**Circular CONSAR 19-20, 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 15 de marzo de 2018)**

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

**CIRCULAR CONSAR 19-20, 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 II, 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 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", modificadas y adicionadas, 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 se estima conveniente que las Sociedades de Inversión proporcionen la información sobre el índice de rentabilidad diaria del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión, de tal manera que esta Comisión pueda evaluar la gestión y desempeño de las Sociedades de Inversión de acuerdo a sus portafolios de referencia;

Que en términos de lo establecido en las "Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro", resulta necesario que esta Comisión conozca de las certificaciones de los Funcionarios encargados del área de inversiones, del área de riesgos, de la contraloría normativa que ejerzan sus labores en materia financiera de las Sociedades de Inversión, de las áreas o actividades de confirmación, liquidación, asignación, registro contable y generación de estados financieros de las operaciones de inversión de las Sociedades de Inversión, que acrediten sus conocimientos generales en materia de inversiones para ejercer las funciones que desempeñen, así como de su vigencia;

Que las modificaciones a las "Reglas para la realización de Operaciones Derivadas" contenidas en la Circular 4/2012 emitidas por Banco de México, entre otros, establecieron los criterios para determinar las operaciones derivadas estandarizas, las cuales estarán sujetas a la compensación y liquidación en entidades que funjan como contrapartes centrales; y que la Junta de Gobernadores del Sistema de la Reserva Federal en conjunto con la Comisión de Negociación de Futuros de Productos Básicos de los Estados Unidos de América estableció la obligación para las instituciones financieras que realicen operaciones derivadas en referido país de establecer contratos de intercambio de colateral con todas sus contrapartes, entre las cuales se encuentran las Administradoras de fondos para el retiro, por lo que es necesario que esta Comisión identifique claramente aquellos instrumentos que liquidan con contrapartes centrales o que se encuentren respaldadas por un contrato de intercambio de colateral con contrapartes nacionales o internacionales, así como las curvas para la valuación de dichas operaciones;

Que de conformidad con el Anexo M de 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", las Administradoras pueden replicar los índices o subíndices dictaminados por el experto independiente como una alternativa de inversión, y en este sentido, algunas Administradoras han implementado una estrategia de inversión adquiriendo directamente Valores Extranjeros de Renta Variable con el fin de replicar uno o varios índices permitidos, por lo que se estima conveniente que las Sociedades de Inversión proporcionen la información que permita supervisar diariamente el cumplimiento a los límites establecidos en el régimen deinversión;

Que derivado de diversos cambios regulatorios, se requiere de una continua actualización de los distintos formatos que se utilizan para el envío de la información; y

Que dando cumplimiento al "Acuerdo que fija los lineamientos que deberán ser observados por las dependencias y organismos descentralizados de la Administración Pública Federal, en cuanto a la emisión de los actos administrativos de carácter general a los que les resulta aplicable el artículo 69-H de la Ley Federal

de Procedimiento Administrativo", a causa de la expedición de la presente Circular, se deroga la fracción XII de la regla Novena; la obligación de las Sociedades de Inversión de reportar la información del Anexo 79 relativo al desglose de operaciones con notas estructuradas, y se simplifica la información de flujos de efectivo incluida en el Anexo 78, ha tenido a bien a expedir la siguiente:

**CIRCULAR CONSAR 19-20, 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 **ADICIONAN** la fracción XVII de la regla Séptima, y la fracción XXII de la regla Novena; y se **DEROGA** la fracción XII, de la regla Novena 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 y CONSAR 19-19publicadas 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 y 6 de septiembre de 2017 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

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

I a XVI. **...**

**XVII.**     **Información de las certificaciones y especificaciones sobre los Funcionarios que realizan actividades y labores en materia financiera dentro de las Sociedades de inversión, de conformidad con el formato establecido como anexo 121 de las presentes reglas generales."**

**"NOVENA.-**La información que las Sociedades de Inversión deberán proporcionar a la Comisión consistirá en:

I a XI. **...**

**XII.**       **Se deroga.**

XIII a XXI. **...**

**XXII.**     **Información sobre el índice de rentabilidad diaria del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión, de conformidad con el formato establecido como anexo 122 de las presentes reglas generales."**

**SEGUNDO.-** Se **MODIFICAN** los anexos 74, 75, 77, 78, 79, 80, 92, 94, 111, 112 y 120, se **ADICIONAN**los anexos 121 y 122, y se **DEROGA** el anexo 97 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 y CONSAR 19-19publicadas 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, y 6 de septiembre de 2017 respectivamente, para quedar en los términos de los Anexos 74, 75, 77, 78, 79, 80, 92, 94, 111,112, 120, 121 y 122 de las presentes modificaciones y adiciones.

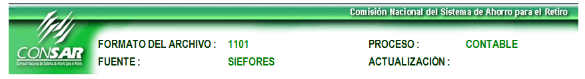
**TRANSITORIA**

**ÚNICA.**- Las presentes modificaciones y adiciones entrarán en vigor a los 60 días hábiles siguientes de su publicación en el Diario Oficial de la Federación.

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

Ciudad de México, 28 de febrero de 2018.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro,**Carlos Ramírez Fuentes**.- Rúbrica.

**Anexo 74**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene la Balanza de comprobación diaria de las Sociedades de Inversión a primer y segundo nivel. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO. | 77 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_54947.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**"**077**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_58484.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante"1101".**1 |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_60219.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta lainformación, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_61954.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_63689.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos.1 |
| 8 | Fecha de Operación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_65424.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de la operación que se reporta a CONSAR.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 45 | 0 | 33 | 77 | Vacíos. 6 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** BALANZA DIARIA | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_70669.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | Clave de Cuenta | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_72418.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Es la clave de la Cuenta Mayor de acuerdo al Catálogo de Cuentas Contables Vigente. 1 |
| 3 | Clave de Subcuenta | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_74271.png | N | 6 | 0 | 8 | 13 | Clave de la Subcuenta de acuerdo al Catálogo deSubcuentas Vigente. 1 |
| 4 | Saldo Inicial |  | N | 14 | 2 | 14 | 29 | Saldo de la Cuenta o Subcuenta (debe ser el saldo final del día anterior). 2 |
| 5 | Cargos |  | N | 14 | 2 | 30 | 45 | Cargos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante eldía. 2 |
| 6 | Abonos |  | N | 14 | 2 | 46 | 61 | Abonos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante eldía. 2 |
| 7 | Saldo Final |  | N | 14 | 2 | 62 | 77 | Saldo de cierre de Cuenta o Subcuenta al final del día. 2 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BASICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| 004 | SIEFORES PREVISION 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 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |
| --- |
| **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.

Las posiciones disponibles para la parte decimal se deben reservar para ello, si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros.

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; 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 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.    La información que enviarán las entidades, deberá mantener un día hábil de desfase del cierre del proceso operativo diario.

IV.   Sólo será transmitida la información de las operaciones y del proceso que se realicen durante el procedimiento operativo diario (los procesos y operaciones que no tengan operación no serán transmitidos).

V.    Para cada registro del detalle: Saldo final debe ser igual al saldo inicial más la suma de todos los cargos menos la suma de todos los abonos.

VI.   Todos los montos deberán venir con el signo adecuado dependiendo de la naturaleza de la cuenta:

a.   Cuenta Deudora: Saldo Deudor (+); Saldo Acreedor (-)

b.   Cuenta Acreedora: Saldo Deudor (-); Saldo Acreedor (+)

VII.   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.

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

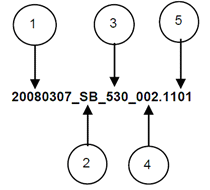
IX.   El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 AportacionesVoluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que sereporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicará para familia deSIEFORES. |
| 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 = "1101"**. |

**NOTA:**  La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 serán con un guión 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 dos, 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\_002.1101.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\_002.1101**

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

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

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

       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

**Anexo 75**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información del desglose de operaciones de compraventa durante el día. | | | |
| **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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_144988.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_148525.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante"0316".** 1 |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_150260.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. 1 |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_151995.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_153730.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. 1 |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_155465.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de la Operación que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 171 | 0 | 33 | 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_160710.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | Número consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_162459.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 Catálogode Tipo de Inversión únicamente:  0 para Directo,  1 para Reporto,  6 para Préstamo de Valores  12 Para Posición en efectivo denominada en cualquierdivisa se debe considerar los montos en AIMS yexcedentes y se debe reportar también el efectivo enpesos,  13 para Posición de salida en Efectivo denominada encualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos,  14 para Inversiones Tercerizadas 1. |
| 4 | Tipo de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 9 | 10 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogode Tipo de Liquidación. En caso de ser InversionesTercerizadas se deberá anotar 011. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 5 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 11 | 12 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo deTipo de Instrumento1. |
| 6 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_167301.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_169120.png | AN | 9 | 0 | 25 | 33 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.13 |
| 8 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_170939.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_172758.png | AN | 4 | 0 | 41 | 44 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso deEfectivo en pesos se deberá anotar EF. 5 |
| 10 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_174577.png | AN | 7 | 0 | 45 | 51 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas deberá ser definido por la Siefore paracada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV.5 |
| 11 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_176396.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 seincrementará para cada contrato con un mismomandatario. Para el caso de Efectivo en pesos sedeberá 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_178215.png | AN | 10 | 0 | 59 | 68 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios al activo. Para el caso de InversionesTercerizadas 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 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 (PrecioLimpio). En caso de ser operaciones en efectivo seanotará el tipo de cambio pactado. En caso de serInversiones 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 operadosincluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación).  En caso de que los valores reportados no cuenten conintereses devengados se deberá reportar el mismomonto que el campo 15 del presente formato "Costounitario".  En caso de ser operaciones en efectivo o inversionesTercerizadas 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 materiafinanciera 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. Encaso de ser operaciones en efectivo o InversionesTercerizadas 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 paraoperaciones en Divisas distintas al peso mexicano. Encaso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenarcon ceros2,9. |
| 22 | País de adquisición |  | N | 2 | 0 | 164 | 165 | Se deberá anotar el identificador del país donde seadquirió el activo conforme al Catálogo de Países1. |
| 23 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 166 | 171 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo deContrapartes.  En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13:  -En caso de ser operaciones de compra/venta dedivisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientosForwards de divisas se reportará el identificador de lacontraparte correspondiente a la operación.  -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 lasoperaciones de acciones propias, amortizaciones yvencimientos 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 yNo=01. |
| 26 | Medio de concertación |  | N | 1 | 0 | 177 | 177 | Se deberá anotar el medio de concertación de laoperación:  0 = No aplica  1 = Telefónico  2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse elSistema de concertación y el tipo de postura en laoperación1. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 27 | Sistema de concertación |  | N | 2 | 0 | 178 | 179 | En el caso de que el medio de concertación seaelectrónico 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 deobservaciones el sistema de concertación usado.  0 No aplica  1 MEI  2 SIPO  3 VAR  4 MEIPresval  5 Corros Monex  99 OTRO1. |
| 28 | Tipo de postura |  | N | 1 | 0 | 180 | 180 | Se deberá anotar el tipo de postura de la operación decompra 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 casode haber utilizado el Identificador 076000 "otrosoperadores" 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | 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 deDeuda al que se vinculan los InstrumentosEstructurados |  | 8 | 168 | 168 Hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 12 | Ef | Posición en Efectivo denominada en cualquierdivisa |  | 9 | 192 | 192 Hrs. |
| 13 | Ec | Posición de salida en Efectivo denominada encualquier divisa. |  |  |  |  |
| 14 | Lt | Inversiones tercerizadas |  |  |  |  |
| 15 | Ge | Garantías entregadas por instrumentosEstructurados |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 PrincipalProtegido a Vencimiento |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |  | 9 | TRK | Instrumentos conocidos comoTrackers |
| 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 |  |  |  |  |
| 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 |
| 99 | OTRO |

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

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Contrapartes** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 002001 | Banco de México |  | 080029 | Portfolio Investment Incorporated |
| 013001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 080030 | Arka International, Corp. |
| 013004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 080031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |
| 013005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 080032 | Banorte Asset Management,Inc. |
| 013006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 080033 | Afin International Holdings,Inc. |
| 013007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 080034 | Banorte I, LLC. |
| 013010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 080037 | Invex International, S.A. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 013011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 080038 | Invex Worldwide, S.A. |
| 013012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 080041 | Inbursa International, Inc. |
| 013013 | IXE Casa de Bolsa |  | 080042 | Inbursa Securities, Inc. |
| 013015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 080043 | IXE Holdings, Inc. |
| 013018 | Casa de Bolsa Arka |  | 082004 | Bancomer Oficina de Representación en LaHabana, Cuba. |
| 013019 | Value Casa de Bolsa |  | 082006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |
| 013020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 082008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013021 | Monex Casa de Bolsa |  | 082009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |
| 013026 | Vector Casa de Bolsa |  | 082010 | Banamex Oficina de Representación enDusseldorf, Alemania. |
| 013027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 082011 | Banamex Oficina de Representación enSingapur, Singapur. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 013032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 082012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |
| 013040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 082013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |
| 013041 | Invex Casa de Bolsa |  | 082014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |
| 013104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 082016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |
| 013105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 082025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona,E.U.A. |
| 013106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 082027 | Internacional Oficina de Representación enBuenos Aires, Argentina. |
| 013109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 082028 | Internacional Oficina de Representación enMadrid, España. |
| 013114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |
| 013117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 082031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |
| 013118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 082035 | Confia Oficina de Representación en NuevaYork, N.Y., E.U.A. |
| 013119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 082037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013120 | UBS Casa de Bolsa |  | 082039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 013122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 082043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |
| 013123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 082044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 013124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 082048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 013125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 013126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 082050 | Banamex Oficina de Representación enLondres, Inglaterra |
| 013127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 013129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 013130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A.de C.V. |  | 701001 | Abasis |
| 013131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701002 | American Express (Extranjero) |
| 016031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 016035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A.(Extranjero) |
| 016040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 016041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 016044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 016067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 016240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 016408 | B y B Casa de Cambio |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 016419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 016507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 016533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 016587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701014 | Cargill Financial Service International(Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 016629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 016712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 016714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 016715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 016717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 016718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 016719 | Unica Casa de Cambio |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 025001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 025002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito deValores |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 025007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 025013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 025014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 037006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 037009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 037019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London,England |
| 037135 | Nacional Financiera |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 037166 | Banco del Ahorro Nacional y ServiciosFinancieros |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |
| 037168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 040002 | Banco Nacional de México |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 040012 | BBVA Bancomer |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 040014 | Banco Santander |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 040017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest)(Extranjero) |
| 040021 | HSBC México |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 040022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 040030 | Banco del Bajío |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 040032 | Ixe Banco |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 040036 | Banco Inbursa |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |
| 040037 | Banco Interacciones |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 040042 | Banca Mifel |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 040044 | Scotiabank Inverlat |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 040058 | Banco Regional de Monterrey |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank)(Extranjero) |
| 040059 | Banco Invex |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |
| 040060 | Bansi |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 040062 | Banca Afirme |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale(Extranjero) |
| 040072 | Banco Mercantil del Norte |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 040102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 040103 | American Express Bank (México) |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 040106 | Bank of America México |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 040108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 040110 | Banco J.P. Morgan |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 040112 | Banco Monex |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 040113 | Banco Ve por Más |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 040116 | ING Bank (México) |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |
| 040124 | Deutsche Bank México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 040126 | Banco Credit Suisse México |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones(Bladex) (Extranjero) |
| 040127 | Banco Azteca |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 040128 | Banco Autofin México |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 040129 | Barclays Bank México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 040130 | Banco Compartamos |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 040131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 040132 | Banco Multiva |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 040133 | Banco Actinver |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 040134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 040136 | Banco Regional |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 040137 | BanCoppel |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 040138 | Banco Amigo |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 040139 | UBS Bank México |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 040140 | Banco Fácil |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 040141 | Volkswagen Bank |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 040142 | El Banco Deuno |  | 801160 | Acciones Propias |
| 040143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 040144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801162 | Bank West |
| 040145 | Banco Base |  | 801163 | Bcpbank Canada |
| 046048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801164 | Bridgewater Bank |
| 047005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 076000 | Otros Operadores |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 076001 | Derfin |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 076008 | Stock & Price |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 076010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 076014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 076018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 076022 | Darka |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 076029 | Grupo Especializado en Futuros y OtrosDerivados |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |
| 076043 | Timber Hill LLC. |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 076044 | Enlace Derivados |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 076048 | Intercam Derivados |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |
| 079001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 079003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California,E.U.A. |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |
| 079004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware,E.U.A. |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 079005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 079006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 079009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 079010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801183 | Regions Bank |
| 079012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.-República de Irlanda |  | 801184 | National City Bank |
| 079013 | Banamex-Accival International Fund Plc.-República de Irlanda |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 079014 | Serfin International Bank and Trust - IslasCaimán |  | 801186 | State Street B&TC |
| 079015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc.,California, E.U.A. |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 079016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 079017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 079018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 079022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801191 | North Fork Bank |
| 079023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 079024 | CMX International Bank and Trust.- IslasCaimán. |  | 801193 | Bank Of The West |
| 079025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa HoldingsCorp. |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 079026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 801195 | Northern TC |
| 079027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 079028 | BBVA Bancomer USA |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 079029 | Dinero Express |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 079030 | Banorte USA Corporation |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 079031 | INB Financial Corp. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 079032 | INB Delaware Corporation |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 079033 | Inter Nacional Bank |  | 801202 | Santander USA |
| 080000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 801203 | CME Clearing |
| 080001 | Acci Securities Incorporated |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 080004 | Afin Securities International Limited |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 080005 | Arka Securities Incorporated |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 080008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 080009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 080013 | Vectormex Incorporated |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 080014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900000 | Otros mandatarios |
| 080015 | Vectormex International Incorporated |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 080019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 080020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 080021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900004 | Pioneer Investment Management Ltd. |
| 080022 | Valores Finamex Limited |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc. |
| 080023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900006 | Pioneer Investments Global Asset Management |
| 080024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 080025 | Monex Securities Incorporated |  | 900008 | Investec Asset Management |
| 080026 | Invex Incorporated |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 080027 | GBM International Incorporated |  | 920000 | Otros Socios Operadores |
| 080028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
|  |  |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |

|  |
| --- |
| **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; 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.

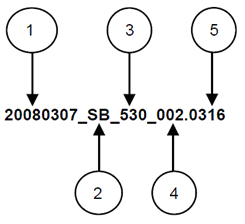
IV.   El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

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 cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de AportacionesVoluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que sereporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia deSIEFORES. |
| 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 dos, 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\_002.0316.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\_002.0316**

