

## TERCERA SECCION

### SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

**CIRCULAR CONSAR 19-12 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.**

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 19-12

**MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERA SUJETARSE LA INFORMACION QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSION ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISION 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, 58, 88, 89, 90 fracción 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 y 1, 2 fracción III y 8 primer párrafo del Reglamento Interior de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, ha tenido a bien expedir las siguientes:

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

**PRIMERO.-** Se **MODIFICAN** las fracciones V, XIV y XVII de la regla novena y la regla décima segunda; se **ADICIONA** la fracción XVIII de la regla novena; y se **DEROGAN** las fracciones I, II, III, IV, V, XIV, XIX, XXIII, XXIV, XXVIII, XXXVII, XXXVIII, XXXIX, XLVIII, XLIX, L, LI, LIV, LXV, LXVI, LXVIII, y LXX de la regla quinta, las fracciones III y VI Bis de la regla séptima, la fracción II de la regla octava y la fracción XVI 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 y CONSAR 19-11 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010 y 15 de agosto de 2011, respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

**“QUINTA.- ...**

- I. Se deroga;
- II. Se deroga;
- III. Se deroga;
- IV. Se deroga;
- V. Se deroga;
- VI. a XIII. ...
- XIV. Se deroga;
- XV. a XVIII. ...
- XIX. Se deroga;
- XX. a XXII. ...
- XXIII. Se deroga;
- XXIV. Se deroga;
- XXV. a XXVII. ...
- XXVIII. Se deroga;
- XXIX. a XXXVI. ...
- XXXVII. Se deroga;
- XXXVIII. Se deroga;
- XXXIX. Se deroga;
- XL. a XLVII. ...
- XLVIII. Se deroga;
- XLIX. Se deroga;
- L. Se deroga;
- LI. Se deroga;
- LII. a LIII. ...
- LIV. Se deroga;
- LV. a LVIII. ...
- LIX. a LXIV. ...
- LXV. Se deroga;

**LXVI.** Se deroga;

**LXVII.** ...

**LXVIII.** Se deroga;

**LXIX.** ...

**LXX.** Se deroga.”

“**SEPTIMA.-** ...

**I.** a **II.** ...

**III.** Se deroga;

**IV.** a **VI.** ...

**VI Bis.** Se deroga;

**VII.** a **XII.** ...”

“**OCTAVA.-** ...

**I.** ...

**II.** Se deroga”

“**NOVENA.-** ...

**I.** a **IV.** ...

**V.** Información de desglose de valores en reporto, de valores en préstamo, operaciones compraventa 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, de conformidad con el formato establecido como anexo 78 de las presentes reglas;

**VI.** a **XIII.** ...

**XIV.** Información de los catálogos de números de cuenta del cliente y de contrapartes y beneficiarios, según los custodios internacionales de las Sociedades de Inversión, de conformidad con los formatos establecidos como anexos 107 y 108 de las presentes reglas;

**XV.**

**XVI.** Se deroga;

**XVII.** Información del desglose de los activos objeto de inversión operados por los mandatarios, de conformidad con el formato establecido como anexo 111 de las presentes reglas, y

**XVIII.** Información para la identificación de atributos de las posiciones de los mandatos reportados en el formato 0330, de conformidad con el formato establecido como anexo 112 de las presentes reglas.”

**“DECIMA SEGUNDA.- ...**

...

...

La Comisión podrá requerir a los Participantes en los Sistemas de Ahorro para el Retiro que ponga a disposición la información a que están obligados, a través de un medio distinto del señalado en las presentes reglas de carácter general, previo aviso a la entidad participante de cuando menos tres días hábiles al día en que la Comisión pretenda consultar la información.

Cuando los Participantes en los Sistemas de Ahorro para el Retiro pongan a disposición de la Comisión la información de acuerdo a lo señalado en el párrafo anterior, se entenderá que el participante cumplió con la obligación del envío de información a la Comisión, siempre y cuando ésta se encuentre disponible para consulta en los mismos plazos señalados en cada uno de los anexos de las presentes reglas generales y el medio de consulta tendrá la misma validez jurídica para efectos de cumplimiento de las obligaciones de los participantes.”

**SEGUNDO.-** Se **MODIFICAN** los Anexos 74, 75, 76, 77, 78, 79, 92, 93, 94, 95, 97, 106, 107, 108, 109 y 111; se **ADICIONA** el anexo 112; y se **DEROGAN** los anexos 1, 2, 3, 4, 5, 14, 19, 23, 24, 28, 37, 38, 39, 50, 51, 52, 53, 56, 62, 73, 91, 98, 101, 103, 105 y 110 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 y CONSAR 19-11, publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010 y 15 de agosto de 2011, respectivamente, para quedar en los términos de los Anexos 74, 75, 76, 77, 78, 79, 92, 93, 94, 95, 97, 106, 107, 108, 109, 111 y 112 de las presentes modificaciones y adiciones.

