Clave' del Catálogo Entidad Contraparte anexo al documento. |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = "0357". |

       NOTA: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

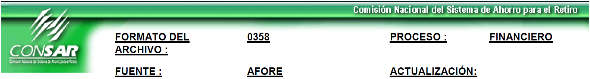
       Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la entidad State Street Corporation (Intermediario Financiero) estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

A20210104\_IF\_034\_023.0357

**Anexo 148**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| Información de Tipo Agregada.- Este archivo contiene los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL** **REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| **DIARIO** | **DIARIO** | 129 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

|  |
| --- |
| **ENCABEZADO** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato de transmisión | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3375910.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000".1 |
| 2 | Número de registros | **-** | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.1 |
| 3 | Tamaño del registro | **-** | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = Constante "129".1 |
| 4 | Tipo de archivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3379125.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0358".1 |
| 5 | Tipo de Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3381764.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, Constante = "001".1 |
| 6 | Entidad | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3384403.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad AFORE a que corresponda la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades (AFORE), anexos. 1 |
| 7 | Fecha de información | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3387042.png | F | 8 | 0 | 27 | 34 | Fecha de la Información a que se reporta que corresponde al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato.3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 95 | 0 | 35 | 129 | Vacíos.5 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLES** |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información de los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3392558.png | AN | 2 | 0 | 1 | 2 | Identificador de registro Constante "301"4. |
| 2 | Tipo de Mercado | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3395197.png | AN | 2 | 0 | 3 | 4 | Se deberá reportar "MD" cuando se refiera a instrumentos de Mercado de Deuda o "MC" cuando se refiera a instrumentos de Mercado de Capitales4. |
| 3 | ISIN | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3397836.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN5. |
| 4 | CUSIP o CINS | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3400475.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS6. |
| 5 | SEDOL | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3403114.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL7. |
| 6 | Tipo de Valor | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3405753.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | Tipo de Valor4. |
| 7 | Emisora | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3408392.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Nombre de la Emisora4. |
| 8 | Serie | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3411031.png | AN | 7 | 0 | 44 | 50 | Serie de la Emisora.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.4. |
| 9 | Consecutivo | https://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2023/07/07/MAT/shcp14_Cimg_3413670.png | AN | 10 | 0 | 51 | 60 | Clave que se le otorgó como consecutivo al activo4. |
| 10 | Precio Sucio |  | N | 9 | 6 | 61 | 75 | Precio de valuación en pesos calculado por la AFORE, deberá ser 24hrs2. |
| 11 | Precio Limpio |  | N | 9 | 6 | 76 | 90 | En caso de que el ID 2 "Tipo de Mercado" sea "MD", se deberá indicar el Precio Sucio devengando los intereses al día de valuación, en pesos, computado por la AFORE, deberá ser 24hrs2.  En otro caso deberán reportar el Precio de valuación en pesos calculado por la AFORE, deberá ser 24hrs2. |
| 12 | Intereses |  | N | 6 | 6 | 91 | 102 | En caso de que el ID 2 "Tipo de Mercado sea "MD", se deberá indicar el Factor de Interés en pesos que se aplica al título de acuerdo a las características del mismo calculado al día de valuación por la AFORE2.  En otro caso deberán reportar ceros2 |
| 13 | Días por Vencer |  | N | 6 | 0 | 103 | 108 | Son los días que faltan para el vencimiento de la emisión1. |
| 14 | Tasa de descuento |  | N | 3 | 6 | 109 | 117 | Tasa de Descuento de la Emisión2. |
| 15 | Tasa de Rendimiento |  | N | 6 | 6 | 118 | 129 | Para el caso de instrumentos de deuda se deberá anotar la tasa de rendimiento al vencimiento del instrumento. En otro caso 0.2 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Entidades (AFORE)** | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI Banorte |
| 534 | Profuturo |
| 538 | Principal |
| 544 | SURA |
| 550 | Inbursa |
| 552 | Citibanamex |
| 556 | Azteca |
| 562 | Invercap |
| 568 | Coppel |
| 578 | PensionISSSTE |

|  |
| --- |
| **VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO** |

**Validaciones para formato de los datos**

Notas generales para la validación del formato de datos en los archivos.

1 Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

2 Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos,

comas y puntos decimales. La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

3 Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:

       DD = día

       MM = mes

       AAAA = año

4 Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

5 ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

       1 y 2: corresponden al prefijo del país

       3: corresponde al identificador de región

       4 al 9: corresponden al identificador del emisor

       10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

       12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

6 CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

7 SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO** |

En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:

       1° ISIN, de no existir éste,

       2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

       3° SEDOL.

Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores.

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando el valor asignado por la AFORE sin contraponerse a las observaciones de cada campo; de lo contrario se llenarán con un CERO y espacios en blanco.

|  |
| --- |
| **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO** |

Políticas a seguir en la transmisión de la información

La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

**I.**     La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.

**ll.**     Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

**III.**    Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).

**IV.**   La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

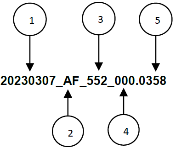
**V.**    El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

**VI.**   El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **No.** | **TIPO DE DATO** | **DESCRIPCIÓN** |
| 1 | 8 Dígitos Numéricos | En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "AF". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuales serán conforme a la clave de entidad que se reporta conforme al catálogo de Entidades AFORES anexo al documento. |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será Constante = "000") |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0358". |

NOTA: La separación entre el paso 1, 2 y 3 serán con un guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Afore Citibanamex estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo enviaron, solo tendrán que agregar el carácter "A" antes de la fecha, ejemplo:

**A20180307\_AF\_552\_000.0358**

**VII.**   Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Normal | /export/home/rec/FINAN/RECEPCION |
| Envío por Retransmisión | /export/home/rec/FINAN/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | /export/home/rec/FINAN/TRANSMISION |

       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION |
| Recuperación de Acuse de pruebas | /export/home/rec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION |

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_