**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). | | | |
| **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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_378509.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_382046.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante"0314".1** |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_383781.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. 1 |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_385516.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_387251.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. 1 |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_388986.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de la Información que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 706 | 0 | 33 | 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_394236.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_395985.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_397838.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios.13 |
| 4 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_399691.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_401510.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_403343.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_405176.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_406911.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 deoperación. 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos 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 decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna posición larga en el contrato.1 |
| 15 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 165 | 166 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa deliquidación al vencimiento de la operación conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio conliquidación 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor ono. 3 |
| 19 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 187 | 194 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida ointercambia 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 ellayout. 3 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 21 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 203 | 218 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 22 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 219 | 232 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor absoluto. 1 |
| 23 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 233 | 235 | Se registrará el identificador de la divisa asociada altamaño 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 queproporcione el proveedor de precios. En otro casoreportar 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 dederivados 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 dederivados sobre Bonos. 2 |
| 31 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 290 | 290 | Se deberá anotar el medio de concertación de laoperación:  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 contrapartelimitado a 20 caracteres en caso de que no existaidentificador para la contraparte en el catálogo decontrapartes.  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 34 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 319 | 321 | Se registrará el identificador correspondiente a laagencia calificadora que emite la calificación reportadaen el concepto "Calificación contraparte primera" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación crediticiamínima de acuerdo a las disposiciones de caráctergeneral que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 36 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 326 | 328 | Se registrará el identificador correspondiente a laagencia calificadora que emite la calificación reportadaen el concepto "Calificación contraparte segunda" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación mínimaotorgada por una agencia calificadora distinta a lareportada en el concepto "Calificadora Contraparteprimera". 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 lacontraparte 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 losinstrumentos 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 enbolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo deContrapartes o el identificador "Otras Bolsas deDerivados" contenido en el catálogo de Contrapartescuando no exista identificador para la bolsa dederivados.  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 deDerivados" 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 sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador 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 20caracteres, 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 20caracteres 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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 49 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_444686.png | N | 14 | 0 | 629 | 642 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_461696.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante** "**302**". 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_463445.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_465180.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios asignado alcontrato. 13 |
| 4 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_466915.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_468650.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_470385.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_472120.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_473855.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 deoperación. 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 dederivados conforme al catálogo de Contrapartes, o elidentificador "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 deDerivados" 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos 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 decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon fecha valor o no. 3 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 21 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 215 | 222 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida ointercambia 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 ellayout. 3 |
| 23 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 231 | 246 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 24 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 247 | 260 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor absoluto. 1 |
| 25 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 261 | 263 | Se registrará el identificador de la divisa asociada altamaño 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 queproporcione el proveedor de precios. En otro casoreportar 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 dederivados 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 dederivados 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 laoperación:  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 losinstrumentos 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 20caracteres, 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 entidadliquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberáreportar 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 20caracteres 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 deCompensación del contrato según el catálogo decontrapartes. Si no existe el identificador para esaCámara de Compensación, se deberá reportar elidentificador "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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 42 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_505323.png | N | 14 | 0 | 567 | 580 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.1 |
| 43 | Espacios en blanco |  | AN | 158 | 0 | 581 | 738 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_510408.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "303"**. 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_512157.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_513892.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_515627.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_517362.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_519097.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_520832.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_522567.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 o 7 según el caso, delEstatus 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. 1 |
| 13 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 149 | 168 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas deDerivados" 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 |
| 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos que repliquen índices o Mercancías, sedeberá capturar el tipo valor, emisora y seriecorrespondiente al Vehículo. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 18 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 194 | 195 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa deliquidación al vencimiento de la operación conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio conliquidación 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 decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon fecha valor o no. 3 |
| 23 | Fecha de Liquidación |  | F | 8 | 0 | 219 | 226 | Se deberá anotar la fecha en que se liquida ointercambia 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 ofecha 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 envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 28 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 262 | 275 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor 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 altamaño 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. 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. 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 dederivados reportar ceros1 |
| 36 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 358 | 377 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartesiempre 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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte primera" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte segunda" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 laoperación:  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 lacontraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 44 | Delta de la opción |  | N | 2 | 6 | 563 | 570 | Delta calculada por la administradora utilizando losmodelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes 2 |
| 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 losinstrumentos 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 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 46 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 585 | 592 | En caso de que la operación haya requerido un sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador 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 |
| 47 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 593 | 612 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20caracteres, 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 |
| 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. 1 |
| 49 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 621 | 640 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20caracteres 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 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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. 1 |
| 51 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 649 | 668 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 52 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_563045.png | N | 14 | 0 | 669 | 682 | En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.1 |
| 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_568130.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "304"**. 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_569879.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_571614.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_573349.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_575084.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_576819.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_578554.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_580289.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 listadaen una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición enrelación 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon 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 aentregar.  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 contratoestandarizado. 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 pararesetear 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 pararesetear 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 aentregar 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 contratoestandarizado. 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 nocionalesdel swap sean distintas, se registrará en las tresprimeras posiciones la clave de la divisa asociada alnocional a entregar y en las siguientes 3 posiciones laclave 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 contratoestandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clavede la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre unaposición 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 alnocional 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 alnocional 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 deliquidación asociada a los flujos que entregará/recibirá la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, sedeberá reportar Pesos). 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 32 | Subyacente a entregar |  | AN | 18 | 0 | 272 | 289 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serieotorgado por el proveedor de precios al subyacente aentregar del swap reportado. Se deberá respetar elformato de cuatro posiciones para el tipo valor, sieteposiciones para la emisora y siete posiciones para laserie. En el caso de no utilizar completamente loscaracteres mencionados se dejarán los espacios enblanco. 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 Serieotorgado por el proveedor de precios al subyacente arecibir 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 delsubyacente 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 delsubyacente 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 signomás o menos de la tasa de referencia a entregar, seutilizarán 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 signomás o menos de la tasa de referencia a recibir, seutilizarán 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 recibirconforme 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 contratoestandarizado. 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 latasa 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 contratoestandarizado. 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 latasa 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 deAmortizaciones. 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 queliquiden 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 deDerivados" 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 contrapartelimitado a 20 caracteres en caso de que no exista lacontraparte 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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte primera" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte segunda" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 laoperación:  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 lacontraparte 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 losinstrumentos 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 sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador del socio operador que participó en laoperación conforme al catálogo de contrapartes. Si noexiste el identificador para dicha entidad, se deberáreportar 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 20caracteres, 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 deswap OTC que liquide en contrapartes centrales, sedeberá 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 20caracteres 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 deswap OTC que liquide en contrapartes centrales, sedeberá reportar el identificador de la Cámara deCompensación de la operación según el catálogo decontrapartes. Si no existe el identificador para dichaCámara de Compensación, se deberá reportar elidentificador "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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 64 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_631579.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 cadaestrategia definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.1 |
| 65 | Número de Contratos |  | N | 13 | 0 | 712 | 724 | Para el caso de swaps listados o swaps OTC queliquiden 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_637565.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "305"**. 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_639314.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_641049.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios.13 |
| 4 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_642784.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_644519.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_646254.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_647989.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_649724.png | AN | 10 | 0 | 49 | 58 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 9 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 59 | 67 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 ocompleto 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos que repliquen índices o Mercancías, sedeberá capturar el tipo valor, emisora y seriecorrespondiente al Vehículo. 5 |
| 19 | Sobretasa |  | N | 3 | 2 | 219 | 223 | Se deberán anotar los puntos porcentuales con signomás o menos de la tasa de referencia a entregar orecibir, 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 seconsiderará 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 considerarávigente 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. La cifra de aportaciones iniciales mínimas reportada en este detalle deberá ser igual a la reportada en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)", los excedentes de aportaciones iniciales mínimas deberán ser reportados en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)". | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_667423.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "306".** 1 |
| 2 | Tipo Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_669172.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Se deberá anotar el identificador del tipo de la garantía conforme al catálogo Tipo de Garantía. 1 |
| 3 | ISIN de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_670907.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | En caso de reportarse valores, se deberá anotar el ISIN proporcionado por el proveedor de precios.  En otro caso se llenará con ceros. 5 |
| 4 | Cusip o Cins de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_672642.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | En caso de reportarse valores, se deberá anotar elCUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor deprecios.  En otro caso se llenará con ceros. 13 |
| 5 | Sedol de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_674377.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | 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 |
| 6 | Tipo de Valor de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_676112.png | AN | 4 | 0 | 33 | 36 | 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 sedeberá anotar "EF". 15 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Emisora de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_677847.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | 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 sedeberá anotar "EFECTIV". 15 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 8 | Serie de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_679582.png | AN | 7 | 0 | 44 | 50 | 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 anotar990101.15 |
| 9 | Consecutivo de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_681317.png | AN | 10 | 0 | 51 | 60 | Se deberá reportar en cero justificado a la izquierda. 15 |
| 10 | Contraparte de la Garantía | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_683052.png | N | 8 | 0 | 61 | 68 | Identificador de la Contraparte en caso de que lagarantía se opere en el mercado OTC, para lo cual laclave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y estecampo con la contraparte según el CatálogoContrapartes.  En otro caso reportar ceros. 1 |
| 11 | Nombre corto de la contraparte de la garantía |  | AN | 20 | 0 | 69 | 88 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartelimitado a 20 caracteres en caso de que no exista lacontraparte en el catálogo de contrapartes. 5 |
| 12 | Clave de Bolsa de Derivados |  | N | 8 | 0 | 89 | 96 | En el caso que las posiciones de derivados asociadas a la garantía se encuentren listadas en una bolsa dederivados, se deberá anotar el identificador de la bolsade 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 |
| 13 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 97 | 116 | En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas deDerivados" 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 |
| 14 | Socio Liquidador |  | N | 8 | 0 | 117 | 124 | En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme alcatálogo de contrapartes. Si no existe el identificadorpara dicha entidad, se deberá reportar el identificador"Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 15 | Nombre Corto Socio liquidador |  | AN | 20 | 0 | 125 | 144 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20caracteres 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 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 16 | Cámara de Compensación |  | N | 8 | 0 | 145 | 152 | En caso de que las posiciones de derivados asociadas a las garantías utilicen una Cámara de Compensaciónpara su liquidación, se deberá reportar su identificadorde acuerdo al catálogo de contrapartes. Si no existe elidentificador para esa Cámara de Compensación, sedeberá reportar el identificador "Otras Cámaras deCompensación" contenido en el catálogo deContrapartes.  En otro caso reportar con ceros. 1 |
| 17 | Nombre Corto Cámara deCompensación |  | AN | 20 | 0 | 153 | 172 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 18 | Número de títulos |  | N | 14 | 0 | 173 | 186 | Para el caso de entrega o recepción de valores engarantía, 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, sedeberá reportar el monto en pesos. 1 |
| 19 | Valor Unitario a Mercado |  | N | 9 | 6 | 187 | 201 | Para el caso de entrega o recepción de valores engarantía, 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 deberáreportar 1. 2 |
| 20 | Valor de mercado en pesos de la garantía |  | N | 14 | 6 | 202 | 221 | Para el caso de valores entregados o recibidos engarantía 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, sedeberá reportar el monto en pesos entregado o recibido.1 |
| 21 | Valor de mercado en divisa |  | N | 14 | 6 | 222 | 241 | Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado en la divisa origen. 1 |
| 22 | Intereses Devengados |  | N | 14 | 2 | 242 | 257 | Importe de los Intereses devengados en pesos de lasgarantías a la fecha del reporte. 2 |
| 23 | Divisa de la Garantía |  | N | 2 | 0 | 258 | 259 | Se registrará el identificador de la divisa conforme alcatálogo de Divisas.1 |
| 24 | Traslado de dominio (Prenda Bursátil) |  | N | 2 | 0 | 260 | 261 | Se reportará 01 si la garantía reportada cuenta contraslado 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 |
| 25 | Factor de Aforo |  | N | 3 | 4 | 262 | 268 | Se deberá reportar el factor de aforo o "haircut" aplicable a la garantía reportada. 1 |
| 26 | Número de contrato |  | AN | 30 | 0 | 269 | 298 | Se deberá reportar el número de contrato marco al amparo del cuál fue entregada o recibida la garantía. 5 |
| 27 | Espacios en blanco |  | AN | 440 | 0 | 299 | 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_702553.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "307".** 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_704302.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_706037.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_707772.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_709507.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 6 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_711242.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_712977.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 8 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_714712.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_716447.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 elDetalle 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos que repliquen índices o Mercancías, sedeberá capturar el tipo valor, emisora y seriecorrespondiente al Vehículo. 5 |
| 15 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 3 | 0 | 163 | 165 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna posición larga en el contrato1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 16 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 166 | 167 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa deliquidación al vencimiento de la operación conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio conliquidación 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon 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 ellayout. 3 |
| 21 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 196 | 211 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 22 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 212 | 225 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor absoluto. 1 |
| 23 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 226 | 228 | Se registrará el identificador de la divisa asociada altamaño 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 forwardsintegrados. 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 queproporcione el proveedor de precios. En otro casoreportar 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 queproporcione el proveedor de precios. En otro casoreportar 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 dederivados sobre bonos según el Catálogo queproporcione el proveedor de precios. 5 |
| 32 | Precio de Cheapest to Deliver |  | N | 3 | 6 | 311 | 319 | Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso dederivados sobre Bonos. 2 |
| 33 | Medio de Concertación |  | N | 1 | 0 | 320 | 320 | Se deberá anotar el medio de concertación de laoperación:  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 contrapartelimitado a 20 caracteres en caso de que no exista lacontraparte 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 laagencia calificadora que emite la calificación reportadaen el concepto "Calificación contraparte primera" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación crediticiamínima de acuerdo a las disposiciones de caráctergeneral que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 38 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 356 | 358 | Se registrará el identificador correspondiente a laagencia calificadora que emite la calificación reportadaen el concepto "Calificación contraparte segunda" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación mínimaotorgada por una agencia calificadora distinta a lareportada en el concepto "Calificadora Contraparteprimera". 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 losinstrumentos 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 enbolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo deContrapartes, o el identificador "Otras Bolsas deDerivados" contenido en el catálogo de Contrapartescuando no exista identificador para la bolsa dederivados.  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 20caracteres de la bolsa de derivados en caso dereportarse 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 sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador 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 20caracteres, 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 reportarel 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 20caracteres 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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 51 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_755123.png | N | 14 | 0 | 659 | 672 | En caso de que la operación reportada forme parte deuna estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_760208.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante** "**308**". 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_761957.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_763692.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_765427.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_767162.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_768897.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_770632.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios.5 |
| 8 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_772367.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_774102.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 elDetalle 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 dederivados conforme al catálogo de Contrapartes, o elidentificador "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 deDerivados" 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos que repliquen índices o Mercancías, sedeberá capturar el tipo valor, emisora y seriecorrespondiente 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 decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon 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 ellayout. 3 |
| 23 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 224 | 239 | Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 24 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 240 | 253 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor absoluto. 1 |
| 25 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 3 | 0 | 254 | 256 | Se registrará el identificador de la divisa asociada altamaño 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 forwardsintegrados. 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 queproporcione el proveedor de precios. En otro casoreportar 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 dederivados 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 dederivados 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 laoperación:  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 lacontraparte 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 losinstrumentos 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 20caracteres, 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 entidadliquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberáreportar 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 20caracteres 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 deCompensación del contrato según el catálogo decontrapartes. Si no existe el identificador para esaCámara de Compensación, se deberá reportar elidentificador "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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 45 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_807372.png | N | 14 | 0 | 617 | 630 | En caso de que la operación reportada forme parte deuna estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.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) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_812457.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "309"**. 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_814206.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_815941.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_817676.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_819411.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_821146.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_822881.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 15 |
| 8 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_824616.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_826351.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 | 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. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 14 | Nombre Corto Bolsa de Derivados |  | AN | 20 | 0 | 150 | 169 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20caracteres de la bolsa de derivados en caso dereportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados"en el campo "Clave de Bolsa de Derivados"  En otro caso 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 Serieotorgado 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 sobreVehículos que repliquen índices o Mercancías, sedeberá capturar el tipo valor, emisora y seriecorrespondiente al Vehículo. 5 |
| 19 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 195 | 196 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa deliquidación al vencimiento de la operación conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio conliquidación 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 decotización del Subyacente del contrato conforme alcatálogo de divisas.  Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, sedeberá reportar la divisa que sería recibida asumiendouna 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 obonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hacereferencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono.  En otro caso 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon fecha valor o no. 3 |
| 24 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 220 | 227 | Se deberá anotar la fecha en que vence la opción ofecha 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 elDetalle 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 envalor absoluto en la divisa pactada. 2 |
| 28 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 255 | 268 | Se deberá anotar el número de contratos pactados envalor 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 altamaño 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 inicialmenteen la operación con puntos forwards integrados en sucaso. 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 secerró 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. 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. 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 lastres 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 primerasposiciones la clave de la divisa de cotización delsubyacente 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 CatálogoContrapartes.  En caso de ser una operación realizada en bolsa dederivados reportar ceros.1 |
| 39 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 408 | 427 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartesiempre 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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte primera" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 elmercado OTC se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte segunda" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 laoperación:  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 lacontraparte para fines de confirmar la operación. 5 |
| 47 | Delta de la opción |  | N | 2 | 6 | 613 | 620 | Delta calculada por la administradora utilizando losmodelos 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 losinstrumentos 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 |
| 49 | Socio Operador |  | N | 8 | 0 | 635 | 642 | En caso de que la operación haya requerido un sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador 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 |
| 50 | Nombre Corto Socio Operador |  | AN | 20 | 0 | 643 | 662 | Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20caracteres, 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 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 reportarel 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 |
| 52 | Nombre Corto Socio Liquidador |  | AN | 20 | 0 | 671 | 690 | Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20caracteres 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 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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. 1 |
| 54 | Nombre Corto Cámara de Compensación |  | AN | 20 | 0 | 699 | 718 | Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  En otro caso reportar vacío. 5 |
| 55 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_868631.png | N | 14 | 0 | 719 | 732 | En caso de que la operación reportada forme parte deuna estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_873716.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "310"**. 1 |
| 2 | Aperturas y Cierres | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_875465.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_877200.png | AN | 12 | 0 | 5 | 16 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 4 | Cusip o Cins | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_878935.png | AN | 9 | 0 | 17 | 25 | Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. 13 |
| 5 | Sedol | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_880670.png | AN | 7 | 0 | 26 | 32 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 6 | Tipo Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_882405.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_884140.png | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Clave de la Emisora del Instrumento derivado segúncatálogo que proporcione el proveedor de precios. 5 |
| 8 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_885875.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_887610.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo alasignado por el proveedor de precios. 15 |
| 10 | Bloomberg Ticker |  | AN | 9 | 0 | 60 | 68 | Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna alcontrato. 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 operaciónpactada ya sea que se pacte un instrumento derivadocon fecha valor o no. 3 |
| 15 | Tipo de Posición |  | N | 1 | 0 | 158 | 158 | En caso de tratarse de una operación de Swap listadaen una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición enrelación contrato estandarizado sea corta, se deberáreportar 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 aentregar.  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 contratoestandarizado. 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 contratoestandarizado. 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 pararesetear 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 pararesetear 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 aentregar 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 contratoestandarizado. 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 contratoestandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clavede la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre unaposición larga en el contrato estandarizado.  En otro caso se deberá registrar las tres primerasposiciones 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 aentregar 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 arecibir 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 deliquidación asociada a los flujos que recibirá/entregará la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, sedeberá reportar Pesos). 1 |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 31 | Subyacente a entregar |  | AN | 18 | 0 | 255 | 272 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serieotorgado por el proveedor de precios al subyacente aentregar del swap reportado. Se deberá respetar elformato de cuatro posiciones para el tipo valor, sieteposiciones para la emisora y siete posiciones para laserie. En el caso de no utilizar completamente loscaracteres mencionados se dejarán los espacios enblanco. 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 Serieotorgado por el proveedor de precios al subyacente arecibir 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 sobreVehículos 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 alcatálogo 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 signomás o menos de la tasa de referencia a entregar, seutilizarán 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 signomás o menos de la tasa de referencia a recibir, seutilizarán 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 recibirconforme 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 contratoestandarizado. 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 latasa 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 contratoestandarizado. 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 latasa 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 deAmortizaciones. 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 queliquiden 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 deDerivados" 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 contrapartelimitado a 20 caracteres en caso de que no exista lacontraparte 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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte primera" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 elmercado OTC, se registrará el identificadorcorrespondiente a la agencia calificadora que emite lacalificación reportada en el concepto "Calificacióncontraparte segunda" de acuerdo al catálogo deCalificadoras.  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 laoperación:  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 lacontraparte 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 losinstrumentos 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 sociooperador para ser realizada, se deberá reportar elidentificador del socio operador que participó en laoperación conforme al catálogo de contrapartes. Si noexiste el identificador para dicha entidad, se deberáreportar 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 20caracteres, 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 deswap OTC que liquide en contrapartes centrales, sedeberá 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 20caracteres 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 deswap OTC que liquide en contrapartes centrales, sedeberá reportar el identificador de la Cámara deCompensación de la operación según el catálogo decontrapartes. Si no existe el identificador para esaCámara de Compensación, se deberá reportar elidentificador "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 deCompensación limitado a 20 caracteres en caso dereportarse el identificador "Otras Cámaras deCompensación" en el campo "Cámara deCompensación".  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 forwardsintegrados. 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, alcierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdidadel día para derivados listados y la acumulada paraderivados OTC con el signo correspondiente). 2 |
| 65 | Folio para estrategia con derivados | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_938900.png | N | 14 | 0 | 712 | 725 | En caso de que la operación reportada forme parte deuna estrategia de inversión que involucre derivados sedeberá registrar un folio consecutivo, para cadaestrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será elmismo 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 losengrapados.  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 conderivados.1 |
| 66 | Número de Contratos |  | N | 13 | 0 | 726 | 738 | Para el caso de swaps listados o swaps OTC queliquiden 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 (THRESHOLDS) 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_943985.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "311".** 1 |
| 2 | Contraparte | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_945734.png | N | 8 | 0 | 4 | 11 | Se deberá reportar el identificador de la Contrapartesegún el Catálogo Contrapartes. 1 |
| 3 | Nombre Corto contraparte | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_947469.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 decontrapartes y que, en su caso, deberá coincidir con elnombre reportado en los detalles 1 a 4. 5 |
| 4 | Id Contrato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_949204.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 derivadosestablecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para elcómputo de consumo de las líneas operativas (threshold) según el catálogo de "Tipo de Neteo" |
| 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 omargen 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 almonto reportado en el campo "Threshold establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 8 | Threshold establecido por la SIEFORE |  | N | 9 | 0 | 46 | 54 | Se deberá anotar el monto denominado en divisa,establecido por la SIEFORE como línea operativa omargen operativo para la contraparte. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 9 | Divisa del Threshold establecido por la SIEFORE |  | N | 2 | 0 | 55 | 56 | Se reportará el identificador de la divisa asociada almonto reportado en el campo "Threshold establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. 1 |
| 10 | Manejo de Garantías |  | N | 1 | 0 | 57 | 57 | Se deberá registrar 1 si el contrato ISDA prevé manejode garantías con instrumentos financieros. De locontrario se deberá reportar cero.1 |
| 11 | Liquidación en Pesos |  | N | 1 | 0 | 58 | 58 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldoacreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en pesos.  En otro caso reportar 0. |
| 12 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas |  | N | 1 | 0 | 59 | 59 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldoacreedor/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 |
| 13 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo II de divisas |  | N | 1 | 0 | 60 | 60 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldoacreedor/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 |
| 14 | Liquidación de Threshold en divisas del Grupo III de divisas |  | N | 1 | 0 | 61 | 61 | Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldoacreedor/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 |
| 15 | Número de contrato |  | AN | 30 | 0 | 62 | 91 | Se deberá reportar el número de contrato marco. |
| 16 | Observaciones |  | AN | 647 | 0 | 92 | 738 | En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo"Tipo de Neteo", se deberán reportar característicasespeciales relacionadas con la forma en la que senetean 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 | Descripció**n** |
| 530 | XXI BANORTE |  | 634 | PROFUTURO |
| 534 | PROFUTURO |  | 644 | SURA |
| 538 | PRINCIPAL |  | 652 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | SIEFORE Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 530 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | SIEFORE Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 564 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | SIEFORE Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | SIEFORE Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | SIEFORE Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | SIEFORE Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | SIEFORE Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | SIEFORE Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 002 | SIEFORE Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | SIEFORE Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | SIEFORE Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | SIEFORE Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | SIEFORE Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | SIEFORE Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | SIEFORE Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | SIEFORE Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | SIEFORE Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 017 | 652 | 001 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | SIEFORE Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | 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 deinformación) |
| 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 secompensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en todas las posicionesabiertas con la contraparte, para el cómputo de consumos de líneas operativas |
| 2 | Neteo por clase de activo de lacontraparte | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que secompensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en las posiciones cuyossubyacentes 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 lacontraparte | Se utilizará este indicador en caso de que el contrato ISDA estipule que secompensarán las pérdidas y ganancias que se tengan en las posiciones por cadatipo de derivado (Forward, Opciones, Swaps), para el cómputo de consumos delíneas operativas. |
| 4 | Neteo de posiciones porsubyacente. | 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) | Aa1.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | Aa2.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | Aa3.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A1.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A2.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A3.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | Baa1.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | Baa2.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | Baa3.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | Ba1.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |
| BB (mex) | Ba2.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | Ba3.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B1.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B2.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| B- (mex) | B3.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | Caa1.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | Caa2.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | Caa3.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | Ca.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) | MX-1 | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | MX-2 | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | MX-3 | 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) | MX-4 | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) |  | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
| **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** |
| 002001 | Banco de México |  | 080029 | Portfolio Investment Incorporated |
| 013001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 080030 | Arka International, Corp. |
| 013004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 080031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |
| 013005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 080032 | Banorte Asset Management,Inc. |
| 013006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 080033 | Afin International Holdings,Inc. |
| 013007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 080034 | Banorte I, LLC. |
| 013010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 080037 | Invex International, S.A. |
| 013011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 080038 | Invex Worldwide, S.A. |
| 013012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 080041 | Inbursa International, Inc. |
| 013013 | IXE Casa de Bolsa |  | 080042 | Inbursa Securities, Inc. |
| 013015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 080043 | IXE Holdings, Inc. |
| 013018 | Casa de Bolsa Arka |  | 082004 | Bancomer Oficina de Representación en LaHabana, Cuba. |
| 013019 | Value Casa de Bolsa |  | 082006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |
| 013020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 082008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013021 | Monex Casa de Bolsa |  | 082009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |
| 013026 | Vector Casa de Bolsa |  | 082010 | Banamex Oficina de Representación enDusseldorf, Alemania. |
| 013027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 082011 | Banamex Oficina de Representación enSingapur, Singapur. |
| 013032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 082012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |
| 013040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 082013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |
| 013041 | Invex Casa de Bolsa |  | 082014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |
| 013104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 082016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |
| 013105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 082025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona,E.U.A. |
| 013106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 082027 | Internacional Oficina de Representación enBuenos Aires, Argentina. |
| 013109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 082028 | Internacional Oficina de Representación enMadrid, España. |
| 013114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |
| 013117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 082031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |
| 013118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 082035 | Confia Oficina de Representación en NuevaYork, N.Y., E.U.A. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 013119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 082037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013120 | UBS Casa de Bolsa |  | 082039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 013122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 082043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |
| 013123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 082044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 013124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 082048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 013125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 013126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 082050 | Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra |
| 013127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 013129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 013130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701001 | Abasis |
| 013131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701002 | American Express (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 016031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 016035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A.(Extranjero) |
| 016040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 016041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 016044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |
| 016067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 016240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 016408 | B y B Casa de Cambio |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 016419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 016507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 016533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 016587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701014 | Cargill Financial Service International(Extranjero) |
| 016629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 016712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 016714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 016715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 016717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 016718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 016719 | Unica Casa de Cambio |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 025001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 025002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito deValores |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 025007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 025013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 025014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 037006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 037009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 037019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y laArmada |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England |
| 037135 | Nacional Financiera |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 037166 | Banco del Ahorro Nacional y ServiciosFinancieros |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |
| 037168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 040002 | Banco Nacional de México |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 040012 | BBVA Bancomer |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 040014 | Banco Santander |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 040017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest)(Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 040021 | HSBC México |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 040022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 040030 | Banco del Bajío |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 040032 | Ixe Banco |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 040036 | Banco Inbursa |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |
| 040037 | Banco Interacciones |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 040042 | Banca Mifel |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 040044 | Scotiabank Inverlat |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 040058 | Banco Regional de Monterrey |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank)(Extranjero) |
| 040059 | Banco Invex |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 040060 | Bansi |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 040062 | Banca Afirme |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale(Extranjero) |
| 040072 | Banco Mercantil del Norte |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 040102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |
| 040103 | American Express Bank (México) |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 040106 | Bank of America México |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 040108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |
| 040110 | Banco J.P. Morgan |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 040112 | Banco Monex |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 040113 | Banco Ve por Más |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 040116 | ING Bank (México) |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |
| 040124 | Deutsche Bank México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 040126 | Banco Credit Suisse México |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones(Bladex) (Extranjero) |
| 040127 | Banco Azteca |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 040128 | Banco Autofin México |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 040129 | Barclays Bank México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 040130 | Banco Compartamos |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 040131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 040132 | Banco Multiva |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 040133 | Banco Actinver |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 040134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 040136 | Banco Regional |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 040137 | BanCoppel |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 040138 | Banco Amigo |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 040139 | UBS Bank México |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 040140 | Banco Fácil |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 040141 | Volkswagen Bank |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 040142 | El Banco Deuno |  | 801160 | Acciones Propias |
| 040143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 040144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801162 | Bank West |
| 040145 | Banco Base |  | 801163 | Bcpbank Canada |
| 046048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801164 | Bridgewater Bank |
| 047005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 076000 | Otros Operadores |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 076001 | Derfin |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 076008 | Stock & Price |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 076010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 076014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAADerivados |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 076018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 076022 | Darka |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 076029 | Grupo Especializado en Futuros y OtrosDerivados |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 076043 | Timber Hill LLC. |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 076044 | Enlace Derivados |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 076048 | Intercam Derivados |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |
| 079001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 079003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California,E.U.A. |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 079004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware,E.U.A. |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 079005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 079006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |
| 079009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |
| 079010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801183 | Regions Bank |
| 079012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.-República de Irlanda |  | 801184 | National City Bank |
| 079013 | Banamex-Accival International Fund Plc.-República de Irlanda |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 079014 | Serfin International Bank and Trust - IslasCaimán |  | 801186 | State Street B&TC |
| 079015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A. |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 079016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 079017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 079018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 079022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801191 | North Fork Bank |
| 079023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 079024 | CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán. |  | 801193 | Bank Of The West |
| 079025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa HoldingsCorp. |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 079026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 801195 | Northern TC |
| 079027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 079028 | BBVA Bancomer USA |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 079029 | Dinero Express |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 079030 | Banorte USA Corporation |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 079031 | INB Financial Corp. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 079032 | INB Delaware Corporation |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 079033 | Inter Nacional Bank |  | 801202 | Santander USA |
| 080000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 801203 | CME Clearing |
| 080001 | Acci Securities Incorporated |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 080004 | Afin Securities International Limited |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 080005 | Arka Securities Incorporated |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 080008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 080009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 080013 | Vectormex Incorporated |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 080014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900000 | Otros mandatarios |
| 080015 | Vectormex International Incorporated |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 080019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 080020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 080021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900004 | Pioneer Investment Management Ltd. |
| 080022 | Valores Finamex Limited |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc. |
| 080023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900006 | Pioneer Investments Global Asset Management |
| 080024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 080025 | Monex Securities Incorporated |  | 900008 | Investec Asset Management |
| 080026 | Invex Incorporated |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 080027 | GBM International Incorporated |  | 920000 | Otros Socios Operadores |
| 080028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
|  |  |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **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; 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.