#### **TRANSITORIA**

**UNICA.-** Las presentes modificaciones y adiciones entrarán en vigor al día hábil siguiente de su publicación en el Diario Oficial de la Federación, con excepción de las modificaciones y adiciones contenidas en los anexos 74, 75, 76, 77, 78, 79, 92, 93, 94, 95, 97, 106, 107, 108, 109, 111 y 112, las cuales entrarán en vigor a los diez días hábiles siguientes a su fecha de publicación en el Diario Oficial de la Federación.

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

México, D.F., a 13 de junio de 2012.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, **Pedro Ordorica Leñero**.- Rúbrica.

## Anexo 74

	FORMATO DEL ARCHIVO : 1101	PROCESO : CONTABLE
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada</b> - 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 Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "077"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "1101"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3 0	16 18	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3 0	22 24	Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
8	Fecha de Operación		F	8 0	25 32	Fecha de la operación que se reporta a CONSAR. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	45 0	33 77	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: BALANZA DIARIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	Clave de Cuenta		N	4 0	4 7	Es la clave de la Cuenta Mayor de acuerdo al Catálogo de Cuentas Contables Vigente. <sup>1</sup>
3	Clave de Subcuenta		N	6 0	8 13	Clave de la Subcuenta de acuerdo al Catálogo de Subcuentas Vigente. <sup>1</sup>
4	Saldo Inicial		N	14 2	14 29	Saldo de la Cuenta o Subcuenta (debe ser el saldo final del día anterior). <sup>2</sup>
5	Cargos		N	14 2	30 45	Cargos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante el día. <sup>2</sup>
6	Abonos		N	14 2	46 61	Abonos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante el día. <sup>2</sup>
7	Saldo Final		N	14 2	62 77	Saldo de cierre de Cuenta o Subcuenta al final del día. <sup>4</sup>

## Anexo 74

	FORMATO DEL ARCHIVO : 1101	PROCESO : CONTABLE
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## CATALOGO(S)

Catálogo de Tipos de Entidades		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
001	AFORES	AF
<b>002</b>	<b>SIEFORES BASICA</b>	<b>SB</b>
<b>003</b>	<b>SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS</b>	<b>AC</b>
<b>004</b>	<b>SIEFORES PREVISION SOCIAL</b>	<b>PS</b>
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
011	ICEFAS	IC
013	BANXICO	BX
014	PRESTADORAS DE SERVICIO	PT
016	COMISIONES	CM
<b>017</b>	<b>SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS</b>	<b>AV</b>
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)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

## Anexo 74

	FORMATO DEL ARCHIVO :	1101	PROCESO :	CONTABLE
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## Anexo 74

	FORMATO DEL ARCHIVO :	1101	PROCESO :	CONTABLE
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDD AAAA MMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

**POLITICAS ESPECIFICAS 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. 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

## Anexo 74

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	1101	PROCESO :	CONTABLE
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

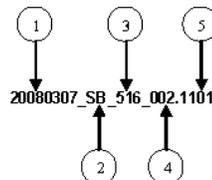
importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

- III. 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 Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores de Previsión Social.
- VIII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUJpg.
- 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 "AAAAMDD".
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 Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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 tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante</b> = "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 Siefiore XXI estuviera enviando un archivo de Siefiore básica dos, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



## Anexo 74

 <b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>			
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	1101	<b>PROCESO :</b>	CONTABLE
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

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\_516\_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\_516\_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

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0316	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada.</b> - 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 18:00 Hrs.

## ENCABEZADO

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 "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante "203". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0316". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de la Operación que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	171	0	33	203	Vacíos. <sup>6</sup>

## 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. <sup>1</sup>
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores 12 Para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones Tercerizadas. <sup>1</sup>