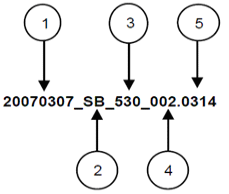
V.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 cuáles 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 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicarápara 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 dos, 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\_002.0314.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\_002.0314**

**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 78**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **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. | | | |
| **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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1159627.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1163164.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante"0300".** 1 |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1164899.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta lainformación, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1166634.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1168369.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos.1 |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1170104.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de la operación que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 311 | 0 | 33 | 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1175354.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1177103.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios.12 |
| 3 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1178956.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios.13 |
| 4 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1180809.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios.14 |
| 5 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1182628.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. 5 |
| 6 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1184447.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1186266.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 devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de Indeval.15 |
| 8 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1188085.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios 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 fechade 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 elpremio 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 garantíapactada 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 paradeterminar 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 deDivisas.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 deContrapartes. 1 |
| 24 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 202 | 221 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartelimitado a 20 caracteres siempre y cuando no existaidentificador para la contraparte en el catálogo deContrapartes  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |
| 25 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 222 | 224 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte paraoperaciones 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 lacalificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte paraoperaciones de Reporto segunda" de acuerdo alcatálogo 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 dereporto definido por la Siefore, el cual está asociado alfolio 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1213785.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "302".**1 |
| 2 | Número consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1215534.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 Catálogode 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 cualquierdivisa se debe considerar los montos en AIMS yexcedentes y se debe reportar también el efectivo enpesos,  13 para Posición de salida en Efectivo denominada encualquier 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 dedivisas.  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 Catálogode Tipo de Liquidación. En caso de ser InversionesTercerizadas se deberá anotar 01. 1 |
| 5 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 11 | 12 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo deTipo de Instrumento. 1 |
| 6 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1220376.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1222195.png | AN | 9 | 0 | 25 | 33 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0.13 |
| 8 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1224014.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 deberáanotar un 0. 14 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 9 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1225833.png | AN | 4 | 0 | 41 | 44 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso deEfectivo en pesos se deberá anotar EF. 5 |
| 10 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1227652.png | AN | 7 | 0 | 45 | 51 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIVO. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 11 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1229471.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 seincrementará para cada contrato con un mismomandatario. Para el caso de Efectivo en pesos sedeberá anotar 990101.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de Indeval. 15 |
| 12 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1231290.png | AN | 10 | 0 | 59 | 68 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios al activo. Para el caso de InversionesTercerizadas 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 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 (PrecioLimpio). En caso de ser operaciones en efectivo seanotará el tipo de cambio pactado. En caso de serInversiones 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 operadosincluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación).  En caso de que la posición no cuente con interesesdevengados se deberá reportar el mismo monto que elcampo "Costo unitario".  En caso de ser operaciones en efectivo o inversionesTercerizadas 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 materiafinanciera 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. Encaso de ser operaciones en efectivo o InversionesTercerizadas 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 paraoperaciones en Divisas distintas al peso mexicano. Encaso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenarcon ceros. 2 |
| 22 | País de adquisición |  | N | 2 | 0 | 164 | 165 | Se deberá anotar el identificador del país donde seadquirió el activo conforme al Catálogo de Países. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 23 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 166 | 171 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo deContrapartes.  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 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 elidentificador "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 contrapartelimitado a 20 caracteres siempre y cuando no existaidentificador para la contraparte en el catálogo deContrapartes.  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 lasoperaciones de acciones propias, amortizaciones yvencimientos 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 laoperación:  0 = No aplica  1 = Telefónico  2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse elSistema de concertación y el tipo de postura en laoperación. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 28 | Sistema de concertación |  | N | 2 | 0 | 198 | 199 | En el caso de que el medio de concertación seaelectrónico 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 deobservaciones el sistema de concertación usado.  0 No aplica  1 MEI  2 SIPO  3 VAR  4 MEIPresval  5 Corros Monex  99 OTRO. 1 |
| 29 | Tipo de postura |  | N | 1 | 0 | 200 | 200 | Se deberá anotar el tipo de postura de la operación decompra 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 deClase de la Inversión Tercerizada, en caso contrariollenar 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 mercadoprimario 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1256005.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "303"** 1**.** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Tipo de Inversión | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1257754.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogode Tipo de Inversión únicamente:  0 para Directo,  1 para Reporto,  6 para Préstamo de Valores,  7 para Garantías entregadas por operaciones conInstrumentos 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 coninstrumentos estructurados. 1 |
| 3 | Tipo de Instrumento |  | N | 2 | 0 | 6 | 7 | Se deberá anotar el identificador según el Catálogo deTipo de Instrumento1. |
| 4 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1260626.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 deberáanotar un 0. 1² |
| 5 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1262445.png | AN | 9 | 0 | 20 | 28 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios.  En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberáanotar un 0.13 |
| 6 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1264264.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 deberáanotar un 0. 14 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1266083.png | AN | 4 | 0 | 36 | 39 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas se deberá anotar MDT. 5 |
| 8 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1267818.png | AN | 7 | 0 | 40 | 46 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. En caso de ser InversionesTercerizadas deberá ser definido por la Siefore paracada mandatario. 5 |
| 9 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1269637.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 seincrementará para cada contrato con un mismomandatario.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de Indeval. 15 |
| 10 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1271456.png | AN | 10 | 0 | 54 | 63 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios al activo. Para el caso de InversionesTercerizadas 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 lacartera (en unidades). Para el caso de ETF's será elnúmero de unidades de creación. En caso de serInversiones 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 deberállenar 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 materiafinanciera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general queestablecen el régimen de inversión al que deberánsujetarse 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 demercado 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 elvalor 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 InversionesTercerizadas 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 delreporte 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 seemitió 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisiónprimera" 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 quecorresponde al instrumento conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lacalificación mínima crediticia de acuerdo a lasdisposiciones de carácter general que establecen elrégimen de inversión. En otro caso se deberá anotar00001. |
| 21 | Calificadora Emisión segunda |  | N | 3 | 0 | 169 | 171 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisiónsegunda" 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 quecorresponde al instrumento conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lasegunda 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisoraprimera" 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 quecorresponde al emisor conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lacalificación mínima crediticia de acuerdo a lasdisposiciones de carácter general que establecen elrégimen 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisorasegunda" 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 quecorresponde al emisor conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lasegunda 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 omodificación accionaría decretado según el Catálogo de Tipo de Derechos. Solamente en el caso de acciones, vehículos, Fibras o CKD, de lo contrario llenar con ceros. 1 |
| 28 | Fecha en que se decreta elderecho o modificaciónaccionaría |  | 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 modificaciónaccionaría |  | N | 6 | 6 | 200 | 211 | En caso de reportarse algún Tipo de derecho omodificación 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 elderecho 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 sedeberá anotar el monto decretado de pago por unidadaccionaria 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 InversionesTercerizadas 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 oInversiones 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 delinstrumento en tenencia. En caso de ser InversionesTercerizadas 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 losinstrumentos 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 deClase de la Inversión Tercerizada. 1 |
| 38 | Aviso de Recomposición |  | N | 1 | 0 | 314 | 314 | Se deberá anotar el identificador con forme al catálogode Aviso de Recomposición. 1 |
| 39 | Índice de Mandato |  | N | 3 | 8 | 315 | 325 | Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberáreportar 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1305036.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 Administradopor una Sociedad de Inversión y de los ActivosAdministrados 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 deInversión de la Sociedad de Inversión directamentegestionado en materia de inversiones por ésta, deberáestar 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 deInversión 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1315086.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "305".** 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Tipo de Inversión | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1316835.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogode 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 deTipo de Instrumento. 1 |
| 4 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1319707.png | AN | 12 | 0 | 8 | 19 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 5 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1321526.png | AN | 9 | 0 | 20 | 28 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 6 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1323345.png | AN | 7 | 0 | 29 | 35 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 7 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1325164.png | AN | 4 | 0 | 36 | 39 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. 5 |
| 8 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1326983.png | AN | 7 | 0 | 40 | 46 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. 5 |
| 9 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1328802.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 devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de Indeval.15 |
| 10 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1330621.png | AN | 10 | 0 | 54 | 63 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios al activo. 15 |
| 11 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 64 | 75 | Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (enunidades). 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 demercado 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 elvalor 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 delreporte, 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 seemitió el activo conforme al Catálogo de Países. 1 |
| 19 | Calificadora Emisión primera |  | N | 3 | 0 | 162 | 164 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisiónprimera" 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 quecorresponde al papel o instrumento conforme alCatálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberáser la calificación mínima crediticia de acuerdo a lasdisposiciones de carácter general que establecen elrégimen de inversión. 1 |
| 21 | Calificadora Emisión segunda |  | N | 3 | 0 | 169 | 171 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisiónsegunda" 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 quecorresponde al papel o instrumento conforme alCatálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberáser 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisoraprimera" 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 quecorresponde al emisor conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lacalificación mínima crediticia de acuerdo a lasdisposiciones de carácter general que establecen elrégimen de inversión. 1 |
| 25 | Calificadora Emisora segunda |  | N | 3 | 0 | 183 | 185 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Emisorasegunda" 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 quecorresponde al emisor conforme al Catálogo deCalificaciones Homologadas. Esta deberá ser lacalificación mínima crediticia de acuerdo a lasdisposiciones de carácter general que establecen elrégimen de inversión. 1 |
| 27 | Contraparte |  | N | 6 | 0 | 190 | 195 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo deContrapartes1. |
| 28 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 196 | 215 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartelimitado a 20 caracteres siempre y cuando no existaidentificador 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Contraparteprimera" 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación mínimacrediticia de acuerdo a las disposiciones de caráctergeneral que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 31 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 223 | 225 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Contrapartesegunda" 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la segunda calificaciónmínima crediticia de acuerdo a las disposiciones decarácter 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 dereporto 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 devalores 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1358375.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "306".** 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1360124.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1361977.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1363830.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1365649.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo. 5 |
| 6 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1367468.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1369287.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 devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de Indeval. 15 |
| 8 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1371106.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios 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 Préstamode 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 fechadel reporte. 2 |
| 17 | Tipo de garantía pactada |  | N | 2 | 0 | 153 | 154 | Se deberá anotar el identificador del tipo de garantíasegún 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 deContrapartes. 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Contraparteprimera" 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 lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación Homologada de la Contrapartesegunda" 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 depréstamo 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** | **D** **a** **t** **o** | **T** **i** **p** **o** | **Longitud** | | **Posici** **ón** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **D** **e** **:** | **A** **:** |
| 1 | Tipo de registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1394891.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "307".**1 |
| 2 | Tipo de inversión | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1396699.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogode Tipo de Inversión. 1 |
| 3 | Tipo de valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1398507.png | AN | 4 | 0 | 6 | 9 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberáanotar MDT.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en elmercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el tipo de valorasignado por el proveedor a la divisa del flujo, o EF si se encuentra denominado en pesos. 5 |
| 4 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1400315.png | AN | 7 | 0 | 1 0 | 1 6 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.  En caso de ser Inversiones tercerizadas deberá serdefinido por la SIEFORE para cada mandatario.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en elmercado 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 |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 5 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1402123.png | AN | 7 | 0 | 1 7 | 2 3 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujoreportado.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval.  En caso de ser Inversiones tercerizadas será unconsecutivo definido por la SIEFORE el cual seincrementará para cada contrato con un mismomandatario.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en elmercado 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 |
| 6 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1403931.png | AN | 10 | 0 | 2 4 | 3 3 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo del Activo Objeto de Inversión del queproviene el flujo. Para el caso de Inversionestercerizadas se deberá anotar el identificador según elcatálogo de Clase de la Inversión tercerizada. 15 |
| 7 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1405745.png | AN | 12 | 0 | 3 4 | 4 5 | 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 deberáanotar un 0. 12 |
| 8 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1407559.png | AN | 9 | 0 | 4 6 | 5 4 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios al ActivoObjeto de Inversión del que proviene el flujo.  En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberáanotar un 0. 13 |
| 9 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1409367.png | AN | 7 | 0 | 5 5 | 6 1 | 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 deberáanotar un 0. 14 |
| 10 | Tipo de flujo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1411175.png | N | 2 | 0 | 6 2 | 6 3 | 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 |
| 11 | Descriptivo de tipo de flujo |  | AN | 30 | 0 | 6 4 | 9 3 | 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 |
| 12 | Contraparte flujo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1413957.png | N | 6 | 0 | 9 4 | 9 9 | Se deberá anotar el identificador de la Contraparteliquidadora de conformidad con el Catálogo deContrapartes. 1 |
| 13 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 1 0 0 | 1 1 9 | Se deberá anotar el nombre corto de la contraparteliquidadora limitado a 20 caracteres cuando no existaidentificador para la contraparte en el catálogo deContrapartes.  En otro caso se deberá reportar vacío. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 14 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 1 2 0 | 1 2 7 | Se deberá reportar la fecha de liquidación del flujo. 3 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Títulos o unidades |  | N | 12 | 0 | 1 2 8 | 1 3 9 | Se deberá reportar el número de títulos o unidades delActivo Objeto de Inversión de los cuales se deriva el flujo reportado.  Para el caso de swaps se deberá reportar el montonocional utilizado para valuar la posición con el preciootorgado por el proveedor de precios. Para el caso deoperaciones con derivados se deberá reportar elproducto de número de contratos por tamaño decontratos.  Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en elmercado 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 |
| 16 | Divisa | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1418687.png | N | 2 | 0 | 1 4 0 | 1 4 1 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la quese encuentra denominado el flujo reportado. 1 |
| 17 | Divisa de liquidación |  | N | 2 | 0 | 1 4 2 | 1 4 3 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la quese liquidará el flujo reportado. 1 |
| 18 | Tipo de cambio aplicado |  | N | 9 | 6 | 1 4 4 | 1 5 8 | 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 |
| 19 | Dirección del flujo |  | N | 1 | 0 | 1 5 9 | 1 5 9 | 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 |
| 20 | Monto de flujo en Divisa |  | N | 14 | 2 | 1 6 0 | 1 7 5 | Monto total del flujo expresado en la divisa en la que se encuentra denominado. 2 |
| 21 | Monto de flujo en pesos mexicanos |  | N | 14 | 2 | 1 7 6 | 1 9 1 | Monto total del flujo expresado en pesos mexicanos. 6 |
| 22 | Espacios en blanco |  | AN | 152 | 0 | 1 9 2 | 3 4 3 | 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1428788.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "308".**1 |
| 2 | Contraparte | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1430537.png | N | 6 | 0 | 4 | 9 | Identificador de la Contraparte según el Catálogo deContrapartes.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMSexcedentes) se deberá reportar el identificador del Socio Liquidador.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) sedeberá reportar el identificador de la Cámara decompensación. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 3 | Nombre corto de la contraparte |  | AN | 20 | 0 | 10 | 29 | Se deberá anotar el nombre corto de la contrapartelimitado a 20 caracteres siempre y cuando no existaidentificador para la contraparte en el catálogo.  En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMSexcedentes) y no exista identificador para el SocioLiquidador 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1433291.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 pesosmexicanos del depósito o en su caso aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados. 2 |
| 7 | Tipo de Depósito | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1437072.png | N | 1 | 0 | 60 | 60 | Se deberá anotar el tipo de depósito según el catálogode tipo de depósito. 1 |
| 8 | Calificadora Contraparte primera |  | N | 3 | 0 | 61 | 63 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación de la Contraparte primera" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la calificación mínimacrediticia de acuerdo a las disposiciones de caráctergeneral que establecen el régimen de inversión. 1 |
| 10 | Calificadora Contraparte segunda |  | N | 3 | 0 | 68 | 70 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacalificadora que emite la calificación reportada en elconcepto "Calificación de la Contraparte segunda" deacuerdo 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 CalificacionesHomologadas. Esta deberá ser la segunda calificaciónmínima crediticia de acuerdo a las disposiciones decarácter 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1446265.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "309".**1 |
| 2 | Divisa del Flujo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1448014.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se reportará el identificador de la divisa en la que seliquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo deDivisas". 1 |
| 3 | Tipo de Operación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1449867.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 netostotales, 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 esténpendientes por liquidar en la divisa reportada en elconcepto 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1457124.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "310".**1 |
| 2 | Identificador Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1458873.png | AN | 4 | 0 | 4 | 7 | Se indicará el valor constante MDT. 5 |
| 3 | Identificador Mandatario | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1460726.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1462537.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 envalores 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 enmercancías. 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 endivisas. 1 |
| 13 | Límite establecido para Medida de Control de Riesgo |  | N | 3 | 8 | 150 | 160 | Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecidopor la Siefore correspondiente al límite de medida decontrol 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 mandatocorrespondiente 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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | 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 operacionescon IFD |  | 4 | 72 | 72 Hrs. |
| 8 | Gr | Garantías recibidas por operaciones deReporto |  | 5 | 96 | 96 Hrs. |
| 10 | Gp | Garantías recibidas por Préstamo deValores |  | 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 encualquier divisa |  | 8 | 168 | 168 Hrs. |
| 13 | Ec | Posición de salida en Efectivodenominada en cualquier divisa. |  | 9 | 192 | 192 Hrs. |
| 14 | It | Inversiones tercerizadas |  |  |  |  |
| 15 | Ge | Garantías entregadas por instrumentosEstructurados |  |  |  |  |
| 16 | Oc | Operaciones Cambiarias de compra oventa de divisas. |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **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 AIMSexcedentes |
| 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 |
| 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 PrincipalProtegido a Vencimiento |
| 11 | GBP | Libra Esterlina |  | 9 | TRK | Instrumentos conocidos comoTrackers |
| 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 |  |  |  |  |

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

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 23 | Chipre |  | 46 | Singapur |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |  |  |  |
| 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 CKD's 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) | Aa1.mx | mxAA+ | HR AA+ | AA+/M | AA.MX(alto) | 1001 |
| AA (mex) | Aa2.mx | mxAA | HR AA | AA/M | AA.MX | 1002 |
| AA- (mex) | Aa3.mx | mxAA- | HR AA- | AA-/M | AA.MX(bajo) | 1003 |
| A+ (mex) | A1.mx | mxA+ | HR A+ | A+/M | A.MX(alto) | 1004 |
| A (mex) | A2.mx | mxA | HR A | A/M | A.MX | 1005 |
| A- (mex) | A3.mx | mxA- | HR A- | A-/M | A.MX(bajo) | 1006 |
| BBB+ (mex) | Baa1.mx | mxBBB+ | HR BBB+ | BBB+/M | BBB.MX(alto) | 1007 |
| BBB (mex) | Baa2.mx | mxBBB | HR BBB | BBB/M | BBB.MX | 1008 |
| BBB- (mex) | Baa3.mx | mxBBB- | HR BBB- | BBB-/M | BBB.MX(bajo) | 1009 |
| BB+ (mex) | Ba1.mx | mxBB+ | HR BB+ | BB+/M | BB.MX(alto) | 1010 |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| BB (mex) | Ba2.mx | mxBB | HR BB | BB/M | BB.MX | 1011 |
| BB- (mex) | Ba3.mx | mxBB- | HR BB- | BB-/M | BB.MX(bajo) | 1012 |
| B+ (mex) | B1.mx | mxB+ | HR B+ | B+/M | B.MX(alto) | 1013 |
| B (mex) | B2.mx | mxB | HR B | B/M | B.MX | 1014 |
| B- (mex) | B3.mx | mxB- | HR B- | B-/M | B.MX(bajo) | 1015 |
| CCC+ (mex) | Caa1.mx | mxCCC+ | HR C+ |  | CCC.MX(alto) | 1016 |
| CCC (mex) | Caa2.mx | mxCCC |  |  | CCC.MX | 1017 |
| CCC- (mex) | Caa3.mx | mxCCC- |  |  | CCC.MX(bajo) | 1018 |
| CC (mex) | Ca.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) | MX-1 | mxA-1+ | HR+1 | 1+/M | R-1.MX(alto) | 1022 |
| F1 (mex) | MX-2 | mxA-1 | HR1 | 1/M | R-1.MX(medio) | 1023 |
| F2 (mex) | MX-3 | 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) | MX-4 | mxB | HR4 | 4/M | R-4.MX - R-5.MX | 1026 |
| C (mex) |  | mxC | HR5 | D/M | D.MX | 1027 |
| **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** |
| 002001 | Banco de México |  | 080029 | Portfolio Investment Incorporated |
| 013001 | Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa |  | 080030 | Arka International, Corp. |
| 013004 | Casa de Bolsa Santander Serfín |  | 080031 | BBVA Bancomer Asset Management,Inc. |
| 013005 | Scotia Inverlat, Casa de Bolsa |  | 080032 | Banorte Asset Management,Inc. |
| 013006 | HSBC Casa de Bolsa |  | 080033 | Afin International Holdings,Inc. |
| 013007 | GBM Grupo Bursátil Mexicano |  | 080034 | Banorte I, LLC. |
| 013010 | Casa de Bolsa BBVA-Bancomer |  | 080037 | Invex International, S.A. |
| 013011 | Multivalores Casa de Bolsa |  | 080038 | Invex Worldwide, S.A. |
| 013012 | Finamex Casa de Bolsa |  | 080041 | Inbursa International, Inc. |
| 013013 | IXE Casa de Bolsa |  | 080042 | Inbursa Securities, Inc. |
| 013015 | Interacciones Casa de Bolsa |  | 080043 | IXE Holdings, Inc. |
| 013018 | Casa de Bolsa Arka |  | 082004 | Bancomer Oficina de Representación en LaHabana, Cuba. |
| 013019 | Value Casa de Bolsa |  | 082006 | Bancomer Sucursal en Islas Caimán. |
| 013020 | Actinver Casa de Bolsa |  | 082008 | Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013021 | Monex Casa de Bolsa |  | 082009 | Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A. |
| 013026 | Vector Casa de Bolsa |  | 082010 | Banamex Oficina de Representación enDusseldorf, Alemania. |
| 013027 | Casa de Bolsa Banorte |  | 082011 | Banamex Oficina de Representación enSingapur, Singapur. |
| 013032 | Valores Mexicanos Casa de Bolsa |  | 082012 | Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina. |
| 013040 | Inversora Bursátil Casa de Bolsa |  | 082013 | Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia. |
| 013041 | Invex Casa de Bolsa |  | 082014 | Banamex Oficina de Representación en Taipei |
| 013104 | ING Baring (México) Casa de Bolsa |  | 082016 | Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas. |
| 013105 | Merrill Lynch México Casa de Bolsa |  | 082025 | Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A. |
| 013106 | Deustche Securities Casa de Bolsa |  | 082027 | Internacional Oficina de Representación enBuenos Aires, Argentina. |
| 013109 | J.P. Morgan Casa de Bolsa |  | 082028 | Internacional Oficina de Representación enMadrid, España. |
| 013114 | Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082030 | Internacional Sucursal en Islas Caimán |
| 013117 | ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa |  | 082031 | Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 013118 | Casa de Bolsa Credit Suisse México |  | 082035 | Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013119 | Bank of America Securities, Casa de Bolsa |  | 082037 | Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013120 | UBS Casa de Bolsa |  | 082039 | Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A. |
| 013121 | Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082042 | Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York |
| 013122 | Base Internacional Casa de Bolsa |  | 082043 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 013123 | Barclays Capital Casa de Bolsa |  | 082044 | Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra. |
| 013124 | Intercam Casa de Bolsa |  | 082048 | Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán |
| 013125 | CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 082049 | Bancomer Sucursal en Houston |
| 013126 | BullTick Casa de Bolsa |  | 082050 | Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra |
| 013127 | Masari Casa de Bolsa, S.A. |  | 700000 | Otros Bancos Extranjeros |
| 013129 | Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701000 | ABN Amro Bank (Extranjero) |
| 013130 | Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701001 | Abasis |
| 013131 | BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V. |  | 701002 | American Express (Extranjero) |
| 016031 | Monex Divisas, S.A. de C.V. |  | 701003 | Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero) |
| 016035 | Central de Divisas Casa de Cambio |  | 701004 | Banco Santander Central Hispano, S. A.(Extranjero) |
| 016040 | Consultoría Internacional Casa de Cambio |  | 701005 | Bank Of America (Extranjero) |
| 016041 | Casa de Cambio Tiber |  | 701006 | Bank Boston Na (Extranjero) |
| 016044 | Eurofimex, Casa de Cambio |  | 701007 | Bank Of Montreal (Extranjero) |
| 016067 | Masari, Casa de Cambio |  | 701008 | Bank Of New York (Extranjero) |
| 016240 | Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio |  | 701009 | The Bank Of Nova Scotia (Extranjero) |
| 016408 | B y B Casa de Cambio |  | 701010 | Bank One (Extranjero) |
| 016419 | Finamex Casa de Cambio |  | 701011 | BNP Paribas (Extranjero) |
| 016507 | Casa de Cambio Tamibe |  | 701012 | Barclays Bank (Extranjero) |
| 016533 | Casa de Cambio Majapara |  | 701013 | Bear Stearns (Extranjero) |
| 016587 | Sterling Casa de Cambio |  | 701014 | Cargill Financial Service International (Extranjero) |
| 016629 | Money Tron Casa de Cambio |  | 701015 | Chase Manhattan Bank (Extranjero) |
| 016712 | Intercam Casa de Cambio |  | 701016 | Citi National Bank (Extranjero) |
| 016714 | Order Express Casa de Cambio |  | 701017 | Citibank (Extranjero) |
| 016715 | Prodira, Casa de Cambio |  | 701018 | Comerica Bank (Extranjero) |
| 016717 | Imperial Casa de Cambio |  | 701019 | Commerzbank (Extranjero) |
| 016718 | Divisas San Jorge Casa de Cambio |  | 701020 | Controladora Prosa |
| 016719 | Unica Casa de Cambio |  | 701021 | Credit Lyonnais (Extranjero) |
| 025001 | Bolsa Mexicana de Valores |  | 701022 | Credit Suisse (Extranjero) |
| 025002 | S.D. Indeval, Institución para el Depósito deValores |  | 701023 | Den Danske Bank (Extranjero) |
| 025007 | MexDer, Mercado Mexicano de Derivados |  | 701024 | Deutsche Bank (Extranjero) |
| 025013 | Contraparte Central de Valores de México |  | 701025 | Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero) |
| 025014 | Flujos por pago de cupón o dividendo |  | 701026 | Fortis Bank (Extranjero) |
| 037006 | Banco Nacional de Comercio Exterior |  | 701027 | Goldman Sachs and Co. (Extranjero) |
| 037009 | Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos |  | 701028 | Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero) |
| 037019 | Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y laArmada |  | 701029 | HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England |
| 037135 | Nacional Financiera |  | 701030 | Indosuez International (Extranjero) |
| 037166 | Banco del Ahorro Nacional y ServiciosFinancieros |  | 701031 | ING Bank (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 037168 | Sociedad Hipotecaria Federal |  | 701032 | J.P. Morgan (Extranjero) |
| 040002 | Banco Nacional de México |  | 701033 | Lehman Brothers (Extranjero) |
| 040012 | BBVA Bancomer |  | 701034 | Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero) |
| 040014 | Banco Santander |  | 701035 | Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero) |
| 040017 | BBVA Bancomer Servicios |  | 701037 | National Westminster Bank (Natwest)(Extranjero) |
| 040021 | HSBC México |  | 701038 | Republic National Bank (Extranjero) |
| 040022 | GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero |  | 701039 | Royal Bank Of Canada (Extranjero) |
| 040030 | Banco del Bajío |  | 701040 | Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero) |
| 040032 | Ixe Banco |  | 701041 | Societe Generale (Extranjero) |
| 040036 | Banco Inbursa |  | 701042 | Solomon Brothers (Extranjero) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 040037 | Banco Interacciones |  | 701043 | Standard Bank London (Extranjero) |
| 040042 | Banca Mifel |  | 701044 | Standard Chartered Bank (Extranjero) |
| 040044 | Scotiabank Inverlat |  | 701045 | Swiss Bank Volksbank (Extranjero) |
| 040058 | Banco Regional de Monterrey |  | 701046 | The Toronto Dominion Bank (TD Bank)(Extranjero) |
| 040059 | Banco Invex |  | 701047 | UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero) |
| 040060 | Bansi |  | 701048 | Union Bank (Extranjero) |
| 040062 | Banca Afirme |  | 701049 | Westdeutsche Landezbank Girozentrale(Extranjero) |
| 040072 | Banco Mercantil del Norte |  | 701050 | William Financial Services Limited (Extranjero) |
| 040102 | The Royal Bank of Scotland México |  | 701051 | CME (Chicago Mercantile Exchange) |
| 040103 | American Express Bank (México) |  | 701052 | LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange) |
| 040106 | Bank of America México |  | 701053 | NYSE (New York Stock Exchange) |
| 040108 | Bank of Tokyo-Mitsubishi (México) |  | 701054 | Simex (Singapur Stock Exchange) |
| 040110 | Banco J.P. Morgan |  | 701059 | Chicago Board Options Exchange - Chicago |
| 040112 | Banco Monex |  | 701060 | Mid America Commodity Exchange - Chicago |
| 040113 | Banco Ve por Más |  | 701061 | Commodity Exchange Incorporated - New York |
| 040116 | ING Bank (México) |  | 701062 | Stanley Bank (Utah) (Extranjero) |
| 040124 | Deutsche Bank México |  | 701119 | Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero) |
| 040126 | Banco Credit Suisse México |  | 701121 | Banco Latinoamericano de Exportaciones(Bladex) (Extranjero) |
| 040127 | Banco Azteca |  | 701275 | Asigna, Compensación y Liquidación |
| 040128 | Banco Autofin México |  | 701276 | Chicago Board of Trade |
| 040129 | Barclays Bank México |  | 701277 | Credit Agricole Corp |
| 040130 | Banco Compartamos |  | 701278 | Credit Agricole Securities (USA), Inc |
| 040131 | Banco Ahorro Famsa |  | 801150 | Bank Morgan Stanley Ag |
| 040132 | Banco Multiva |  | 801151 | Smith Barney / Cgm Inc. |
| 040133 | Banco Actinver |  | 801152 | Citi Bank N.A. New York Officers |
| 040134 | Banco Wal-Mart de México Adelante |  | 801153 | Pershing Inc. |
| 040136 | Banco Regional |  | 801154 | Calyon Financial Inc. |
| 040137 | BanCoppel |  | 801155 | Morgan Stanley And Co. International Limited |
| 040138 | Banco Amigo |  | 801156 | Morgan Stanley And Co. Securities Limited |
| 040139 | UBS Bank México |  | 801157 | Segregación de Instrumentos |
| 040140 | Banco Fácil |  | 801158 | Segregación Inversa de Instrumentos |
| 040141 | Volkswagen Bank |  | 801159 | Reclasificaciones |
| 040142 | El Banco Deuno |  | 801160 | Acciones Propias |
| 040143 | CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple |  | 801161 | Cortes Transversales |
| 040144 | The Bank of New York Mellon (México) |  | 801162 | Bank West |
| 040145 | Banco Base |  | 801163 | Bcpbank Canada |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 046048 | Citibank (Banamex USA) |  | 801164 | Bridgewater Bank |
| 047005 | Morgan Stanley and Company Limited |  | 801165 | Canadian Imperial Bank Of Commerce |
| 076000 | Otros Operadores |  | 801166 | Canadian Tire Bank |
| 076001 | Derfin |  | 801167 | Canadian Western Bank |
| 076008 | Stock & Price |  | 801168 | Citizens Bank Of Canada |
| 076010 | Scotia Inverlat Derivados |  | 801169 | Cs Alterna Bank |
| 076014 | García Macías, Araneda y Asociados GAMAADerivados |  | 801170 | Dundee Bank Of Canada |
| 076018 | Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi) |  | 801171 | First Nations Bank Of Canada |
| 076022 | Darka |  | 801172 | General Bank Of Canada |
| 076029 | Grupo Especializado en Futuros y OtrosDerivados |  | 801173 | Laurentian Bank Of Canada |
| 076043 | Timber Hill LLC. |  | 801174 | Manulife Bank Of Canada |
| 076044 | Enlace Derivados |  | 801175 | National Bank Of Greece (Canada) |
| 076048 | Intercam Derivados |  | 801176 | Pacific & Western Bank Of Canada |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 079001 | Bancomer Holding-Islas Caimán |  | 801177 | Wachovia Bank N.A. |
| 079003 | Bancomer Transfer Services, Inc.-California,E.U.A. |  | 801178 | Wells Fargo Bank N.A. |
| 079004 | Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware,E.U.A. |  | 801179 | Us Bank N.A. |
| 079005 | Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo |  | 801180 | Suntrust Bank |
| 079006 | Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán |  | 801181 | Hsbc Bank Usa N.A. |
| 079009 | Banamex Holding Co.- California, E.U.A. |  | 801182 | Fia Card Svc N.A. |
| 079010 | California Commerce Bank-California, E.U.A. |  | 801183 | Regions Bank |
| 079012 | Banamex-Accival Asset Management Ltd.-República de Irlanda |  | 801184 | National City Bank |
| 079013 | Banamex-Accival International Fund Plc.-República de Irlanda |  | 801185 | Branch Bkg & TC |
| 079014 | Serfin International Bank and Trust - IslasCaimán |  | 801186 | State Street B&TC |
| 079015 | Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A. |  | 801187 | Countrywide Bank N.A. |
| 079016 | B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán |  | 801188 | Pnc Bank N.A. |
| 079017 | B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán |  | 801189 | Keybank N.A. |
| 079018 | B.I. Remitances Company.- Islas Caimán |  | 801190 | Lasalle Bank N.A. |
| 079022 | Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801191 | North Fork Bank |
| 079023 | Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware,E.U.A. |  | 801192 | Manufacturers & Traders Tc |
| 079024 | CMX International Bank and Trust.- IslasCaimán. |  | 801193 | Bank Of The West |
| 079025 | Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa HoldingsCorp. |  | 801194 | Fifth Third Bank |
| 079026 | Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp |  | 801195 | Northern TC |
| 079027 | BBVA Bancomer Financial Holdings Inc. |  | 801196 | Goldman Sachs París |
| 079028 | BBVA Bancomer USA |  | 801197 | Citigroup Global Markets, INC |
| 079029 | Dinero Express |  | 801198 | Jefferies Group, LLC |
| 079030 | Banorte USA Corporation |  | 801199 | UBS Securities, LLC |
| 079031 | INB Financial Corp. |  | 801200 | Evercore, LLC |
| 079032 | INB Delaware Corporation |  | 801201 | GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney) |
| 079033 | Inter Nacional Bank |  | 801202 | Santander USA |
| 080000 | Otras Casas de Bolsa Extranjeras |  | 801203 | CME Clearing |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 080001 | Acci Securities Incorporated |  | 801204 | Barclays Capital, Inc |
| 080004 | Afin Securities International Limited |  | 801205 | BCP Securities, LLC |
| 080005 | Arka Securities Incorporated |  | 801206 | BTG Pactual US Capital, LLC |
| 080008 | BBVA Bancomer Securities International Inc. |  | 801207 | Bulltick, LLC |
| 080009 | BBVA Bancomer Holdings Corporation |  | 801208 | Santander Investment Securities, Inc |
| 080013 | Vectormex Incorporated |  | 801209 | Scotia Capital, Inc |
| 080014 | Vectormex Global Advisors Incorporated |  | 900000 | Otros mandatarios |
| 080015 | Vectormex International Incorporated |  | 900001 | Schroders Plc. |
| 080019 | Valores Finamex Corporation, Inc. |  | 900002 | Blackrock Inc. |
| 080020 | Valores Finamex International Incorporated |  | 900003 | Franklin Templeton Investment Management Ltd. |
| 080021 | Finamex Securities Incorporated |  | 900004 | Pioneer Investment Management Ltd. |
| 080022 | Valores Finamex Limited |  | 900005 | Nomura Holdings, Inc. |
| 080023 | Interacciones Global Incorporated |  | 900006 | Pioneer Investments Global Asset Management |
| 080024 | Inter-Financial Services, Limited |  | 900007 | Wellington Management Company LLP |
| 080025 | Monex Securities Incorporated |  | 900008 | Investec Asset Management |
| 080026 | Invex Incorporated |  | 910000 | Otras Bolsas de Derivados |
| 080027 | GBM International Incorporated |  | 920000 | Otros Socios Operadores |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 080028 | Foreign Holdings Ltd. |  | 930000 | Otros Socios Liquidadores |
|  |  |  | 940000 | Otras Cámaras de Compensación |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 seiscaracteres 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

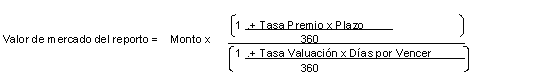
El primer bloque de 8 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

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; 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.

11 El 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.

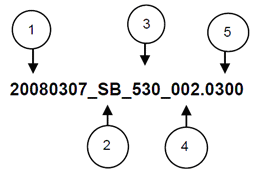
VII.   El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizan-do el programa GNUpg.

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 cuáles 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 | 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 tieneestipulado 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 dos, 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\_002.0300.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\_002.0300**

**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 79**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada.-** Este archivo contiene Información del desglose de operaciones con estructuras vinculadas a subyacentes, así como la réplica de índices internacionales. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO. | 212 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1721273.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "000"** 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1723008.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante "0317".**1 |
| 3 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1724743.png | N | 3 | 0 | 8 | 10 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. 1 |
| 4 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1726478.png | N | 3 | 0 | 11 | 13 | Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. 1 |
| 5 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1728213.png | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. 1 |
| 6 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1729948.png | F | 8 | 0 | 17 | 24 | Fecha de la Operación que se reporta.3 |
| 7 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 25 | 27 | Número de caracteres por registro = Constante "**212**".1 |
| 8 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 28 | 32 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. 1 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 180 | 0 | 33 | 212 | Vacíos. 6 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **SUBENCABEZADO 1:** CONTIENE LA INFORMACION DE LAS ESTRUCTURAS VINCULADAS A SUBYACENTES E ÍNDICES REPLICADOS | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1737000.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "101".** 1 |
| 2 | ID | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1738749.png | AN | 8 | 0 | 4 | 11 | Identificador consecutivo Interno para cada estructuravinculada a subyacentes o Índice replicado reportado en el presente formato. Este identificador será determinado por la Administradora. 19 |
| 3 | Estatus de la operación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1740602.png | N | 1 | 0 | 12 | 12 | Se deberá anotar el identificador correspondiente alestatus de la operación según el catálogo de Estatus de Registro, en donde se anotará 1 para el día de apertura de la estructura vinculada a subyacenteso réplica del índice, y mientras se realiza la compra/venta de acciones o vehículos que conforman un componente de la estructura vinculada a subyacentes o réplica del Índice, con el propósito de que dicho componente cumpla con la desviación permitida.  Se deberá reportar 4 una vez que se ha concluido laapertura de la estructura vinculada a subyacentes oréplica del Índice. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 4 | Fecha de inicio de la Operación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1742455.png | F | 8 | 0 | 13 | 20 | Se deberá anotar la fecha de inicio de la operación de la estructura vinculada a subyacentes o réplica del índice.3 |
| 5 | Cantidad de Instrumentos. |  | N | 2 | 0 | 21 | 22 | Se deberá anotar el número de los distintos ActivosObjeto de Inversión que componen la estructuravinculada a subyacentes o réplica del Índice y que seencuentran registrados en los Detalles 2 a 6 del presente Subencabezado. 1 |
| 6 | Tipo de Estructuración |  | N | 1 | 0 | 23 | 23 | Se anotará el identificador según el catálogo de Tipo de Estructura, donde se anotará 1 si la estructura vinculada a subyacentes fue adquirida en Directo en el Mercado por la Siefore, o 2 si la Nota está estructurada por la Siefore mediante la administración de sus componentes. 6 Para el caso de la réplica de índices que sean replicados siempre utilizará el 2. |
| 7 | Descripción |  | AN | 100 | 0 | 24 | 123 | Se deberá anotar una breve descripción del tipo deestructura vinculada a subyacentes o réplica que se esté realizando. |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 89 | 0 | 124 | 212 | Vacíos. 6 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** CONTIENE LA INFORMACION DE LAS estructuras vinculadas a subyacentes EN CASO DE SER NOTAS ADQUIRIDAS EN DIRECTO POR LA SIEFORE. (Para reportar este detalle, el tipo de estructuración del subencabezado deberá ser igual a 1) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1750842.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301".** 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1752591.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN de la estructuravinculada a subyacentes. 12 |
| 3 | CUSIP o CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1754444.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de laestructura vinculada a subyacentes. 13 |
| 4 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1756297.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL la estructuravinculada a subyacentes. 14 |
| 5 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1758116.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor de la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 6 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1759935.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora de la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1761754.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriede la estructura vinculada a subyacentes.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de indeval.5 |
| 8 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1763573.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo de la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 9 | Fecha de colocación de la Nota Estructurada. |  | F | 8 | 0 | 60 | 67 | Se deberá anotar la fecha de colocación de la estructura vinculada a subyacentes. 3 |
| 10 | Fecha de vencimiento |  | F | 8 | 0 | 68 | 75 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento de laestructura vinculada a subyacentes. 3 |
| 11 | Valor Nominal |  | N | 14 | 2 | 76 | 91 | Se deberá anotar el Valor Nominal, en la divisa decotización, de la estructura vinculada a subyacentes en directo (Principal Protegido a Vencimiento). 2 |
| 12 | Número de Títulos |  | N | 12 | 0 | 92 | 103 | Se deberá anotar el número de títulos de la estructuravinculada a subyacentes adquiridos por la Siefore. 1 |
| 13 | Divisa de la Nota Estructurada |  | N | 2 | 0 | 104 | 105 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa decotización de la estructura vinculada a subyacentessegún el catálogo de Divisas. 1 |
| 14 | Observaciones |  | AN | 107 | 0 | 106 | 212 | Observaciones de la estructura vinculada a subyacentes.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA INSTRUMENTO DE DEUDA O VALOR EXTRANJERO DE DEUDA AL QUE SE VINCULA LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES DEL SUBENCABEZADO 1. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1773751.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "302".** 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1775500.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento deDeuda o Valor Extranjero de Deuda. 12 |
| 3 | CUSIP o CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1777353.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS delInstrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. 13 |
| 4 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1779206.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda, proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1781025.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero deDeuda. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 6 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1782844.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. 5 |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1784663.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de indeval. 5 |
| 8 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1786482.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. 5 |
| 9 | Número de Títulos |  | N | 12 | 0 | 60 | 71 | Cantidad de Títulos del Instrumento de Deuda o ValorExtranjero de Deuda que componen la estructuravinculada a subyacentes. 1 |
| 10 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 72 | 79 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento delInstrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la estructura vinculada a subyacentes. 3 |
| 11 | Tasa de Rendimiento |  | N | 2 | 4 | 80 | 85 | Se deberá anotar la tasa de rendimiento ligada al cupón que garantiza la protección del principal al vencimiento, correspondiente al día en que se inició la estructuración de la estructura vinculada a subyacentes. 2 |
| 12 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 86 | 87 | Se deberá anotar el identificador de la Divisa decotización del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la estructura vinculada a subyacentes. 1 |
| 13 | Espacios en blanco |  | AN | 125 | 0 | 88 | 212 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNA DE LAS DIFERENTES ACCIONES ADQUIRIDAS EN DIRECTO PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1795675.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "303".** 1 |
| 2 | ISIN Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1797424.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. 12 |
| 3 | CUSIP o CINS Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1799277.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de laacción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. 13 |
| 4 | SEDOL Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1801130.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL de la acciónutilizada para conformar la estructura vinculada asubyacentes. 14 |
| 5 | Tipo de Valor Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1802949.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 6 | Emisora Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1804768.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora de la acción utilizada para conformar laestructura vinculada a subyacentes. 5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Serie Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1806587.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriede la acción utilizada para conformar la estructuravinculada a subyacentes.5 |
| 8 | Consecutivo Acción | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1808406.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo de la acción utilizada para conformar laestructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 9 | Número de Acciones |  | N | 12 | 0 | 60 | 71 | Número de Acciones que componen la Nota a la fechadel reporte. 1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 10 | Divisa |  | N | 2 | 0 | 72 | 73 | Se anotará el identificador de la Divisa en la cual estácotizada la acción, según el catálogo de Divisas. 2 |
| 11 | Indice o Subíndice |  | AN | 18 | 0 | 74 | 91 | En caso de que la posición en acciones se use para lareplicación de algún Indice o Subíndice, este campoestará conformado por el Tipo de Valor, Emisora y Serie del Indice o Subíndice, 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. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo.  En otro caso, el campo debe ir vacío. 5 |
| 12 | Espacios en blanco |  | AN | 121 | 0 | 92 | 212 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES DERIVADOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1816614.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "304".** 1 |
| 2 | ISIN Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1818363.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN del InstrumentoDerivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | CUSIP o CINS Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1820216.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS delInstrumento Derivado utilizado para conformar laestructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. 13 |
| 4 | SEDOL Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1822069.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del InstrumentoDerivado utilizado para conformar la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo de Valor Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1823888.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 6 | Emisora Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1825707.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del Instrumento Derivado utilizado paraconformar la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 7 | Serie Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1827526.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel Instrumento Derivado utilizado para conformar laestructura vinculada a subyacentes.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de indeval.5 |
| 8 | Consecutivo Derivado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1829345.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo del Instrumento Derivado utilizado paraconformar la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 9 | Fecha de vencimiento |  | F | 8 | 0 | 60 | 67 | Se deberá anotar la fecha en que teóricamente vence el Instrumento Derivado. 3 |
| 10 | Fecha de liquidación |  | F | 8 | 0 | 68 | 75 | Se deberá anotar la fecha en la que se liquida o seintercambia el flujo del contrato derivado. 3 |
| 11 | Tamaño del contrato |  | N | 14 | 2 | 76 | 91 | Se deberá anotar el tamaño del contrato o MontoNocional pactado en valor absoluto en la Divisa pactada.  En caso de ser un Swap, se deberá anotar el MontoNocional de los flujos a entregar en la divisa pactada 2 |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 12 | Tamaño del contrato 2 |  | N | 14 | 2 | 92 | 107 | En caso de ser un Swap, se deberá anotar el tamaño del contrato o Monto Nocional pactado para los flujos a recibir en valor absoluto en la Divisa pactada.  Se dejará en cero en otro caso. 2 |
| 13 | Número de contratos |  | N | 14 | 0 | 108 | 121 | Se deberá anotar el número de contratos del Derivadoque componen la Nota en la fecha del reporte. 1 |
| 14 | Tipo de Operación |  | N | 1 | 0 | 122 | 122 | Se deberá anotar el tipo de operación que se pactó,únicamente "1" para Largo y "2" para Corto. 1 |
| 15 | Delta |  | N | 3 | 6 | 123 | 131 | Se deberá anotar la delta del Instrumento Derivadoproporcionada por el proveedor de precios, sólo aplicapara opciones, en otro caso será igual a 1. 2 |
| 16 | Divisa Tamaño Contrato |  | N | 2 | 0 | 132 | 133 | Se anotará el identificador de la Divisa en la cual sepacta el Tamaño de Contrato o Monto Nocional, según el catálogo de Divisas.  En caso de tratarse de un Swap se deberá de anotar el identificador de la divisa correspondiente al MontoNocional de los flujos a entregar 2 |
| 17 | Divisa Tamaño Contrato 2 |  | N | 2 | 0 | 134 | 135 | En caso de tratarse de un Swap, se anotará elidentificador de la Divisa en la cual se pacta el MontoNocional a recibir, según el catálogo de Divisas.  Se dejará vacío en otro caso 2 |
| 18 | Subyacente |  | AN | 18 | 0 | 136 | 153 | Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie delSubyacente si éste existe cotizando en el mercado, deesta manera se respetarán el formato de cuatroposiciones para el tipo valor, siete posiciones para laemisora y siete posiciones para la serie. En el caso deno utilizar completamente los caracteres de alguno delos tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo.  En caso de que el subyacente no sea un bien específico, se utilizará el catálogo de emisoras o de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. 5 |
| 19 | Espacios en blanco |  | AN | 59 | 0 | 154 | 212 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 5:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHICULOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro |  | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "305".** 1 |
| 2 | ISIN Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1846197.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo queconforma la estructura vinculada a subyacentes,proporcionada por el proveedor de precios. 12 |
| 3 | CUSIP o CINS Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1848050.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS delVehículo que conforma la estructura vinculada asubyacentes, proporcionada por el proveedor de precios.13 |
| 4 | SEDOL Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1849903.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes,proporcionada por el proveedor de precios. 14 |
| 5 | Tipo de Valor Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1851722.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes. 5 |
| 6 | Emisora Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1853541.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del Vehículo que conforma la estructuravinculada a subyacentes. 5 |
| 7 | Serie Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1855360.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel Vehículo que conforma la estructura vinculada asubyacentes.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconsistente con la información recibida por estaComisión de indeval.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 8 | Consecutivo Vehículo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1857179.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo del Vehículo que conforma la estructuravinculada a subyacentes. 5 |
| 9 | Cantidad de títulos |  | N | 12 | 0 | 60 | 71 | Cantidad de Títulos o acciones del Vehículo quecomponen la estructura vinculada a subyacentesen lafecha del reporte. 1 |
| 10 | Espacios en blanco |  | AN | 141 | 0 | 72 | 212 | Vacíos. 6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 6:** CONTIENE LA INFORMACION UTILIZADA PARA LA RÉPLICA DE ÍNDICES. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1863405.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "307".** |
| 2 | Tipo de Valor Índice | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1865154.png | AN | 7 | 0 | 4 | 10 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del índice que se está replicando |
| 3 | Emisora Índice | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1867007.png | AN | 4 | 0 | 11 | 14 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del índice que se está replicando. |
| 4 | Serie Índice | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1868860.png | AN | 7 | 0 | 15 | 21 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel índice que se está replicando |
| 5 | ISIN Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1870679.png | AN | 12 | 0 | 22 | 33 | Se deberá anotar la clave del ISIN del componenteutilizado para conformar el índice. |
| 6 | CUSIP o CINS Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1872498.png | AN | 9 | 0 | 34 | 42 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS delcomponente utilizado para conformar el índice. |
| 7 | SEDOL Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1874317.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del componenteutilizado para conformar el índice. |
| 8 | Tipo de Valor Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1876136.png | AN | 4 | 0 | 50 | 53 | Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo devalor del componente utilizado para conformar el índice. |
| 9 | Emisora Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1877955.png | AN | 7 | 0 | 54 | 60 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a laemisora del componente utilizado para conformar elíndice. |
| 10 | Serie Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1879774.png | AN | 7 | 0 | 61 | 67 | Clave que le otorgue el proveedor de precios a la seriedel componente utilizado para conformar el índice. |
| 11 | Consecutivo Componente | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp2a11_Cimg_1881593.png | AN | 10 | 0 | 68 | 77 | Clave que le otorgue el proveedor de precios alconsecutivo del componente utilizado para conformar el índice. |
| 12 | Número de Unidades |  | N | 12 | 0 | 78 | 89 | Número de Acciones, Títulos o Subyacentes (número de contratos por tamaño de contratos) del componente con el que se está realizando la réplica a la fecha del reporte. |
| 13 | Valor a Mercado Unitario |  | N | 12 | 4 | 90 | 105 | En este campo se deberá reportar el valor unitario amercado de las acciones, instrumentos o subyacentesdel componente en pesos mexicanos. |
| 14 | Valor a Mercado Total |  |  | 12 | 4 | 106 | 121 | En este campo se deberá reportar el valor total amercado de la posición en pesos mexicanos. |
| 15 | Monto expuesto |  | N | 12 | 4 | 122 | 137 | En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos. |
| 16 | Peso específico del Instrumento en la réplica. |  | N | 3 | 6 | 138 | 146 | Se deberá anotar el peso específico, en puntosporcentuales, del componente en la réplica realizada.Las posiciones enteras son puntos porcentuales y lasdecimales fracciones de puntos porcentuales. |
| 17 | Ponderador del instrumentos en el índice. |  | N | 3 | 6 | 147 | 155 | Se deberá anotar el ponderador, en puntos porcentuales, de este componente en el índice que se está replicando. Las posiciones enteras son puntos porcentuales y las decimales fracciones de puntos porcentuales. |
| 18 | Descripción del componente |  | AN | 50 | 0 | 156 | 205 | Se deberá anotar una breve descripción de la entidadque emite el componente o bien el subyacente de este. |
| 19 | Espacios en blanco |  | AN | 7 | 0 | 206 | 212 | Vacíos. |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Estructura** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Notas Estructuradas en Directo. |
| 2 | Notas Estructuradas por la Siefore. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de** **Tipo de** **Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave Subtipo** **de Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Estatus del Registro** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alta |
| 4 | Constante |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 |
| **Catálogo de Divisa** | | |
| **Id** | **Clave** | **Descripción** |
| 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 |
| 32 | PEN | Nuevo Sol Peruano |
| 33 | SGD | Dólar de Singapur |
| 99 | OTR | Otras Divisas |

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

|  |
| --- |
| **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, seanotará 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 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.