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0316	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9 10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01 <sup>1</sup> .
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11 12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
6	ISIN		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 <sup>12</sup> .
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25 33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0 <sup>13</sup> .
8	SEDOL		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 <sup>14</sup> .
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41 44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45 51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Administradora para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV. <sup>5</sup>
11	Serie		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 Administradora el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Ineval. <sup>5</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59 68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros. <sup>5</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69 76	Fecha de Liquidación de la operación <sup>3</sup> .
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. <sup>1</sup>
15	Costo unitario		N	9	6	89 103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
16	Precio Sucio		N	9	6	104	118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
17	Monto total a liquidar/ Monto Expuesto		N	14	2	119	134	Monto total a liquidar en la operación en pesos. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" y la Clase de Activos de la Inversión tercerizada sea "1 o 2" se deberá reportar el monto expuesto en la divisa. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. <sup>2</sup>
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. <sup>1</sup>
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	147	140	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. <sup>1</sup>
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2,3</sup>
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países <sup>1</sup> .
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes <sup>1</sup> .
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172	175	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros <sup>4</sup> .
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176	176	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si=1 y No=0 <sup>1</sup> .
26	Medio de concertación		N	1	0	177	177	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación <sup>1</sup> .

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
27	Sistema de concertación		N	2	0	178 - 179 En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – Accipresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO <sup>1</sup> .
28	Tipo de postura		N	1	0	180 - 180 Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 0 – No aplica 1 – Agresor 2 – Agredido <sup>1</sup> .
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 ceros <sup>1</sup> .
30	Observaciones		AN	20	0	184 - 203 Se deberá anotar el nombre de la contraparte en caso de haber utilizado el Identificador 076000 "otros operadores" o 700000 "otros Bancos extranjeros" como Contraparte <sup>6</sup> .

## CATALOGO(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)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0316	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0316	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo de Tipo de Inversión

Id	Abreviación	Descripción
0	Di	Directo
1	Re	Reporto
6	Pv	Préstamo de Valores
7	Gd	Garantías entregadas por operaciones con IFD
8	Gr	Garantías recibidas por operaciones de Reporto
9	Gi	Garantías recibidas por operaciones con IFD
10	Gp	Garantías recibidas por Préstamo de Valores
11	Ce	Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados
12	Ef	Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa
13	Ec	Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa.
14	Lt	Inversiones tercerizadas
15	Ge	Garantías entregadas por instrumentos Estructurados

Catálogo de Tipo de Liquidación

Id	Abreviación	Descripción
1	MD	Mismo Día
2	24	24 Hrs.
3	48	48 Hrs.
4	72	72 Hrs.
5	96	96 Hrs.
6	120	120 Hrs.
7	144	144 Hrs.
8	168	168 Hrs.
9	192	192 Hrs.

## Anexo 75

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
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
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción
1	BCC	Bono Cupón Cero
2	BTF	Bono Tasa Fija
3	TFA	Bono Tasa Fija Amortizable
4	BTV	Bono Tasa Flotante
5	TVA	Bono Tasa Flotante Amortizable
6	ACC	Acciones
7	ETF	Exchange Traded Funds
8	NEP	Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento
9	TRK	Instrumentos conocidos como Trackers
10	EFF	Efectivo
11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
12	MDT	Inversión Tercerizada
13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente

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

## Anexo 75

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0316	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

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	Accipresval
5	Corros Monex
99	OTRO

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	21	Reino Unido de la Gran Bretaña
2	Australia	22	Suiza
3	Austria	23	Chipre
4	Bélgica	24	Eslovaquia
5	Canadá	25	Eslovenia
6	Dinamarca	26	Estonia
7	España	27	Hungría
8	Estados Unidos de Norteamérica	28	Letonia
9	Finlandia	29	Lituania
10	Francia	30	Malta
11	Grecia	31	República Checa
12	Países Bajos (Holanda)	32	Suecia
13	Hong Kong	33	Brasil
14	Irlanda	34	China
15	Italia	35	India

## Anexo 75

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0316 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
16	Japón	36	Otro
17	Luxemburgo	37	Rumanía
18	México	38	Noruega
19	Polonia	39	Chile
20	Portugal	40	Israel

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080020	Valores Finamex International Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080021	Finamex Securities Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080022	Valores Finamex Limited
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080023	Interacciones Global Incorporated
013006	HSBC Casa de Bolsa	080024	Inter-Financial Services, Limited
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080025	Monex Securities Incorporated
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finamex Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013013	IXE Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013018	Casa de Bolsa Arka	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013019	Value Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013020	Adinver Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013021	Monex Casa de Bolsa	080034	Banorte I, LLC.
013026	Vector Casa de Bolsa	080037	Invex International, S.A.
013027	Casa de Bolsa Banorte	080038	Invex Worldwide, S.A.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013041	Invex Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf.