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.

19 El ID será el consecutivo interno asignado por la Administradora.

|  |
| --- |
| **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 observaciones de cada campo.

|  |
| --- |
| **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.

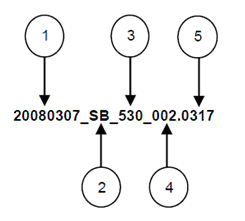
V.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de AportacionesVoluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que sereporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Sólo aplicará para familia deSIEFORES. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 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 = "0317"**. |

**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 dos, 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\_002.0317.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\_002.0317**

**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 |

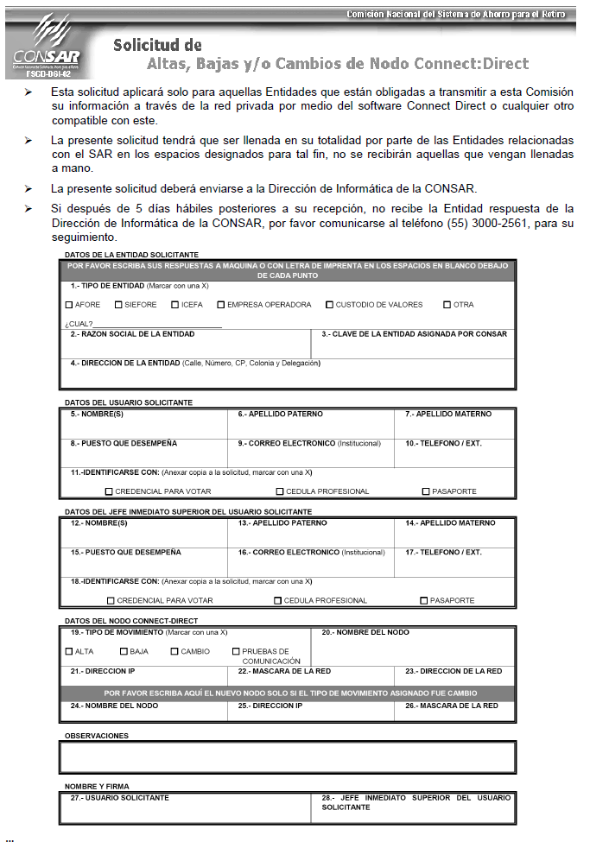
       La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

|  |
| --- |
|  |

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

**...**

**Anexo 80**



**Anexo 92**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.-Este archivo contiene Información de los porcentajes de participación por Serie, los movimientos de las acciones en circulación por Serie y el precio de la Acción por Serie | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO. | 136 | 07:00 a 10:00 Hrs |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_190200.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**"**136**".1 |
| 4 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_193737.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante"0321".**1 |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_195472.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta lainformación, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_197207.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. 1 |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_198942.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos.1 |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_200663.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de la operación que se reporta.3 |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 104 | 0 | 33 | 136 | Vacíos. 6 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:**DETERMINACION DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACION DE LA ACCION POR SERIE | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_205899.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301**". 1 |
| 2 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_207648.png | AN | 12 | 0 | 4 | 15 | Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios12. |
| 3 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_209501.png | AN | 9 | 0 | 16 | 24 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINSproporcionada por el proveedor de precios13. |
| 4 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_211354.png | AN | 7 | 0 | 25 | 31 | Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios14. |
| 5 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_213173.png | AN | 4 | 0 | 32 | 35 | Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor deprecios al activo5. |
| 6 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_215006.png | AN | 7 | 0 | 36 | 42 | Clave que le otorgue a la emisora el proveedor deprecios al activo5. |
| 7 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_216839.png | AN | 7 | 0 | 43 | 49 | Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo5 |
| 8 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_218574.png | AN | 10 | 0 | 50 | 59 | Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor deprecios al activo5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 9 | Porcentaje de Participación |  | N | 2 | 6 | 60 | 67 | Determinar el % que representa, el capital contable decada serie respecto del capital contable, se deberáanotar el resultado en forma de porcentaje a seisdecimales2. |
| 10 | Comisión por Serie |  | N | 2 | 4 | 68 | 73 | Es la comisión aplicada a cada Serie, se deberá anotar en forma de porcentaje a cuatro decimales2. |
| 11 | Acciones en circulación iniciales |  | N | 12 | 0 | 74 | 85 | Es la cantidad de acciones en circulación finales porSerie del día anterior1. |
| 12 | Acciones vendidas |  | N | 12 | 0 | 86 | 97 | Es la cantidad de acciones por Serie vendidas del díaque se está reportando1. |
| 13 | Acciones compradas |  | N | 12 | 0 | 98 | 109 | Es la cantidad de acciones por Serie compradas del día que se está reportando1. |
| 14 | Acciones en circulación finales |  | N | 12 | 0 | 110 | 121 | Es la cantidad de acciones en circulación por Serie endía que se está reportando1. |
| 15 | Precio de la acción |  | N | 9 | 6 | 122 | 136 | Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6decimales2. |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Entidades** | | |
| **Clave Tipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 001 | AFORES | AF |
| 002 | SIEFORES BASICA | SB |
| 003 | SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS | AC |
| **004** | **SIEFORES PREVISION 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 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |
| --- |
| **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, seanotará 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 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.

**...**

11 El Activo Neto 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.

|  |
| --- |
| **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 Solo aquellas Siefores de Previsión Social que tengan en su estructura diferentes series accionarias derivadas del cobro de comisiones sobre saldo diferenciadas.

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.

VI.   En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando las claves según la BMV si éstas existen o si el proveedor de precios les ha asignado valor, de lo contrario se llenarán los espacios vacíos con CEROS.

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

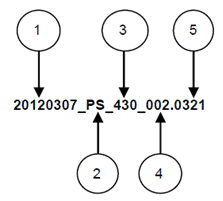
VIII.  El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 | 3 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 tieneestipulado un número, para este caso será **Constante = "0321"**. |

**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 de Previsión Social Dos, 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:

**20120307\_PS\_430\_002.0321.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:

**A20120307\_PS\_430\_002.0321**

**NOTA:**No se tomara 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 94**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Vector de Precios de Productos Derivados para SIEFORE. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO. | 216 | 16:00 a 20:00 Hrs. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_296489.png | AN | 2 | 0 | 1 | 2 | Identificador de registro Constante "H"4. |
| 2 | Tipo de Mercado | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_298238.png | AN | 2 | 0 | 3 | 4 | Constante "DR" Mercado de Derivados4. |
| 3 | Fecha del Vector | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_300091.png | F | 8 | 0 | 5 | 12 | Fecha de información3. |
| 4 | Tipo de Valor | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_301944.png | AN | 4 | 0 | 13 | 16 | Clave de tipo de operación  Para Derivados OTC, se tomará el Tipo de Valor según el "Catálogo de Tipos de Valor OTC".  Para los Mercados listados se tomará la clasificaciónpreestablecida, o la que determine cada proveedor dePrecios4. |
| 5 | Emisora | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_303763.png | AN | 7 | 0 | 17 | 23 | Para el caso de derivados que coticen en bolsas locales, se deberá reportar la clave del contrato asignada por la bolsa en donde cotice.  Para el caso de futuros que coticen en mercadosinternacionales, se deberá reportar el identificador queasigna Bloomberg al tipo de contrato y que forma parte del Ticker.  Para derivados OTC, distintos a los swaps, se usará laclave larga de acuerdo a las Reglas para Emisoras delAnexo I correspondiente al subyacente; en caso de que el subyacente no tenga clave larga asociada, elProveedor de Precios definirá la clave larga a usar.  Para derivados OTC donde el subyacente sea una divisa diferente del peso se utilizarán seis caracteres que describa la cotización usando las tres primeras letras para la divisa a entregar y las últimas tres para la divisa a recibir conforme a las Reglas para Emisoras del Anexo I.  Para el caso de operaciones de swap, la Emisora sedefinirá de acuerdo con el Anexo I del presente formato. 4 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 6 | Serie | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_305596.png | AN | 6 | 0 | 24 | 29 | Para el caso de derivados que coticen en bolsas locales, se deberá reportar la clave del vencimiento asignada por la bolsa en donde cotice.  Para el caso de futuros que coticen en mercadosinternacionales, se deberá reportar el identificador queasigna Bloomberg al vencimiento del contrato y queforma parte del Ticker.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha devencimiento del mismo, la serie reportada deberá serconstruida considerando el formato "aammdd"4. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Precio Sucio |  | N | 9 | 6 | 30 | 44 | Precio de origen, deberá ser 24hrs2. |
| 8 | Precio Limpio |  | N | 9 | 6 | 45 | 59 | Precio de origen, deberá ser 24hrs2. |
| 9 | Delta |  | N | 6 | 6 | 60 | 71 | Para el caso de opciones, será la delta de la opción, en otro caso será constante "000000000000"2. |
| 10 | Volatilidad Implícita |  | N | 3 | 8 | 72 | 82 | Para el caso de las opciones, se deberá anotar laVolatilidad con la que se valúa la operación, en otro caso se deberá anotar ceros2. |
| 11 | ID del Proveedor |  | AN | 6 | 0 | 83 | 88 | ID del proveedor de Precios de acuerdo al "Catálogo de Proveedores de Precios"4. |
| 12 | Días por Vencer |  | N | 6 | 0 | 89 | 94 | Son los días que faltan para el vencimiento de laemisión1. |
| 13 | Tasa de Descuento |  | N | 3 | 6 | 95 | 103 | Será constante "000000000"1. |
| 14 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_313760.png | AN | 12 | 0 | 104 | 115 | Se deberá anotar la clave del ISIN5. |
| 15 | Consecutivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_315507.png | AN | 10 | 0 | 116 | 125 | Identificador que le otorgue como consecutivo elproveedor de precios al derivado8. |
| 16 | Precio Cierre | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_317254.png | N | 9 | 6 | 126 | 140 | Precio de cierre de mercados listados2. |
| 17 | CUSIP o CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_319001.png | AN | 9 | 0 | 141 | 149 | Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS6. |
| 18 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_320748.png | AN | 7 | 0 | 150 | 156 | Se deberá anotar la clave del SEDOL7. |
| 19 | Precio de referencia de la pata a entregar. |  | N | 14 | 6 | 157 | 176 | Se deberá anotar el precio sucio de la pata a entregarpor la SIEFORE para el caso de swaps OTC que noliquiden en contrapartes centrales.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar el precio sucio de la pata a entregar en el contrato, asumiendo una posición larga en dicho contrato.  En caso de reportar operaciones distintas a swaps, sedeberán reportar ceros2. |
| 20 | Precio de referencia de la pata a recibir. |  | N | 14 | 6 | 177 | 196 | Se deberá anotar el precio sucio de la pata a recibir por la SIEFORE para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar el precio sucio de la pata a recibir en el contrato, asumiendo una posición larga en dicho contrato.  En caso de reportar operaciones distintas a swaps, sedeberán reportar ceros2. |
| 21 | Curva de descuento |  | AN | 5 | 0 | 197 | 201 | Para el caso de derivados distintos de swaps, se deberá anotar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar el derivado de acuerdo con el Catálogo de Curvas.  Para el caso de swaps OTC que no liquiden encontrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a entregar por la SIEFORE de acuerdo con el Catálogo de Curvas.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar elidentificador de la curva de descuento utilizada paravaluar la pata a entregar en el contrato asumiendo unaposición larga en el mismo.  Para el caso de los derivados de tipo de cambio, en este campo se deberá reportar la curva de descuentocorrespondiente a la divisa a entregar del derivado.  Para cualquier otro caso se deberá reportar vacío4. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 22 | Curva de descuento de la pata a recibir |  | AN | 5 | 0 | 202 | 206 | Para el caso de derivados distintos de swaps, se deberá reportar en ceros.  Para el caso de swaps OTC que no liquiden encontrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a recibir por la SIEFORE de acuerdo con el Catálogo de Curvas.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar elidentificador de la curva de descuento utilizada paravaluar la pata a recibir en el contrato asumiendo unaposición larga en el mismo.  Para el caso de los derivados de tipo de cambio, en este campo se deberá reportar la curva de descuentocorrespondiente a la divisa a recibir del derivado. Paracualquier otro caso se deberá reportar vacío4. |
| 23 | Curva de estimación de tasas a entregar |  | AN | 5 | 0 | 207 | 211 | Para el caso de swaps OTC que no liquiden encontrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a entregar por la SIEFORE, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar elidentificador de la curva utilizada para realizar laproyección de tasas de interés, de acuerdo con elCatálogo de Curvas, de la pata a entregar en el contrato asumiendo una posición larga en dicho contrato, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.  Se deberá reportar en ceros para cualquier otro caso4. |
| 24 | Curva de estimación de tasas a recibir |  | AN | 5 | 0 | 212 | 216 | Para el caso de swaps OTC que no liquiden encontrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a recibir por la SIEFORE, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.  Para el caso de swaps que liquiden en contrapartescentrales y swaps listados, se deberá reportar elidentificador de la curva utilizada para realizar laproyección de tasas de interés, de acuerdo con elCatálogo de Curvas, de la pata a recibir en el contratoasumiendo una posición larga en dicho contrato, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.  Se deberá reportar en ceros para cualquier otro caso4. |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 Proveedores de Precios** | | | |
| **ID Proveedor** | **Clave del** **Proveedor** | **Descripción** | **Abreviación** |
| 1 | 025009 | Proveedor Integral de Precios, S.A. de C.V. | PIP |
| 3 | 025012 | Valuación Operativa y Referencias de Mercado S.A. de C.V | VALMER |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipos de Valor OTC** | |
| **Tipo de Valor** | **Tipo de Instrumento** |
| FWD | Forwards |
| SWP | Swaps |
| CALL | Opción de Compra |
| PUT | Opción de Venta |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Curvas** | |
| **Identificador** | **Curva** |
| 00001 | Cross Currency Swap Dólar - Peso mexicano |
| 00002 | Cross Currency Swap Euro - Peso mexicano |
| 00003 | Cross Currency Swap Libor Dólar - Euribor |
| 00004 | Cross Currency Swap TIIE Euribor |
| 00005 | Cross Currency Swap UDI Libor |
| 00006 | Cross Currency Swap UDI TIIE |
| 00007 | Curva Treasury |
| 00008 | Euribor 6M |
| 00009 | Fed Funds |
| 00010 | Implícita en Forward de Dólar australiano - Dólar |
| 00011 | Implícita en Forward de Dólar canadiense - Dólar |
| 00012 | Implícita en Forward de Dólar de Hong Kong Dólar |
| 00013 | Implícita en Forward de Euro Dólar |
| 00014 | Implícita en Forward de Euro - Pesos mexicanos |
| 00015 | Implícita en Forward de Franco suizo - Dólar |
| 00016 | Implícita en Forward de Libra Esterlina - Dólar |
| 00017 | Implícita en Forward de Peso chileno - Dólar |
| 00018 | Implícita en Forward de Pesos mexicanos - Dólar |
| 00019 | Implícita en Forward de Pesos mexicanos- Dólar (Fix) |
| 00020 | Implícita en Forward de Real brasileño - Dólar |
| 00021 | Implícita en Forward de Yen japonés - Dólar |
| 00022 | Implícita en Forward de Yen japonés - Peso mexicano |
| 00023 | Implícita en Forward de Yuan chino Dólar |

|  |  |
| --- | --- |
| 00024 | Libor Dólar australiano |
| 00025 | Libor Dólar canadiense |
| 00026 | Libor Dólar neozelandés |
| 00027 | Libor Dólares construcción 1M |
| 00028 | Libor Dólares construcción 3M |
| 00029 | Libor Dólares construcción 6M |
| 00030 | Libor Euro |
| 00031 | Libor Franco suizo |
| 00032 | Libor Libra Esterlina |
| 00033 | Libor Yen japonés |
| 00034 | Soberana nominal (Cetes y BONOS M) |
| 00035 | Soberana real (UDIBONOS) |
| 00036 | TIIE OIS colateral en MXN |
| 00037 | TIIE IRS sin colateral |
| 00038 | TIIE OIS colateral en USD |
| 00039 | Otras Curvas |

**ANEXO I**

**1.**     **Claves de emisora de Swaps**

       En el caso de los swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales, la emisora se compondrá de la siguiente forma:

       El primer carácter corresponderá a la clave del tipo de swap de acuerdo con la siguiente tabla:

|  |  |
| --- | --- |
| **Tasas** | **Clave** |
| Fija-Fija | 0 |
| Fija-Variable | 1 |
| Variable-Variable | 2 |
| Variable Fija | 6 |
| **Cross Currency** |  |
| Fija-Fija | 3 |
| Fija-Variable | 4 |
| Variable-Variable | 5 |
| Variable - Fija | 7 |

       Para el caso de swaps listados o que sean liquidados en contrapartes centrales, el primer carácter se asignará de acuerdo con las características del contrato de swap asumiendo una posición larga.

       Los siguientes 6 caracteres de la emisora dependerán del swap que se esté valuando:

       Para las operaciones de swap OTC que no liquiden en contrapartes centrales, los 6 caracteres restantes de la emisora se deberán establecer conforme a la estructura del tipo de tasas a intercambiar por la SIEFORE, en primer lugar se pondrá la clave corta asociada a la tasa que entregue la SIEFORE y en segundo lugar la clave corta asociada a la tasa que reciba.

       Para el caso de los swaps listados o que liquiden en contrapartes, los 6 caracteres restantes de la emisora se deberán establecer conforme a la estructura del tipo de tasas a intercambiar en el contrato derivado, indicando en primer lugar la clave corta asociada a la tasa que se entregue en el swap, y en segundo lugar la clave corta asociada a la tasa que se reciba en el contrato, asumiendo siempre una posición larga en el contrato.

       Las tasas fija se identificarán con la clave de 3 caracteres de la moneda de origen de la tasa.

       Las tasas variables se identificarán con la clave corta de la tasa definida en la sección "Reglas para Emisoras" del presente anexo.

       Ejemplos del uso de las claves para la construcción de la emisora:

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Operación** | **1** | **2** | **3** | **4** | **5** | **6** | **7** | **Resultado** |
| Swap tasa fija 8.25 vs CETES.  La SIEFORE entrega tasa fija 8.25 y recibe Cetes | 1 | M | X | P | C | E | T | 1MXPCET |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Swap TIIE vs CETES.  La SIEFORE entrega TIIE y recibe CETES | 2 | T | I | E | C | E | T | 2TIECET |
| Swap MXP 7.28 vs USD 2.00.  La SIEFORE entrega tasa Pesos y recibe tasaDólares | 3 | M | X | P | U | S | D | 3MXPUSD |
| Swap EUR 1.35 vs USD Libor.  La SIEFORE entrega tasa EUR y recibe USD Libor | 4 | E | U | R | L | U | S | 4EURLUS |
| Swap MXP TIIE vs EUR Libor.  SIEFORE entrega TIIE y recibe EUR Libor | 5 | T | I | E | L | E | U | 5TIELEU |
| Swap listado TIIE vs MXP 5.02 en posición larga  El contrato en posición larga entrega TIIE y recibefija al 5.02 en pesos.  La SIEFORE entrega TIIE y recibe fija al 5.02 enpesos | 6 | T | I | E | M | X | P | 6TIEMXP |
| Swap listado TIIE vs MXP 5.02 en posición corta.  Pese a que por tener el contrato en posición corta laSIEFORE entrega tasa fija al 5.02 en pesos y recibeTIIE, la especificación para la construcción de laemisora señala que para este tipo de swaps se debeasumir una posición larga en el contrato, el cualentrega TIIE y recibe tasa fija al 5.02 en pesos. | 6 | T | I | E | M | X | P | 6TIEMXP |

**Reglas para Emisoras**

·      Las claves largas para cada una de las monedas operadas están contempladas dentro del vector de precios, siendo formada por la clave de cada una de las monedas participantes según el catálogo de divisa quedando en seis caracteres.

·      Las claves largas de las tasas libor se conforman de la siguiente manera: las dos primeras posiciones corresponderán a las letras LI y las siguientes tres a la moneda a la que corresponda la tasa libor.

·  Las claves cortas de las tasas libor se conforman de la siguiente manera: la 1ª posición corresponderá a la letra L y las siguientes dos a las dos primeras letras de la moneda a la que corresponda la tasa libor.

Ejemplos:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Descripción** | **Clave Larga** | **Clave Corta** | **Categoría** |
| Libor en Dólares | LIUSD | LUS | Tasa |
| Libor en Euros | LIEUR | LEU | Tasa |
| Libor en Yenes | LIJPY | LJP | Tasa |

·      Las claves largas para TIIE se conforman de la siguiente manera: las primeras cuatro letras con el texto TIIE y las siguientes con el plazo de la TIIE.

       Las claves cortas para TIIE se conforman del texto TIE.

Ejemplos:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Descripción** | **Clave Larga** | **Clave Corta** | **Categoría** |
| TIIE 28 | TIIE28 | TIE | Tasa |
| TIIE 91 | TIIE91 | TIE | Tasa |

·      Las claves largas para CETES se conforman de la siguiente manera: las primeras tres letras con el texto CET y las siguientes con el plazo del CETE.

       Las claves cortas para CETES se conforman del texto CET.

Ejemplos:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Descripción** | **Clave Larga** | **Clave Corta** | **Categoría** |
| Cetes 28 | CET28 | CET | Tasa |
| Cetes 91 | CET91 | CET | Tasa |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Cetes 182 | CET182 | CET | Tasa |

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

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 lacantidad, 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.

8 Consecutivo. Este campo será asignado por el proveedor de precios, y para el caso de derivados deberá asignarse conforme a lo siguiente:

|  |  |
| --- | --- |
| **No. de carácter** | **Descripción** |
| **1** | Letra Inicial de Proveedor P = PIP, V = VALMER. |
| **2-3** | Clave que identifica el año en el que se dio de alta el Derivado 03 = 2003, 04 = 2004... y asísucesivamente. |
| **4-8** | Número consecutivo de la operación, el cual será diferente para cada proveedor; dado quedependerá de las operaciones que sus clientes vayan realizando. Será incrementado en uno cadavez que exista duplicidad en "Tipo de valor", "Emisora" y "Serie". |
| **9-10** | En caso de que las operaciones estén respaldadas por un acuerdo de intercambio de colateralconocidos como "Credit Support Annex" (CSA) que impacte la valuación del instrumento, se deberán reportar los siguientes caracteres de acuerdo con el tipo de colateral que respaldan los contratos:   |  |  | | --- | --- | | Caracteres | Tipo de colateral | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | |  |  | | --- | --- | | "CU" | Colateral en dólares americanos (USD) | | "CM" | Colateral en pesos mexicanos (MXN) |     En caso de las operaciones que liquiden en las cámaras de compensación de CME o Asigna seutilizarán los caracteres "CU".  En otro caso llenar con espacios en blanco. |

|  |
| --- |
| **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 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 envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de una VPN (Red privada Virtual) para cada proveedor de precios.

II.     Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de Precios contratado por cada Administradora.

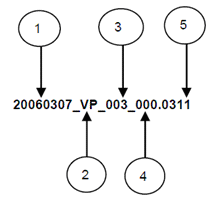
III.    El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 16:00 a las 20:00 hrs.

IV.   El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte del proveedor 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 Envió en que está transmitiendo elarchivo en formato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme alCatálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, **Constante = "VP"** |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuáles serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuáles serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, **Constante = "000".** |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato yatiene estipulado un número constante para este caso será, **Constante = 0311**. |

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

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad VALMER 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:

**A20060307\_VP\_003\_000.0311**

       La Comisión emitirá un Estatus de Validación, que será recibido por los Proveedores de Precios.

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

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCIÓN** | **RUTA** |
| Envío Normal | Definido en su VPN hacia E:(consarinfo) |
| Recuperación de Acuse | export/home/rec/VECTORH/TRANSMISION |

**...**

**Anexo 97**

Se deroga.

**...**

**Anexo 111**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información del desglose de los activos objeto de inversión operados por los mandatarios. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| SEMANAL | Desde el último día hábil de la semana anterior hasta el primer día hábil de la semana en curso. | 419 | 17:00 Hrs. del último día hábil  de la semana previa hasta las 10:00 Hrs. del primer día hábil de la semana en curso. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_403150.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 encabezado1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 9 | 11 | Número de caracteres por registro = **Constante "419"**1. |
| 4 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_406687.png | N | 4 | 0 | 12 | 15 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante "0330"**1**.** |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_408422.png | N | 3 | 0 | 16 | 18 | Se deberá anotar la "Clave del Tipo de Entidad" de laSiefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo1. |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_410157.png | N | 3 | 0 | 19 | 21 | Se deberá anotar la "Clave de Entidad" de la Siefore anombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Entidades" anexo1. |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_411892.png | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Se deberá anotar la "Clave del Subtipo de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Subtipo de Entidades", anexos1. |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_413627.png | F | 8 | 0 | 25 | 32 | Fecha de operación que se reporta3. |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 387 | 0 | 33 | 419 | Vacíos5. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_418722.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "101"**1. |
| 2 | Identificador Mandatario | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_420471.png | AN | 7 | 0 | 4 | 10 | Se deberá reportar el nombre descriptivo del Mandatario que defina la Administradora. Deberá corresponder a la información que reporta la Siefore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 3 | Consecutivo Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_422324.png | AN | 7 | 0 | 11 | 17 | Deberá ser un consecutivo que defina la Administradora, el cual se incrementará para cada mandato que se contrate con un mismo mandatario. Deberá corresponder a la información del campo "Serie" que reporta la Siefore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 4 | Clase de Inversión tercerizada |  | AN | 10 | 0 | 18 | 27 | Se deberá reportar el indicador de clase de activo sobre el que operará el mandato según el catálogo "Clase de Inversión tercerizada". Deberá corresponder a la información que la Siefore reporta en el campo"Consecutivo" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 5 | País del Mandatario |  | N | 2 | 0 | 28 | 29 | Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países1. |
| 6 | Fecha de Concertación del Mandato. |  | F | 8 | 0 | 30 | 37 | Reportar la fecha en que se pactó el mandato (Fecha de firma del contrato)3. |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 382 | 0 | 38 | 419 | Vacíos5. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:**CARTERA DE VALORES. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro |  | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301"**1**.** |
| 2 | Tipo de Inversión |  | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador del tipo de inversiónconforme al "Catálogo de Tipo de Inversión"1. |
| 3 | Identificador del Instrumento del Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_432623.png | AN | 10 | 0 | 6 | 15 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 4 | ISIN |  | AN | 12 | 0 | 16 | 27 | Se deberá anotar la clave del ISIN del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada7. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 5 | CUSIP O CINS |  | AN | 9 | 0 | 28 | 36 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada8. |
| 6 | SEDOL |  | AN | 7 | 0 | 37 | 43 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del activo endirecto, colateral de la operación de reporto o valor enpréstamo o garantía entregada reportada9. |
| 7 | Ticker Bloomberg |  | AN | 20 | 0 | 44 | 63 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg alactivo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista10. |
| 8 | Ticker Reuters |  | AN | 20 | 0 | 64 | 83 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al activo en directo, colateral de la operación de reporto o el valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista11. |
| 9 | Clase de Activo |  | N | 2 | 0 | 84 | 85 | Se deberá anotar el identificador de la clase de activoreportado según el "Catálogo de Clase de Activo de laInversión Tercerizada"1. |
| 10 | País de origen |  | N | 2 | 0 | 86 | 87 | Se deberá anotar el identificador del país donde seemitió el activo conforme al "Catálogo de Países"1. |
| 11 | ID Emisor/Contraparte |  | AN | 10 | 0 | 88 | 97 | Los identificadores reportados en este campo sedeberán definir en el "Detalle 4" del formato detransmisión 0331, en el campo denominado "IDEmisor/Contraparte".  En caso de reportar instrumentos de deuda, estructuras vinculadas a subyacentes o acciones se deberá anotar el identificador correspondiente al emisor del instrumento.  En caso de reportar vehículos, se deberá anotar elidentificador correspondiente al patrocinador del mismo.  En el caso de reportar operaciones de reporto, préstamo de valores o garantías entregadas, se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte 4. |
| 12 | Primera Calificación |  | N | 4 | 0 | 98 | 101 | En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la calificación mínima, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  Llenar con ceros en otro caso1. |
| 13 | Segunda Calificación |  | N | 4 | 0 | 102 | 105 | En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la segunda calificación más baja, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión.  Llenar con ceros en otro caso1. |
| 14 | Primera Calificadora |  | N | 2 | 0 | 106 | 107 | En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Primera Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras".  Llenar con ceros en otro caso1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Segunda calificadora |  | N | 2 | 0 | 108 | 109 | En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Segunda Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras".  Llenar con ceros en otro caso1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 16 | Fecha de Emisión |  | F | 8 | 0 | 110 | 117 | En caso de que se reporten instrumentos de deuda oestructuras vinculadas a subyacentes se deberá indicar la fecha de emisión.  En caso de que se reporten operaciones de reporto opréstamo de valores se deberá indicar la fecha deconcertación de la operación.  En otro caso indicar 19000101 3. |
| 17 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 118 | 125 | En caso de que se reporten instrumentos de deuda oestructuras vinculadas a subyacentes indicar la fecha de vencimiento.  En caso de que reporten operaciones de reporto ypréstamo de valores indicar la fecha de vencimiento de las operaciones.  En otro caso indicar 19000101 3. |
| 18 | Plazo Cupón |  | N | 4 | 0 | 126 | 129 | En caso de tratarse de instrumentos de deuda concupones, indicar el plazo del cupón en días.  En otro caso llenar con ceros1. |
| 19 | Tasas o sobretasas |  | N | 2 | 6 | 130 | 137 | En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones a tasa fija, se deberá indicar el nivel de la tasa cupón.  En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones flotantes se deberá indicar el nivel de lasobretasa del cupón.  En caso de estar reportando operaciones de reporto,indicar la tasa pactada.  Finalmente, en caso de estar reportando valores enpréstamo, se deberá indicar la tasa premio pactada en la operación.  En otro caso llenar con ceros2. |
| 20 | Divisa de Cotización |  | N | 2 | 0 | 138 | 139 | Se reportará el identificador de la divisa de cotización del activo según el "Catálogo de Divisas"1. |
| 21 | Divisa de liquidación |  | N | 2 | 0 | 140 | 141 | Se anotará el identificador de la divisa de liquidación del instrumento o de la operación que se reporte, según el "Catálogo de Divisas"1. |
| 22 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 142 | 153 | Se deberá reportar el número de títulos o acciones que conforman la posición del Mandato1. |
| 23 | Valor a Mercado |  | N | 12 | 2 | 154 | 167 | En este campo se deberá reportar el valor total amercado de la posición en pesos mexicanos6. |
| 24 | Valor Nominal |  | N | 8 | 2 | 168 | 177 | Para activos de deuda o estructuras vinculadas asubyacentes se indicará el Valor Nominal en la divisa de cotización del instrumento.  En otro casollenar con ceros2. |
| 25 | Títulos en Circulación |  | N | 8 | 0 | 178 | 185 | En el caso de instrumentos de deuda y estructurasvinculadas a subyacentes, se deberá reportar el número de títulos que se encuentran en circulación en la fecha en que se reporta la información.  En otro casollenar con ceros 1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 26 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías |  | AN | 10 | 0 | 186 | 195 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías".  Para el caso de activos a través de los cuales se tomeexposición a Renta Variable o Mercancías se deberáanotar lo siguiente:  -En caso de tratarse de una acción, el identificador que se definió para la acción.  -En el caso de vehículos que repliquen Índices, sedeberá anotar el identificador del Índice que replica elvehículo.  En otro caso dejar vacío4. |
| 27 | Protección Inflacionaria |  | N | 1 | 0 | 196 | 196 | Se deberá anotar 1 si el o los flujos del instrumentoestán denominados en Unidades de Inversión (UDIs) o en moneda nacional cuyos intereses garanticen unrendimiento mayor o igual a la variación de las Unidades de Inversión (UDIs) o del índice Nacional de Precios al Consumidor (INPC),  Se deberá anotar 0 en otro caso1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 28 | Indicador para cobertura de divisas |  | N | 1 | 0 | 197 | 197 | Se deberá anotar:  -     1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con lasAdministradoras.  -     0 en otro caso.1 |
| 29 | Aviso de Recomposición |  | N | 1 | 0 | 198 | 198 | Este campo se utilizará para indicar el tipo derecomposición al que la posición será sometida en caso de que con la misma se incurra en algún tipo de violación al Régimen de Inversión conforme a las disposiciones y lineamientos emitidos por la Comisión.  Se deberá indicar si la posición a la fecha de reporte de información no está sujeta a ningún tipo derecomposición, si se encuentra sujeta a un proceso derecomposición y se mantendrá la inversión de recursos en ella, o si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición y se planea deshacer la posición.  Para este fin, se deberá anotar el identificadorcorrespondiente al estatus vigente de la posiciónreportada y que se define en el "Catálogo Aviso deRecomposición"1. |
| 30 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 199 | 298 | Se deberá anotar una breve descripción del activo 4. |
| 31 | Espacios vacíos |  | AN | 121 | 0 | 299 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro |  | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "302"**1**.** |
| 2 | Identificador del Instrumento del Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_463348.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 3 | ISIN |  | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumentoreportado7. |
| 4 | CUSIP O CINS |  | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS delinstrumento reportado8. |
| 5 | SEDOL |  | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumentoreportado9. |
| 6 | Ticker Bloomberg |  | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg alinstrumento reportado en caso de que exista10. |
| 7 | Ticker Reuters |  | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters alinstrumento reportado en caso de que exista11. |
| 8 | Fecha de operación |  | F | 8 | 0 | 82 | 89 | Se deberá anotar la fecha de concertación de laoperación3. |
| 9 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 90 | 97 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del forward3. |
| 10 | Tamaño del Contrato |  | N | 14 | 2 | 98 | 113 | Se deberá anotar el tamaño del contrato en valorabsoluto y denominado en la divisa en que se pacte6. |
| 11 | Número de Contratos |  | N | 14 | 0 | 114 | 127 | Se deberá anotar el número de contratos abiertos envalor absoluto1. |
| 12 | Precio o Tasa Pactada |  | N | 14 | 6 | 128 | 147 | Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó laoperación2. |
| 13 | Plazo de Referencia |  | N | 4 | 0 | 148 | 151 | En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupónestándar del bono.  En otro caso se deberá llenar con ceros1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 14 | Tipo de Operación |  | N | 1 | 0 | 152 | 152 | Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición escorta1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Entrega Física o Diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 153 | 153 | Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D"cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega"4. |
| 16 | Clase de Activo |  | N | 2 | 0 | 154 | 155 | Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada"correspondiente al subyacente1. |
| 17 | Ticker Bloomberg Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 156 | 175 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver10. |
| 18 | Ticker Reuters Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 176 | 195 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver11. |
| 19 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías |  | AN | 10 | 0 | 196 | 205 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías".  En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente:  -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberáanotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso.  -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo.  En otro caso dejar vacío4. |
| 20 | Fecha de Vencimiento del Subyacente |  | F | 8 | 0 | 206 | 213 | Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista.  En otro caso indicar 190001013. |
| 21 | ID Emisor/Contraparte |  | AN | 10 | 0 | 214 | 223 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacontraparte de la operación. Estos identificadores sedeberán definir en el "Detalle 4" del formato detransmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte"4. |
| 22 | ID Bolsa de Derivados |  | AN | 10 | 0 | 224 | 233 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a laBolsa de Derivados a la que pertenece la cámara decompensación a través de la cual se llevará a cabo laliquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío.  Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4"del formato de transmisión 0331, en el campo "IDEmisor/Contraparte"4. |
| 23 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 2 | 0 | 234 | 235 | Se deberá anotar el identificador de la divisa decotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 24 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 2 | 0 | 236 | 237 | Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 25 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 238 | 239 | Se deberá anotar el identificador de la divisa deliquidación al vencimiento del contrato si se liquida pordiferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas"1. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 26 | Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 240 | 245 | En caso de que el forward tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga.  En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primerasposiciones el identificador del campo "Descripción" del"Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en laque está denominado el subyacente o el cheapest todeliver cuando aplique.  Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado4. |
| 27 | Valor a Mercado |  | N | 12 | 2 | 246 | 259 | En este campo se debe anotar el valor total a mercadode la posición que se reporta en pesos mexicanos6. |
| 28 | Monto expuesto |  | N | 12 | 2 | 260 | 273 | En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos2. |
| 29 | Indicador para cobertura de divisas |  | N | 1 | 0 | 274 | 274 | Se deberá anotar:  -     1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con lasAdministradoras.  -     0 en otro caso.1 |
| 30 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 275 | 374 | Se deberá anotar una breve descripción del activo.4 |
| 31 | Espacios en blanco |  | AN | 45 | 0 | 375 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro |  | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "303"**1**.** |
| 2 | Identificador del Instrumento del Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_495092.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 3 | ISIN |  | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento quese reporta en caso de que exista7. |
| 4 | CUSIP O CINS |  | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS delinstrumento que se reporta en caso de que exista8. |
| 5 | SEDOL |  | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumentoque se reporta en caso de que exista9. |
| 6 | Ticker Bloomberg |  | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista10. |
| 7 | Ticker Reuters |  | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista11. |
| 8 | Fecha de Operación |  | F | 8 | 0 | 82 | 89 | Se deberá anotar la fecha de la última operaciónconcertada sobre el futuro3. |
| 9 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 90 | 97 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento del futuro3. |
| 10 | Tamaño del Contrato |  | N | 14 | 2 | 98 | 113 | Se deberá anotar el tamaño del contrato en valorabsoluto y en la divisa en que se pacte2. |
| 11 | Número de Contratos |  | N | 14 | 0 | 114 | 127 | Se deberá anotar el número de contratos abiertos envalor absoluto1. |
| 12 | Precio o Tasa Pactada |  | N | 14 | 6 | 128 | 147 | Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó laoperación2. |
| 13 | Plazo de Referencia |  | N | 4 | 0 | 148 | 151 | En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupónestándar del bono.  En otro caso se deberá llenar con ceros1. |
| 14 | Tipo de Operación |  | N | 1 | 0 | 152 | 152 | Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición escorta1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Entrega Física o Diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 153 | 153 | Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D"cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega"4. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 16 | Clase de Activo |  | N | 2 | 0 | 154 | 155 | Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada"correspondiente al subyacente1. |
| 17 | Ticker Bloomberg Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 156 | 175 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver10. |
| 18 | Ticker Reuters Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 176 | 195 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver11. |
| 19 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_511731.png | AN | 10 | 0 | 196 | 205 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías".  En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente:  -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberáanotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso.  -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo.  En otro caso dejar vacío4. |
| 20 | Fecha de Vencimiento del Subyacente |  | F | 8 | 0 | 206 | 213 | Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista.  En otro caso indicar 190001013. |
| 21 | ID Bolsa de Derivados |  | AN | 8 | 0 | 214 | 221 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a laBolsa de Derivados en la cual fue adquirida la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4"del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte"4. |
| 22 | Divisa de cotización del subyacente |  | N | 2 | 0 | 222 | 223 | Se deberá anotar el identificador de la divisa decotización del subyacente o cheapest to deliverconforme al "Catálogo de Divisas"1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 23 | Divisa del tamaño del contrato |  | N | 2 | 0 | 224 | 225 | Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 24 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 226 | 227 | Se deberá anotar el identificador de la divisa deliquidación diaria del contrato según el "Catálogo deDivisas"1. |
| 25 | Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 228 | 233 | En caso de que el futuro tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga.  En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primerasposiciones el identificador del campo "Descripción" del"Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en laque está denominado el subyacente o el cheapest todeliver cuando aplique.  Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado4. |
| 26 | Valor a Mercado |  | N | 12 | 2 | 234 | 247 | En este campo se debe anotar el valor total a mercadode la posición que se reporta en pesos mexicanos6. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 27 | Monto expuesto |  | N | 12 | 2 | 248 | 261 | En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos2. |
| 28 | Indicador para cobertura de divisas |  | N | 1 | 0 | 262 | 262 | Se deberá anotar:  -     1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con lasAdministradoras.  -     0 en otro caso.1 |
| 29 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 263 | 362 | Se deberá anotar una breve descripción del activo.4 |
| 30 | Espacios en blanco |  | AN | 57 | 0 | 363 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_525826.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "304"**1. |
| 2 | Identificador del Instrumento del Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_527575.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 3 | ISIN | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_529428.png | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento quese reporta en caso de que exista7. |
| 4 | CUSIP O CINS | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_531281.png | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS delinstrumento que se reporta en caso de que exista8. |
| 5 | SEDOL | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_533100.png | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumentoque se reporta en caso de que exista9. |
| 6 | Ticker Bloomberg | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_534933.png | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista10. |
| 7 | Ticker Reuters | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_536766.png | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista11. |
| 8 | Fecha de Operación |  | F | 8 | 0 | 82 | 89 | En caso de reportar derivados estandarizados, se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre la opción. En caso de reportar derivados OTC, se deberá anotar la fecha de concertación de la operación3. |
| 9 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 90 | 97 | Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la opción3. |
| 10 | Tamaño del Contrato |  | N | 14 | 2 | 98 | 113 | Se deberá anotar el tamaño del contrato en valorabsoluto en la divisa en que se pacte2. |
| 11 | Número de Contratos |  | N | 14 | 0 | 114 | 127 | Se deberá anotar el número de contratos abiertos envalor absoluto1. |
| 12 | Precio o Tasa Pactada |  | N | 9 | 6 | 128 | 142 | Se deberá anotar el precio o tasa strike que se pactó en la operación2. |
| 13 | Prima Pactada |  | N | 14 | 6 | 143 | 162 | Se deberá anotar el importe de la prima que se paga oque se cobra por tener derecho de ejercer o no lascondiciones establecidas en el contrato, denominada en la divisa de liquidación de la misma2. |
| 14 | Tipo de Opción |  | N | 3 | 0 | 163 | 165 | Se deberá anotar el identificador correspondiente al tipo de opción que se reporta de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Opción"1. |
| 15 | Opción CALL/PUT |  | N | 1 | 0 | 166 | 166 | Se deberá anotar con 1 las opciones CALL y con 2 lasopciones PUT1. |
| 16 | Plazo de Referencia |  | N | 4 | 0 | 167 | 170 | En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupónestándar del bono.  En otro caso se deberá llenar con ceros1. |
| 17 | Tipo de Operación |  | N | 1 | 0 | 171 | 171 | Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición escorta1. |
| 18 | Entrega física o diferenciales |  | AN | 1 | 0 | 172 | 172 | Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D"cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega"4. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 19 | Clase de Activo |  | N | 2 | 0 | 173 | 174 | Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada"correspondiente al subyacente1. |
| 20 | Ticker Bloomberg Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 175 | 194 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver10. |
| 21 | Ticker Reuters Subyacente |  | AN | 20 | 0 | 195 | 214 | En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente.  En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver11. |
| 22 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías |  | AN | 10 | 0 | 215 | 224 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías".  En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente:  -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberáanotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso.  -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo.  En otro caso dejar vacío4. |
| 23 | Fecha de Vencimiento del Subyacente |  | F | 8 | 0 | 225 | 232 | Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista.  En otro caso indicar 190001013. |
| 24 | ID Emisor/Contraparte |  | AN | 10 | 0 | 233 | 242 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacontraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores sedeberán definir en el "Detalle 4" del formato detransmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte"4. |
| 25 | ID Bolsa de Derivados |  | AN | 10 | 0 | 243 | 252 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a laBolsa de Derivados a la que pertenece la cámara decompensación a través de la cual se llevará a cabo laliquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío.  Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4"del formato de transmisión 0331, en el campo "IDEmisor/Contraparte"4. |
| 26 | Divisa de Cotización del Subyacente |  | N | 2 | 0 | 253 | 254 | Se deberá anotar el identificador de la divisa decotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 27 | Divisa del Tamaño del Contrato |  | N | 2 | 0 | 255 | 256 | Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato conforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 28 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 257 | 258 | Se deberá anotar el identificador de la divisa deliquidación al vencimiento del contrato si se liquida pordiferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas"1. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 29 | Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada |  | AN | 6 | 0 | 259 | 264 | En caso de que la opción tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga.  En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primerasposiciones el identificador del campo "Descripción" del"Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en laque está denominado el subyacente o el cheapest todeliver cuando aplique.  Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado4. |
| 30 | Valor a Mercado |  | N | 12 | 2 | 265 | 278 | En este campo se debe anotar el valor total a mercadode la posición que se reporta en pesos mexicanos6. |
| 31 | Monto expuesto |  | N | 12 | 2 | 279 | 292 | En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos2. |
| 32 | Delta |  | N | 3 | 8 | 293 | 303 | Se deberá reportar la delta de la opción y con la cual se lleva a cabo el cálculo de la Exposición Delta2. |
| 33 | Indicador para cobertura de divisas |  | N | 1 | 0 | 304 | 304 | Se deberá anotar:  -     1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con lasAdministradoras.  -     0 en otro caso.1 |
| 34 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 305 | 404 | Se deberá anotar una breve descripción del activo.4 |
| 35 | Espacios vacíos |  | AN | 15 | 0 | 405 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 5:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro |  | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "305"**1. |
| 2 | Identificador del Instrumento del Mandato | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_567049.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 3 | ISIN |  | AN | 12 | 0 | 14 | 25 | Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento quese reporta en caso de que exista7. |
| 4 | CUSIP O CINS |  | AN | 9 | 0 | 26 | 34 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS delinstrumento que se reporta en caso de que exista8. |
| 5 | SEDOL |  | AN | 7 | 0 | 35 | 41 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumentoque se reporta en caso de que exista9. |
| 6 | Ticker Bloomberg |  | AN | 20 | 0 | 42 | 61 | Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista10. |
| 7 | Ticker Reuters |  | AN | 20 | 0 | 62 | 81 | Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna alinstrumento que se reporta en caso de que exista11. |
| 8 | Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Entregar |  | AN | 20 | 0 | 82 | 101 | Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker queasigna Bloomberg al activo o indicador al cuál estánasociados los flujos a entregar en el swap si estos sonvariables10. |
| 9 | Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Entregar |  | AN | 20 | 0 | 102 | 121 | Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker queasigna Reuters al activo o indicador al cuál estánasociados los flujos a entregar en el swap si estos sonvariables11. |
| 10 | Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Recibir |  | AN | 20 | 0 | 122 | 141 | Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker queasigna Bloomberg al activo o indicador al cuál estánasociados los flujos a recibir en el swap si estos sonvariables10. |

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 11 | Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Recibir |  | AN | 20 | 0 | 142 | 161 | Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker queasigna Reuters al activo o indicador al cuál estánasociados los flujos a recibir en el swap si estos sonvariables11. |
| 12 | Fecha de Operación |  | F | 8 | 0 | 162 | 169 | En caso de reportar derivados estandarizados, sedeberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el swap. En caso de reportar derivados OTC, se deberá anotar la fecha de concertación de la operación3. |
| 13 | Fecha de Vencimiento Flujos a Entregar |  | F | 8 | 0 | 170 | 177 | Anotar la fecha en que finalizan los flujos a entregar en el swap3. |
| 14 | Fecha de Vencimiento Flujos a Recibir |  | F | 8 | 0 | 178 | 185 | Anotar la fecha en que finalizan los flujos a recibir en el swap3. |
| 15 | Valor Nocional Flujos a Entregar |  | N | 12 | 2 | 186 | 199 | Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a entregar en el swap en la divisa en la que se pacte2. |
| 16 | Valor Nocional Flujos a Recibir |  | N | 12 | 2 | 200 | 213 | Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a recibir en el swap en la divisa en la que se pacte2. |
| 17 | Plazo de flujos a entregar |  | N | 3 | 0 | 214 | 216 | Anotar el plazo en días de los flujos a entregar1. |
| 18 | Plazo de flujos a recibir |  | N | 3 | 0 | 217 | 219 | Anotar el plazo en días de los flujos a recibir1. |
| 19 | Intercambio de Nocionales a Vencimiento |  | N | 1 | 0 | 220 | 220 | Anotar 1 si se pacta entrega de nocionales alvencimiento de la operación.  Anotar cero en otro caso1. |
| 20 | Tipo de flujos a Entregar |  | N | 1 | 0 | 221 | 221 | En caso de que la estructura de flujos a entregar seauna estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. Encaso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 11. |
| 21 | Tipo de flujos a Recibir |  | N | 1 | 0 | 222 | 222 | En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 11. |
| 22 | Tipo de cambio pactado |  | N | 12 | 6 | 223 | 240 | Se deberá anotar el tipo de cambio que se pactó para el caso de swaps con nocionales en distinta divisa.  En otro caso llenar con ceros2. |
| 23 | Tasa de Flujos a Entregar |  | N | 3 | 4 | 241 | 247 | En caso de que la estructura de flujos a entregar seauna estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valorde la tasa pactada.  En otro caso llenar con ceros2. |
| 24 | Tasa de Flujos a Recibir |  | N | 3 | 4 | 248 | 254 | En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada.  En otro caso llenar con ceros2. |
| 25 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Entregar |  | AN | 10 | 0 | 255 | 264 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías"  En caso de que los flujos a entregar estén ligados aalgún subyacente de Renta Variable o Mercancía, sedeberá reportar el indicador asociado a dichosubyacente.  En otro caso dejar vacío4. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 26 | ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Recibir |  | AN | 10 | 0 | 265 | 274 | Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías"  En caso de que los flujos a recibir estén ligados a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente.  En otro caso dejar vacío4. |
| 27 | ID Emisor/Contraparte |  | AN | 10 | 0 | 275 | 284 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacontraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores sedeberán definir en el "Detalle 4" del formato detransmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte"4. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 28 | ID Bolsa de Derivados |  | AN | 10 | 0 | 285 | 294 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a laBolsa de Derivados a la que pertenece la cámara decompensación a través de la cual se llevará a cabo laliquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío.  Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4"del formato de transmisión 0331, en el campo "IDEmisor/Contraparte"4. |
| 29 | Divisa flujos a entregar |  | N | 2 | 0 | 295 | 296 | Se deberá anotar el identificador de la divisa en la queestén denominados los flujos a entregar conforme al"Catálogo de Divisas"1. |
| 30 | Divisa flujos a recibir |  | N | 2 | 0 | 297 | 298 | Se deberá anotar el identificador de la divisa en la queestén denominados los flujos a recibir conforme al"Catálogo de Divisa"1. |
| 31 | Divisa nocional a entregar |  | N | 2 | 0 | 299 | 300 | Se deberá anotar el identificador de la divisa en la queesté denominado el nocional de los flujos a entregarconforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 32 | Divisa nocional a recibir |  | N | 2 | 0 | 301 | 302 | Se deberá anotar el identificador de la divisa en la queesté denominado el nocional de los flujos a recibirconforme al "Catálogo de Divisas"1. |
| 33 | Divisa de Liquidación |  | N | 2 | 0 | 303 | 304 | Se deberá reportar el identificador de la divisa de con la que se estarán liquidando los flujos, según el "Catálogo de Divisas"1. |
| 34 | Valor a mercado. |  | N | 12 | 2 | 305 | 318 | En este campo se debe anotar el valor total a mercado la posición que se reporta en pesos mexicanos6. |
| 35 | Indicador para cobertura de divisas. |  | N | 1 | 0 | 319 | 319 | Se deberá anotar:  -     1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con lasAdministradoras.  -     0 en otro caso.1 |
| 36 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 320 | 419 | Se deberá anotar una breve descripción del activo.4 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 6:**CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LASGARANTÍAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTO, PRESTAMO DE VALORES E INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_602383.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "306"**1**.** |
| 2 | Tipo de Operación asociada a la Garantía. | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_604132.png | N | 1 | 0 | 4 | 4 | Se deberá anotar el tipo de operación que origino larecepción de las Garantías según el catálogo de "Tipo de Operación asociada a la Garantía"1. |
| 3 | Identificador de posición de Garantía Recibida | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_605985.png | AN | 10 | 0 | 5 | 14 | Se reportará un identificador el cual deberá ser únicopara cada garantía de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo4. |
| 4 | Identificador de operación del Mandato asociado a la garantía |  | AN | 10 | 0 | 15 | 24 | En caso de que la garantía se reciba por una operación de préstamo de valor o reporto, se deberá anotar el "Identificador del Instrumento del Mandato" que se reporta en el "Detalle 1" del presente formatocorrespondiente a la operación a la que se asocia lagarantía4. |
| 5 | ISIN |  | AN | 12 | 0 | 25 | 36 | Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento quese recibe como garantía7. |
| 6 | CUSIP O CINS |  | AN | 9 | 0 | 37 | 45 | Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS delinstrumento que se recibe como garantía8. |
| 7 | SEDOL |  | AN | 7 | 0 | 46 | 52 | Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumentoque se recibe como garantía9. |
| 8 | Ticker Bloomberg |  | AN | 20 | 0 | 53 | 72 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg alinstrumento que se recibe en garantía10. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 9 | Ticker Reuters |  | AN | 20 | 0 | 73 | 92 | Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters alinstrumento que se recibe en garantía11. |
| 10 | Clase de Activo |  | N | 2 | 0 | 93 | 94 | Se deberá anotar el identificador de la clase del activorecibido en garantía según el "Catálogo de Clase deActivo de la inversión tercerizada"1. |
| 11 | Cantidad de Títulos |  | N | 12 | 0 | 95 | 106 | Se deberá reportar el número de títulos recibidos engarantía1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 12 | Precio limpio |  | N | 12 | 2 | 107 | 120 | En este campo se debe anotar el valor total a mercadode las garantías reportadas a precio y en pesosmexicanos2. |
| 13 | Intereses devengados |  | N | 12 | 2 | 121 | 134 | En este campo se deberán anotar los interesesdevengados de las garantías reportadas en pesosmexicanos2. |
| 14 | ID Emisor/Contraparte |  | AN | 10 | 0 | 135 | 144 | Se deberá anotar el identificador correspondiente a lacontraparte de la cual se reciben las garantías.  Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4"del formato de transmisión 0331, en el campo "IDEmisor/Contraparte"4. |
| 15 | Divisa de Cotización |  | N | 2 | 0 | 145 | 146 | Se deberá anotar el identificador de la divisa decotización del activo recibido en garantía según el"Catálogo de Divisas"1. |
| 16 | Valor Nominal |  | N | 8 | 2 | 147 | 156 | En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar el Valor Nominal en la Divisa de Cotización del instrumento.  En otro caso llenar con ceros2. |
| 17 | Fecha de Vencimiento |  | F | 8 | 0 | 157 | 164 | En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de vencimiento del instrumento que se reporta.  En otro caso anotar 190001013. |
| 18 | Fecha de Emisión |  | F | 8 | 0 | 165 | 172 | En caso de estar reportando instrumentos de deuda oestructuras vinculadas a subyacentes recibidos engarantía, se deberá anotar la fecha de emisión delinstrumento que se reporta.  En otro caso indicar 190001013. |
| 19 | Descriptivo |  | AN | 100 | 0 | 173 | 272 | Se deberá anotar una breve descripción del activo.4 |
| 20 | Espacios vacíos |  | AN | 147 | 0 | 273 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 7:**DEPÓSITOS EN INSTITUCIONES FINANCIERAS Y APORTACIONES INICIALES MINIMAS Y EXCEDENTES PARA OPERACIONES CON DERIVADOS LISTADOS. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_625884.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "307"**1. |
| 2 | ID Emisor/Contraparte | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_627633.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | En caso de reportar depósitos en institucionesfinancieras se deberá anotar el identificadorcorrespondiente a la Institución Financiera con la cual se realiza el depósito.  En caso de reportar aportaciones iniciales mínimas yexcedentes para operaciones con derivados listados, se deberá anotar el identificador correspondiente a la bolsa de derivados en cuya cámara de compensación se están realizando las aportaciones mínimas y excedentes.  Estos identificadores se deberán agregar en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID Emisor/Contraparte"4. |
| 3 | Divisa | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_629486.png | AN | 2 | 0 | 14 | 15 | Se reportará el identificador de la divisa en la cual estádenominado el depósito o la aportación según el"Catálogo de Divisas"1. |
| 4 | Monto en divisa | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_631339.png | N | 12 | 2 | 16 | 29 | Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa en la que se encuentre denominado2. |
| 5 | Monto | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_633158.png | N | 12 | 2 | 30 | 43 | Se deberá anotar el valor en pesos mexicanos deldepósito o aportación6. |
| 6 | Espacios vacíos |  | AN | 376 | 0 | 44 | 419 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 8:**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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_638439.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "308"**1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Divisa del Flujo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_640188.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá anotar el identificador de la divisa en la quese liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas"1. |
| 3 | Tipo de Operación |  | N | 1 | 0 | 6 | 6 | Anotar 1 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de entrada (Flujo positivo).  Anotar 2 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de salida (Flujo negativo)1. |
| 4 | Monto por liquidar |  | N | 12 | 2 | 7 | 20 | Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netostotales, para la divisa reportada en el campo 2 delpresente detalle, que estén pendientes por liquidar y en pesos mexicanos6. |
| 5 | Espacios vacíos |  | AN | 399 | 0 | 21 | 419 | Vacíos5. |

|  |
| --- |
| **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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave de Tipo** **de Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave Subtipo** **de Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo Aviso de Recomposición** | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** |
| 0 | Sin recomposición. |
| 1 | Se conserva el instrumento. |
| 2 | Se venderá el instrumento. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Clase de Inversión Tercerizada** | |  | **Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada** | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** |  |
| 0 | No Aplica |  | 0 | Otro. |
| 1 | Mercancías |  | 1 | Mercancías. |
| 2 | Renta Variable |  | 2 | Renta Variable. |
| 3 | Deuda Extranjera |  | 3 | Deuda Extranjera. |
| 4 | Tipos de Cambio |  | 4 | Tipos de Cambio. |
| 9 | Mixto |  | 5 | Con exposición a más de una clase de inversión. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Standard & Poor's. |
| 4 | Fitch. |

|  |  |
| --- | --- |
| 5 | Moody's. |
| 6 | HR Ratings |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Entrega** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| F | Físico. |
| D | Diferenciales. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Inversión** | | |
| **Id** | **Abreviación** | **Descripción** |
| 0 | Di | Directo |
| 1 | Re | Reporto |
| 6 | Pv | Préstamo de Valores |
| 7 | Gd | Garantías Entregadas |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Divisas** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | MXP |
| 2 | USD |
| 3 | UDI |
| 6 | JPY |
| 7 | EUR |
| 8 | AUD |
| 9 | CAD |
| 10 | CHF |
| 11 | GBP |
| 12 | HKD |
| 13 | DKK |
| 14 | SEK |
| 15 | NOK |
| 16 | BRL |
| 17 | ILS |
| 18 | CLP |
| 19 | INR |
| 20 | CNY |
| 21 | PLN |
| 22 | CZK |
| 23 | HUF |
| 24 | RON |
| 25 | LVL |
| 26 | LTL |
| 27 | EEK |
| 28 | BGN |
| 29 | ISK |
| 30 | COP |
| 31 | KRW |
| 32 | PEN |
| 33 | SGD |
| 99 | OTR |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Tipo de Operación asociada a la Garantía** | |  | **Catálogo de Tipo de Opción** | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Identificador** | **Identificador** |
| 1 | Reportos |  | 1 | Americana | AM |
| 2 | Préstamo de Valores |  | 2 | Europea | EU |
| 3 | Instrumentos Financieros Derivados |  | 100 | Otros | OT |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | |
| **Fitch** | **Moody's** | **Standard & Poor's** | **HR Ratings** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) | 1047 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| C | C | C | HR C- (G) | 1048 |
| D |  | D | HR D (G) | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) | 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 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.

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.

Para el caso de derivados que se liquiden mediante una cámara de compensación de manera diaria, se deberá reportar el valor de liquidación diaria.

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

**http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_702456.png**

**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.

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, 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, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

9 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.

10 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.

11 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** |

**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 envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal:

       https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/

II.     Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios.

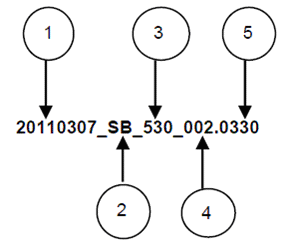
III.    El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **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 a nombre de quien se transmite la información, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidades anexo al documento. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores deAportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores dePrevisión Social a nombre de quien se transmite la información conforme al catálogo deentidades anexo al documento |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta lainformación (\*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 = "0330"**. |

**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 dos, 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:

**20100302\_EO\_001\_000.0515.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:

**A20110307\_SB\_530\_002.0330**

IV.   Las rutas de envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por medio del portal:

       https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/

**Anexo 112**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene los catálogos de información para la identificación de atributos de las posiciones de los mandatos reportados en el formato 0330 | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| SEMANAL | Desde el último día hábil de la semana anterior hasta el primer día hábil de la semana en curso. | 103 | 17:00 Hrs. del último día hábil  de la semana previa hasta las 10:00 Hrs. del primer día hábil de la semana en curso. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_745242.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 encabezado1. |
| 3 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Número de caracteres por registro = Constante "103"1. |
| 4 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_748779.png | N | 4 | 0 | 17 | 20 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante "0331"**1. |
| 5 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_750514.png | N | 3 | 0 | 21 | 23 | Clave del Tipo de Entidad Siefore de acuerdo al"Catálogo de Tipos de Entidades" anexo1. |
| 6 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_752249.png | N | 3 | 0 | 24 | 26 | Clave de Entidad Siefore a nombre de quien se reporta la Información de acuerdo al "Catálogo de Entidades Siefores", anexos1. |
| 7 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_753984.png | N | 3 | 0 | 27 | 29 | Clave del Subtipo de Entidad de quien se reporta laInformación de acuerdo al "Catálogo de Subtipos deEntidades Siefores", anexos1. |
| 8 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_755719.png | F | 8 | 0 | 30 | 37 | Fecha de operación que se reporta3. |
| 9 | Espacios en blanco |  | AN | 66 | 0 | 38 | 103 | Vacíos5. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_760814.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "101"**1. |
| 2 | Identificador Mandatario | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_762563.png | AN | 7 | 0 | 4 | 10 | Se deberá reportar el nombre descriptivo del Mandatario definido por la Administradora. Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Emisora" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 3 | Consecutivo Mandato |  | AN | 7 | 0 | 11 | 17 | Deberá ser un consecutivo definido por laAdministradora el cual se incrementará para cadamandato contratado con un mismo mandatario. Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Serie" reportado por la Siefore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 4 | Clase de Inversión tercerizada |  | AN | 10 | 0 | 18 | 27 | Se deberá reportar el indicador de clase de activo sobre el que operará el mandato según el catálogo "Clase de Inversión Tercerizada". Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Consecutivo" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3"4. |
| 5 | País del Mandatario |  | N | 2 | 0 | 28 | 29 | Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países1. |
| 6 | Fecha de Concertación del Mandato |  | F | 8 | 0 | 30 | 37 | Se deberá reportar la fecha en que se pactó elmandato3. |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 66 | 0 | 38 | 103 | Vacíos5. |

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

En las Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión de las Siefores y las disposiciones de carácter general en materia financiera se presentan las metodologías requeridas para elaborar cálculos de exposición a Renta Variable y de exposición a Mercancías. En ellas se establece que para obtener la exposición total de un portafolio se deben compensar las exposiciones individuales cortas y largas sobre cada acción o mercancía a la cuál se tiene exposición de manera individual. Derivado de esto, la exposición delta de todas aquellas posiciones de derivados sobre índices o sobre vehículos que replicaníndices, así como las posiciones en directo de vehículos que replican índices, deberán ser segregadas en todas las acciones y mercancías que componen a los índices que funcionan como subyacentes o como objeto de réplica para vehículos. Es por esto que se diseñaron dos Detalles Catálogo con la información necesaria para poder realizar esta compensación de exposiciones.

El "Detalle 1" contiene las acciones y mercancías sobre las cuales el mandato tiene exposición ya sea a través de posiciones en directo o derivados, e independientemente de si la exposición se toma de manera directa a través de inversiones sobre estos elementos, o de manera indirecta a través de inversiones en índices que los contengan. Contiene también a todos los índices sobre los cuáles el mandato tiene exposición a través de posiciones en directo sobre vehículos que los replican o a través de derivados sobre los índices o sobre los vehículos que los replican.

Al interior de este detalle catálogo cada uno de estos elementos deberá ser definido de manera única a través de la asignación de un identificador único "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías", de tal manera que no será necesario integrar más que una sola vez a una determinada acción independientemente de si la exposición a la misma se toma, de manera simultánea, a través de posiciones en directo en la acción y a través de uno o varios índices y/o vehículos que replican índices que la contengan dentro de su composición.

En segundo lugar, se encuentra el "Detalle 2" en donde se tendrán que dar las reglas de asociación entre todos los índices sobre los cuales el mandato tiene exposición y las acciones o mercancías que los componen así como los pesos o ponderaciones de cada uno de estos elementos en la composición de cada Índice.

Finalmente el "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" deberá ser usado en el formato de transmisión 0330 a lo largo de los Detalles 1 a 5 en caso de que las posiciones del mandato ahí reportadas abran exposición a Renta Variable o Mercancías como sigue:

·   Para posiciones en directo sobre acciones o instrumentos derivados cuyo subyacente sea la acción, se deberá reportar el "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" de la acción contenido en el catálogo del "Detalle 1" del presente formato.

·   Para posiciones en directo sobre vehículos que replican índices, en derivados cuyos subyacentes sean índices, o en derivados cuyos subyacentes son vehículos que replican índices, se deberá reportar el "ID

elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" del índice contenido en el catálogo del "Detalle 1" del presente formato.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO CORRESPONDIENTE A TODOS LOS ELEMENTOS DE RENTA VARIABLE O MERCANCÍAS (ACCIONES, MERCANCIAS E ÍNDICES) QUE SERÁN REQUERIDOS EN LOS DETALLES 1 A 5 DEL FORMATO DE TRANSMISIÓN 0330 ASÍ COMO EN EL DETALLE 2 DEL PRESENTE FORMATO. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_772781.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301"**1. |
| 2 | ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_774530.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador único para cadanuevo elemento de Renta Variable o Mercancías, esteidentificador deberá ser generado para cada nuevoelemento que se integre a este catálogo debido a:  -Que alguna posición del mandato esté tomandoexposición al elemento y se requiera del identificadorpara incluirse en los Detalles 1 a 5 del formato deinformación 0330 en el campo "ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías".  -Que alguna posición del mandato esté tomandoexposición a algún índice que contenga a este elemento y se requiera el identificador para el "Detalle 2" del presente formato de transmisión en el campo "ID acciones o mercancías" para descomponer a dicho índice.  -Que exista alguna recomposición en cualquiera de los índices a los que se tenga exposición y se incorporen acciones que no existan en el catálogo.  Este identificador no podrá ser reutilizado y una vez que se envíe algún elemento por primera vez tendrá que reportarse permanentemente4. |
| 3 | Nombre Descriptivo |  | AN | 50 |  | 14 | 63 | Indicar el nombre descriptivo del elemento de RentaVariable o Mercancía que se esté reportando dentro del catálogo4. |
| 4 | Ticker de Bloomberg del Componente de Renta Variable o Mercancía. |  | AN | 20 | 0 | 64 | 83 | Se deberá reportar el ticker que Bloomberg asigna alelemento de Renta Variable o Mercancía de que setrate6. |
| 5 | Ticker de Reuters del Componente de Renta Variable o Mercancía. |  | AN | 20 | 0 | 84 | 103 | Se deberá reportar el ticker que Reuters asigna alelemento de Renta Variable o Mercancía de que setrate7. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LA DESCOMPOSICION DE INDICES. Todos los índices reportados en el "Detalle 1" deben contar con una descomposición en todas las acciones que lo componen. (Este catálogo tiene dependencia con el Detalle 1) | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_781835.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "302"**1. |
| 2 | ID índice | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_783584.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá anotar el identificador "ID elemento deexposición a Renta Variable o Mercancías" para cadaíndice contenido en el "Detalle 1" del presente formato de transmisión4. |
| 3 | ID acciones o mercancías. | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_785437.png | AN | 10 | 0 | 14 | 23 | Se deberá anotar el identificador "ID elemento deexposición a Renta Variable o Mercancías" reportado en el "Detalle 1" del presente formato, correspondiente a cada una de las acciones que componen al índicereportado en el campo anterior4. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 4 | Peso del componente en el Índice. |  | N | 3 | 6 | 24 | 32 | En este campo se deberá anotar el ponderador enpuntos porcentuales que el componente reportado en el campo 3 "ID acciones" del presente Detalle, tiene dentro de la composición del Índice reportado en el campo 2 "ID índice" al cierre de la fecha de envío de información2. |
| 5 | Espacios vacíos |  | AN | 71 | 0 | 33 | 103 | Vacíos5. |

Otro par de medidas relevantes, además de la exposición a Renta Variable o a Mercancías que exige la agregación de posiciones y que están contenidas en las Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión de las Siefores son la concentración de inversiones por Emisor/Contraparte y la concentración de inversiones correspondientes a Entidades Relacionadas entre Sí.

Para el cómputo de la primera medida se deben considerar los instrumentos de deuda, así como las operaciones de reporto, préstamo de valores y las operaciones con derivados en donde una misma entidad funja como emisor en el caso de los instrumentos de deuda o contraparte para el resto de las operaciones. Derivado del tipo de agregación necesario para este límite, se diseñó el "Detalle 4", en donde se deberá reportar información de cada una de las entidades que funjan como emisor y/o contraparte para cada una de los instrumentos y operaciones antes mencionados y que formen parte del portafolio de inversión de cada mandato, además de las entidades que desempeñen el papel de compañía emisora de acciones, patrocinadoras de vehículos y bolsas de derivados. Al interior de este Detalle Catálogo se definirá cada una de las entidades que funjan como emisores, contrapartes, patrocinadores de vehículos y bolsas de derivados de manera única a través de la asignación de un identificador único en el campo "ID Emisor/Contraparte", de tal manera que no será necesario integrar más que una sola vez cada una de las entidades independientemente de la cantidad de posiciones asociadas a ella reportadas en los Detalles 1 a 5 en elformato 0330. Se deberá reportar este identificador único en los campos denominados "ID Emisor/Contraparte" en cada uno de los Detalles 1 a 5 del formato 0330 con la finalidad de asociar a cada posición la entidad definida en el "Detalle 4" del presente formato y que funja como emisor, contraparte, bolsa de derivados o patrocinador del vehículo.

Para el cómputo de la segunda medida, y ya habiendo asociado las posiciones a sus respectivas entidades legales, es necesario asociar las distintas entidades definidas en el "Detalle 4" del presente formato con aquellas con las que tienen algún tipo de relación por sus nexos patrimoniales o de responsabilidad, o porque la situación financiera de una o varias de ellas pueda influir en forma decisiva en la de las demás, o porque la administración de dichas entidades dependa directa o indirectamente de una persona. Para este fin se diseñó el "Detalle 3" a través del cual se hace una asociación de las entidades reportadas en el "Detalle 4", para formar conjuntos de entidades que guarden algún tipo de relación como las mencionadas previamente a manera de grupos. Cabe resaltar que no será necesario generar un registro en el "Detalle 3" para aquellas entidades del "Detalle 4" que no tengan ningún tipo de relación con otras entidades.

Estas entidades agrupadoras deberán ser definidas de manera única a través de la asignación de un identificador único llamado "ID Relación de Entidades". Será por medio de este identificador y el campo homónimo previsto en el "Detalle 4", de nombre "ID Relación de Entidades", que se establecerán las reglas de asociación entre las entidades emisoras, contrapartes, patrocinadoras de vehículos y bolsas de derivados con las entidades agrupadoras contenidas en el "Detalle 3".

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO DE RELACIÓN DE ENTIDADES. Al interior de este detalle se deberá reportar la identificación de las compañías matriz, holding, o grupos empresariales necesarios para agrupar a los emisores o contrapartes reportados en el "Detalle 4" del presente formato, y que se encuentren relacionadas por sus nexos patrimoniales o de responsabilidad, porque la situación financiera de una o varias de ellas pueda influir en forma decisiva en la de las demás, o porque la administración de dichas personas morales dependa directa o indirectamente de una persona. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_791717.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "303"**1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | ID Relación de Entidades | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_793466.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador único para cadaEntidad agrupadora reportada en el presente detalle yque no podrá ser reutilizado4. |
| 3 | Nombre |  | AN | 50 | 0 | 14 | 63 | Indicar el nombre descriptivo de la entidad grupo querelacionará a los emisores de instrumentos en posición de los mandatarios, contrapartes con los que los mandatarios tengan concertadas operaciones dereporto, de valores en préstamo y derivados,patrocinadores de vehículos y bolsas de derivadosprevistas en el Detalle 4 del presente formato4. |
| 4 | Espacios vacíos |  | AN | 40 | 0 | 64 | 103 | Vacíos5. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 4:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHÍCULOS Y BOLSAS DE DERIVADOS. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_799766.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "304"**1. |
| 2 | ID Emisor/Contraparte | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_801515.png | AN | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador único para cadaemisor, bolsa de derivados o contraparte, de los valores y operaciones reportados en el formato de transmisión 0330 y que no podrá ser reutilizado4. |
| 3 | Nombre |  | AN | 20 | 0 | 14 | 33 | Indicar el nombre descriptivo del emisor, bolsa dederivados o contraparte reportado4. |
| 4 | ID Relación de Entidades |  | AN | 10 | 0 | 34 | 43 | Se deberá reportar el identificador de relación deentidades reportado en el "Detalle 3" en caso de queaplique, con el cual se relaciona a la entidad reportadaen el Id 2 del presente detalle con los demás emisores y contrapartes pertenecientes al mismo grupo o compañía matriz. En otro caso llenar con espacios en blanco4. |
| 5 | Primera Calificación CP |  | N | 4 | 0 | 44 | 47 | Se deberá reportar el identificador del "Catálogo deCalificaciones Homologadas" correspondiente a lacalificación crediticia de corto plazo más baja emitida por alguna agencia calificadora listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión1. |
| 6 | Segunda Calificación CP |  | N | 4 | 0 | 48 | 51 | Se deberá reportar el identificador del "Catálogo deCalificaciones Homologadas" correspondiente a lasegunda calificación crediticia de corto plazo más bajaemitida por alguna agencia calificadora listada en elcatálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 7 | Primera Calificadora CP |  | N | 2 | 0 | 52 | 53 | Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras"1. |
| 8 | Segunda calificadora CP |  | N | 2 | 0 | 54 | 55 | Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras"1. |
| 9 | Primera Calificación LP |  | N | 4 | 0 | 56 | 59 | Se deberá reportar el identificador del "Catálogo deCalificaciones Homologadas" correspondiente a lacalificación crediticia de largo plazo más baja emitida por alguna agencia calificadora listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión1. |
| 10 | Segunda Calificación LP |  | N | 4 | 0 | 60 | 63 | Se deberá reportar el identificador del "Catálogo deCalificaciones Homologadas" correspondiente a lasegunda calificación crediticia de largo plazo más bajaemitida por alguna agencia calificadora listada en elcatálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión1. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 11 | Primera Calificadora LP |  | N | 2 | 0 | 64 | 65 | Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras"1. |
| 12 | Segunda calificadora LP |  | N | 2 | 0 | 66 | 67 | Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras"1. |
| 13 | Espacios vacíos |  | AN | 36 | 0 | 68 | 103 | Vacíos5. |

|  |
| --- |
| **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 | | BANAMEX |
| 544 | SURA | |  | 630 | | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA | |  |  | |  |
| 552 | BANAMEX | |  |  | |  |
| 556 | AZTECA | |  |  | |  |
| 562 | INVERCAP | |  |  | |  |
| 564 | METLIFE | |  |  | |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Clase de Inversión Tercerizada** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 0 | No aplica. |
| 1 | Mercancías. |
| 2 | Renta Variable. |
| 3 | Deuda Extranjera |
| 4 | Tipos de Cambio. |
| 9 | Mixto. |

|  |
| --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Clave de Tipo** **de Entidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Agencias Calificadoras.** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Standard & Poor's. |
| 4 | Fitch Ratings. |
| 5 | Moody's. |
| 6 | HR Ratings. |
| 7 | Verum. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Países** | | | | |
| **Identificador** | **Descripción** |  | **Identificador** | **Descripción** |
| 1 | Alemania |  | 24 | Eslovaquia |
| 2 | Australia |  | 25 | Eslovenia |
| 3 | Austria |  | 26 | Estonia |
| 4 | Bélgica |  | 27 | Hungría |
| 5 | Canadá |  | 28 | Letonia |
| 6 | Dinamarca |  | 29 | Lituania |
| 7 | España |  | 30 | Malta |
| 8 | Estados Unidos de Norteamérica |  | 31 | República Checa |
| 9 | Finlandia |  | 32 | Suecia |
| 10 | Francia |  | 33 | Brasil |
| 11 | Grecia |  | 34 | China |
| 12 | Países Bajos (Holanda) |  | 35 | India |
| 13 | Hong Kong |  | 36 | Otro |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 14 | Irlanda |  | 37 | Rumanía |
| 15 | Italia |  | 38 | Noruega |
| 16 | Japón |  | 39 | Chile |
| 17 | Luxemburgo |  | 40 | Israel |
| 18 | México |  | 41 | Bulgaria |
| 19 | Polonia |  | 42 | Colombia |
| 20 | Portugal |  | 43 | Corea del Sur |
| 21 | Reino Unido de la Gran Bretaña |  | 44 | Islandia |
| 22 | Suiza |  | 45 | Perú |
| 23 | Chipre |  | 46 | Singapur |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Calificaciones Homologadas** | | | | |
| **Fitch** | **Moody's** | **Standard & Poor's** | **HR Ratings** | **Identificador** |
| **Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global** | | | | |
| AAA | Aaa | AAA | HR AAA (G) | 1028 |
| AA+ | Aa1 | AA+ | HR AA+ (G) | 1029 |
| AA | Aa2 | AA | HR AA (G) | 1030 |
| AA- | Aa3 | AA- | HR AA- (G) | 1031 |
| A+ | A1 | A+ | HR A+ (G) | 1032 |
| A | A2 | A | HR A (G) | 1033 |
| A- | A3 | A- | HR A- (G) | 1034 |
| BBB+ | Baa1 | BBB+ | HR BBB+ (G) | 1035 |
| BBB | Baa2 | BBB | HR BBB (G) | 1036 |
| BBB- | Baa3 | BBB- | HR BBB- (G) | 1037 |
| BB+ | Ba1 | BB+ | HR BB+ (G) | 1038 |
| BB | Ba2 | BB | HR BB (G) | 1039 |
| BB- | Ba3 | BB- | HR BB- (G) | 1040 |
| B+ | B1 | B+ | HR B+ (G) | 1041 |
| B | B2 | B | HR B (G) | 1042 |
| B- | B3 | B- | HR B- (G) | 1043 |
| CCC+ | Caa1 | CCC+ | HR C+ (G) | 1044 |
| CCC | Caa2 | CCC |  | 1045 |
| CCC- | Caa3 | CCC- |  | 1046 |
| CC | Ca | CC | HR C (G) | 1047 |
| C | C | C | HR C- (G) | 1048 |
| D | - | D | HR D (G) | 1049 |
| **Calificaciones Corto Plazo en Escala Global** | | | | |
| F1+ | P-1 | A-1+ | HR+1 (G) | 1050 |
| F1 |  | A-1 | HR1 (G) | 1051 |
| F2 | P-2 | A-2 | HR2 (G) | 1052 |
| F3 | P-3 | A-3 | HR3 (G) | 1053 |
| B |  |  | HR4 (G) | 1054 |
| C |  |  | HR5 (G) | 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, se deberán reportar estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

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 El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda.

7 El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar 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 envió de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal:

       https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/

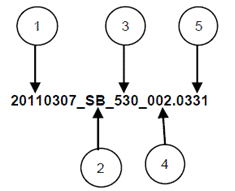
II.     Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios en nombre de las Siefores.

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 enformato "AAAAMMDD". |
| 2 | 2 Dígitos Alfanuméricos | Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad a nombre de quien se 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 AportacionesVoluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social a nombre de quien se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta (\*Solo aplicarápara familia de SIEFORES). |
| 5 | 4 Dígitos Numéricos | Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tieneestipulado un número, para este caso será **Constante = "0331"**. |

**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 dos, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



       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:

**A20110307\_SB\_530\_002.0331**

IV.   Las rutas de envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por medio del portal:

       https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/

**Anexo 120**

****

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| Este archivo contiene información de la composición de género en números absolutos del total de personas integrantes en el Consejo deAdministración, del Director(a) General, de los funcionarios de los dos niveles inmediatos siguientes y de sus comisarios, de la integración de los Comités de Inversión y de Riesgos, así como del Contralor Normativo. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| Semestral | 2do día hábil posterior al semestre que reporta | 255 | 07:00 a 19:00 Hrs. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_903730.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro = **Constante "000".**1 |
| 2 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_904854.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Identificador de archivo = **Constante "0405".**1 |
| 3 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_905978.png | N | 3 | 0 | 8 | 10 | Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información, deacuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades delCatálogo General Apartado Circular 19, **Constante ="001"**.1 |
| 4 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_907102.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_908226.png | F | 8 | 0 | 14 | 21 | Fecha de la información que se reporta.3 |
| 6 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 22 | 24 | Número de caracteres por registro = **Constante** **"255"**.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 | 226 | 0 | 30 | 255 | Vacíos.6 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:**En este apartado, se deberá reportar la información relativa al género de los integrantes de su Consejo de Administración, del Director o Directora General, de los funcionarios y funcionarias de los dos niveles inmediatos siguientes y de sus comisarios, así como de las y los integrantes de los Comités de Inversión y de Riesgos y finalmente del Contralor o Contralora Normativo(a). | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_912897.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante"301".**1 |
| 2 | Área | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_914021.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá reportar la Clave de Área a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Áreas.1 |
| 3 | Género | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_915145.png | N | 2 | 0 | 6 | 7 | Se deberá reportar la clave que identifica el género defuncionarias o funcionarios de acuerdo al catálogo degénero.1 |
| 4 | Número de Funcionarios |  | N | 8 | 0 | 8 | 15 | Se deberá reportar el dato numérico, por separado, de las Funcionarias y de Funcionarios que se reportan.1 |
| 5 | Espacios en Blanco |  | AN | 240 | 0 | 16 | 255 | Vacíos.6 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 2:**Deberá indicar si la Administradora cuenta con alguna política o programa que impulse la inclusión laboral sin distinción de sexo en la composición de sus órganos de gobierno y entre sus empleados. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
|  | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_919321.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante"302".**1 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Cuenta con Política/ Programa |  | N | 1 | 0 | 4 | 4 | La Administradora deberá de indicar si cuenta con alguna política o programa que impulse la inclusión laboral sin distinción de sexo en la composición de sus órganos de gobierno y entre sus empleados, deberá asignar 1 = Sí o 0 = No1 |
| 3 | Descripción de Política/ Programa |  | AN | 251 | 0 | 5 | 255 | Si reporto que cuenta con una política/programa describir brevemente esta.5 |

|  |
| --- |
| **CATÁLOGO(S)** |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Entidades (AFORES)** | |
| **Clave Tipo de Entidad** | **Descripción** |
| 530 | XXI Banorte |
| 534 | Profuturo |
| 538 | Principal |
| 544 | SURA |
| 550 | Inbursa |
| 552 | Banamex |
| 556 | Azteca |
| 562 | Invercap |
| 564 | Metlife |
| 568 | Coppel |
| 578 | PensionISSSTE |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Áreas** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Consejo de Administración |
| 02 | Consejeros Propietarios |
| 03 | Consejeros Independientes |
| 04 | Director General |
| 05 | Funcionarios de los dos niveles inmediatos siguientes al Director General |
| 06 | Comités de Inversión |
| 07 | Comités de Riesgos |
| 08 | Contralor Normativo |

|  |  |
| --- | --- |
| **Catálogo de Género** | |
| **Identificador** | **Descripción** |
| 01 | Hombres |
| 02 | Mujeres |

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

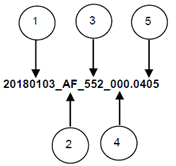
II.     La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

III.    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 del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. **Constante = "AF**". |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad (AFORES) que se reporta conforme al catálogo de Entidades anexo al documento. |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia deSIEFORES, para las demás entidades será la **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 = "0405".** |

**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 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 de la siguiente manera:

**20180103\_AF\_552\_000.0405.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:

**A20180103\_AF\_552\_000.0405**

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

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

|  |  |
| --- | --- |
| **TIPO DE ACCION** | **RUTA** |
| Envío Normal | export/home/rec/SUCUR/RECEPCION |

|  |  |
| --- | --- |
| Envío por Retransmisión | export/home/rec/SUCUR/RETRANSMISION |
| Recuperación de Acuse | export/home/rec/SUCUR/TRANSMISION |

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

**Anexo 121**

****

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| Este archivo contiene información de las certificaciones y especificaciones sobre los funcionarios que realizan actividades y labores en materia financiera dentro de las Sociedades de inversión. | | | |
| **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 20:00 Hrs. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_970675.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro = **Constante "000".**1 |
| 2 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_972452.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Identificador de archivo = **Constante "0341".**1 |
| 3 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_974229.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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_976006.png | N | 3 | 0 | 11 | 13 | Clave de Entidad que reporta la Información, deacuerdo con el Catálogo de Entidades (AFORES)anexo.1 |
| 5 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_977783.png | F | 8 | 0 | 14 | 21 | Fecha de la información 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 | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_985377.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante"101".**1 |
| 2 | ID Cargo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_987168.png | N | 10 | 0 | 4 | 13 | Se deberá reportar un identificador numérico definidopor 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 lasresponsabilidades asociadas al cargo o puesto.5 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 5 | Área | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_990873.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 - Otrasáreas de la Administradora*" en el campo "*Área*", sedeberá reportar el nombre del Área a la que pertenece el cargo o puesto.5 |
| 7 | Subárea | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_993621.png | N | 2 | 0 | 431 | 432 | Se deberá reportar la Clave de la Subárea a la quepertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo deSubáreas.1 |
| 8 | Nombre Subárea |  | AN | 80 | 0 | 433 | 512 | En caso de que se reporte el identificador "*99 - Otrassubáreas de la Administradora*" en el campo "*Subárea*", se deberá reportar el nombre del subárea a la que pertenece el cargo o puesto.5 |
| 9 | ID Cargo del cargo de quien depende |  | 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 cuando el campo con Id 10 del SUBENCABEZADO se reporte en 1. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1000112.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante "301.**1 |
| 2 | Nombre | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1001903.png | AN | 40 | 0 | 4 | 43 | Se deberá anotar el nombre del funcionario.5 |
| 3 | Apellido Paterno | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1003694.png | AN | 40 | 0 | 44 | 83 | Se deberá anotar el apellido paterno del funcionario.5 |
| 4 | Apellido Materno | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1005485.png | AN | 40 | 0 | 84 | 123 | Se deberá anotar el apellido materno del funcionario.5 |
| 5 | Correo Electrónico Institucional | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1007276.png | AN | 50 | 0 | 124 | 173 | Se deberá anotar el correo electrónico institucional del funcionario.5 |
| 6 | Fecha de ingreso al cargo |  | F | 8 | 0 | 174 | 181 | Se deberá reportar la fecha en la que se tomó posesión del cargo.3 |
| 7 | Fecha de ingreso a la Administradora |  | F | 8 | 0 | 182 | 189 | Se deberá reportar la fecha de ingreso del funcionario a la Administradora.3 |
| 8 | Espacios en blanco |  | AN | 333 | 0 | 190 | 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 cuando el campo con Id 10 del SUBENCABEZADO se reporte en 1. | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1014417.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de archivo = **Constante "302".**1 |
| 2 | Tipo de Certificación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1016208.png | N | 2 | 0 | 4 | 5 | Se deberá reportar el identificador correspondiente altipo de certificación que se reporta, de acuerdo con elCatálogo Tipos de Certificaciones.1 |
| 3 | Certificación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1017999.png | N | 2 | 0 | 6 | 7 | Se deberá reportar el identificador correspondiente a la Certificación que se reporta, de acuerdo con elCatálogo de Certificaciones.1 |
| 4 | Identificador Certificación | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1019790.png | AN | 50 | 0 | 8 | 57 | 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 |
| 5 | Fecha de emisión de la certificación |  | F | 8 | 0 | 58 | 65 | Se deberá reportar la fecha de emisión de lacertificación reportada.3 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 6 | Fecha fin vigencia |  | F | 8 | 0 | 66 | 73 | Se deberá reportar la fecha de fin de la vigencia de lacertificación reportada.  Para el caso de las certificaciones concluidas convigencia permanente se deberá llenar con ceros 3 |
| 7 | Espacios en blanco |  | AN | 449 | 0 | 74 | 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 | Banamex |
| 556 | Azteca |
| 562 | Invercap |
| 564 | Metlife |
| 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) |
| 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 |

|  |  |
| --- | --- |
| **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) |
| 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) |

|  |
| --- |
| **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 alfabético. 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.

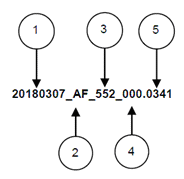
V.    El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

Vl.    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 cuáles serán conforme a la Clave de Entidad AFORES que se reporta conforme al catálogo deentidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente,**Constante = "001**". |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia deSIEFORES, 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 guión 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.

Vll.   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 |

**Liga a documentación relacionada con certificaciones en la página de internet de la Comisión: https://www.gob.mx/consar/documentos/certificacion-de-funcionarios-con-actividades-en-gestion-de-recursos-de-las-sociedades-de-inversion?idiom=es**

**Anexo 122**



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **DESCRIPCIÓN DEL FORMATO** | | | |
| **Información de Tipo Agregada**.- Este archivo contiene Información sobre el índice de rentabilidad diaria del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión al que hace referencia el artículo 36 de las DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro. | | | |
| **PERIODICIDAD DE ENVÍO** | **PERÍODO DE RECEPCIÓN** | **LONGITUD DEL REGISTRO** | **HORARIO DE TRANSMISIÓN** |
| DIARIO | DIARIO | 32 | 07:00 a 10:00 Hrs. |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1087773.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "000".** 1 |
| 2 | Tipo de Archivo | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1089508.png | N | 4 | 0 | 4 | 7 | Identificador de archivo (para control del sistema) =**Constante "0342".** 1 |
| 3 | Tipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1091243.png | N | 3 | 0 | 8 | 10 | Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta lainformación, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo.1 |
| 4 | Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1092978.png | N | 3 | 0 | 11 | 13 | Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. 1 |
| 5 | Subtipo de Entidad | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1094713.png | N | 3 | 0 | 14 | 16 | Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos.1 |
| 6 | Fecha de Información | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1096448.png | F | 8 | 0 | 17 | 24 | Fecha de la operación que se reporta.3 |
| 7 | Tamaño del Registro |  | N | 3 | 0 | 25 | 27 | Número de caracteres por registro = **Constante**"**032**".1 |
| 8 | Número de Registros |  | N | 5 | 0 | 28 | 32 | Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. 1 |

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

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DETALLE 1:** ÍNDICE DE RENTABILIDAD DEL PORTAFOLIO DE REFERENCIA | | | | | | | | |
| **Id** | **Concepto** | **Dato** | **Tipo** | **Longitud** | | **Posición** | | **Observaciones** |
| **Ent.** | **Dec.** | **De:** | **A:** |
| 1 | Tipo de Registro | http://www.dof.gob.mx/imagenes_diarios/2018/03/15/MAT/shcp3a11_Cimg_1102613.png | N | 3 | 0 | 1 | 3 | Identificador de registro (para control del sistema) =**Constante "301"** 1**.** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2 | Índice de rentabilidad base 1 del portafolio de referencia |  | N | 3 | 8 | 4 | 14 | Se deberá reportar un índice afectado por la rentabilidad diaria en pesos del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión al que hace referencia el artículo 36 de las DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro.  El índice deberá ser construido con base 1, a la fecha del primer envío de la presente información y se deberá redondear a ocho decimales.2 |
| 3 | Espacios en blanco |  | AN | 18 | 0 | 15 | 32 | 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 | BANAMEX |
| 544 | SURA |  | 630 | XXI BANORTE |
| 550 | INBURSA |  |  |  |
| 552 | BANAMEX |  |  |  |
| 556 | AZTECA |  |  |  |
| 562 | INVERCAP |  |  |  |
| 564 | METLIFE |  |  |  |
| 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 |
| 364 | METLIFE |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Catálogo de Subtipo de Entidades** | | | | |
| **Clave deTipo deEntidad** | **Clave de** **Entidad** | **Clave** **Subtipo de** **Entidad** | **Descripción** | **Razón Social** |
| 002 | 530 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 538 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |
| 002 | 564 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Met 0 Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 568 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 090 | Siefore Básica de Pensiones | Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 530 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 001 | Siefore Básica Uno | Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE |
| 002 | 538 | 001 | Siefore Básica Uno | Principal Siefore 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 001 | Siefore Básica Uno | Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V. |
| 002 | 562 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Invercap, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 001 | Siefore Básica Uno | Met1 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 001 | Siefore Básica Uno | Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 001 | Siefore Básica Uno | Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 002 | Siefore Básica Dos | Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 002 | Siefore Básica Dos | Principal Siefore 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 002 | Siefore Básica Dos | Inbursa Siefore, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Azteca, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Invercap II, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 002 | Siefore Básica Dos | Met2 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 002 | Siefore Básica Dos | Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 002 | Siefore Básica Dos | Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 003 | Siefore Básica Tres | Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 003 | Siefore Básica Tres | Principal Siefore 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 544 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 003 | Siefore Básica Tres | Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Invercap III, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 003 | Siefore Básica Tres | Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 003 | Siefore Básica Tres | Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 003 | Siefore Básica Tres | Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V. |
| 002 | 530 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V. |
| 002 | 534 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore |
| 002 | 538 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Principal Siefore 4, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 002 | 544 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 550 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 552 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 556 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 562 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Invercap IV, S. A. de C. V. |
| 002 | 564 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Met4 Siefore, S. A. de C. V. |
| 002 | 568 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V. |
| 002 | 578 | 004 | Siefore Básica Cuatro | Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V. |
| 003 | 334 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore |
| 003 | 364 | 001 | Siefore Aportaciones Complementarias Uno | MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 001 | Siefore Previsión Social Uno | Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 002 | Siefore Previsión Social Dos | Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 003 | Siefore Previsión Social Tres | Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 004 | Siefore Previsión Social Cuatro | Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 005 | Siefore Previsión Social Cinco | Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 006 | Siefore Previsión Social Seis | Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 004 | 430 | 007 | Siefore Previsión Social Siete | XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 008 | Siefore Previsión Social Ocho | Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 009 | Siefore Previsión Social Nueve | Siefore PMX-SAR S.A. de C.V. |
| 004 | 430 | 010 | Siefore Previsión Social Diez | XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V. |
| 017 | 634 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore |
| 017 | 644 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V. |
| 017 | 644 | 003 | Siefore Aportaciones Voluntarias Tres | Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V. |
| 017 | 652 | 002 | Siefore Aportaciones Voluntarias Dos | Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V. |
| 017 | 630 | 001 | Siefore Aportaciones Voluntarias Uno | Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V. |

|  |
| --- |
| **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 alfabético. 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.

II.         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, elarchivo 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.

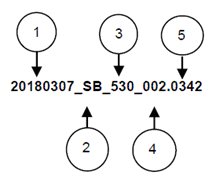
IV.        La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.

V.         El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizan-do el programa GNUpg.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 anexo al documento. |
| 3 | 3 Dígitos Numéricos | Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de AportacionesVoluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento. |
| 4 | 3 Dígitos Numéricos | Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (\*Solo aplicará para familia deSIEFORES. |
| 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 = "0342"**. |

**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 dos, 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\_SB\_530\_002.0342.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\_SB\_530\_002.0342**

**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 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 |