## Anexo 75

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			Alemania.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013120	UBS Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013121	Protego Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013124	Intercam Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	BullTick Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	082035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	082037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofimec, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	082049	Bancomer Sucursal en Houston
016408	B y B Casa de Cambio	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016419	Finamex Casa de Cambio	700000	Otros Bancos Extranjeros
016507	Casa de Cambio Tamibe	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701001	Abasis
016587	Sterling Casa de Cambio	701002	American Express (Extranjero)
016629	MoneyTron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)

## Anexo 75

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016719	Unica Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701010	Bank One (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701011	Banque Paribas (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701013	Bear Stearns (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701017	Citibank (Extranjero)
037135	Nacional Financiera	701018	Comerica Bank (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701019	Commerzbank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Invex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca Afime	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040106	Bank of America México	701041	Societe Generale (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040110	Banco J.P. Morgan	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040112	Banco Monex	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040113	Banco Ve por Más	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)

## Anexo 75

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040116	ING Bank (México)	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701048	Union Bank (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701049	Westdeutsche Landeszbank Girozentrale (Extranjero)
040128	Banco Autofin México	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040129	Barclays Bank México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040130	Banco Compartamos	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapore Stock Exchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity Exchange Incorporated – New York
040137	BanCoppel	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040138	Banco Amigo	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040139	UBS Bank México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040140	Banco Fácil		
040141	Volkswagen Bank	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040142	El Banco Deuno	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040143	Consultoría Internacional Banco	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801153	Pershing Inc.
040145	Banco Base	801154	Calyon Financial Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076000	Otros Operadores	801157	Segregación de Instrumentos
076001	Derfin	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076008	Stock & Price	801159	Reclasificaciones
076010	Scotia Inverlat Derivados	801160	Acciones Propias
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMA Derivados	801161	Cortes Transversales
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801162	Bank West
076022	Darka	801163	Bcpbank Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801164	Bridgewater Bank
076043	Timber Hill LLC.	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076044	Erlace Derivados	801166	Canadian Tire Bank
076048	Intercom Derivados	801167	Canadian Western Bank

## Anexo 75

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801168	Citizens Bank Of Canada
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801169	Cs Alterna Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo	801171	First Nations Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán	801172	General Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801173	Laurentian Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801174	Manulife Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079016	BI. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079017	BI. Bank and Trust.- Islas Caimán	801180	Suntrust Bank
079018	BI. Remittances Company.- Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801183	Regions Bank
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801184	National City Bank
079025	Nacional Financiera S.N.C. Natinsa Holdings Corp.	801185	Branch Bkg & TC
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801186	State Street B&TC
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801187	Countrywide Bank N.A.
079028	BBVA Bancomer USA	801188	Pnc Bank N.A.
079029	Dinero Express	801189	Keybank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801191	North Fork Bank
079032	INB Delaware Corporation	801192	Manufacturers & Traders Tc
079033	Inter Nacional Bank	801193	Bank Of The West
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801194	Fifth Third Bank
080001	Acci Securities Incorporated	801195	Northern TC
080004	Afn Securities International Limited	801196	Goldman Sachs Paris
080005	Atka Securities Incorporated	900000	Otros mandatarios
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.		
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation		
080013	Vectomex Incorporated		
080014	Vectomex Global Advisors Incorporated		
080015	Vectomex International Incorporated		
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.		

## Anexo 75

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0316 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDDAAA MMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

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

<sup>10</sup> 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.

<sup>12</sup> 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.

<sup>13</sup> 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.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

## Anexo 75

 <b>COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0316
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES
<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

**POLITICAS 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 sin contraponerse a las observaciones de cada campo, de lo contrario se llenarán con un CERO y espacios en blanco.

**POLITICAS ESPECIFICAS 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, 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 Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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;

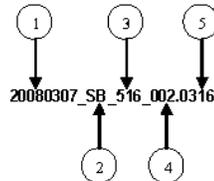
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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 tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0316"</b> .

**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.

## Anexo 75

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0316 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefore XXI 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\_516\_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\_516\_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 076

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0318	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene los Escenarios para el cálculo de valor en riesgo histórico del portafolio de las Sociedades de Inversión.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	55	07:00 a 10:00 Hrs.

## ENCABEZADO

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) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "055"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0318"</b> .
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexas. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexas. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de información reportada. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	23	0	33	55	Vacíos. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE								
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) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	Valor del Activo Administrado por la Sociedad de Inversión		N	14	2	4	19	Monto de la suma del Valor de los Activo Administrados por la Sociedad de Inversión directamente gestionado en materia de inversiones por ésta conforme a la definición de las DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>2</sup>
3	Fecha del Escenario		F	8	0	20	27	Fecha a la que corresponde el escenario. <sup>3</sup>
4	No. del Escenario		N	3	0	28	30	Número consecutivo del escenario (numérico del 1 al 1000, el escenario 1000 se reportará con el número 0). <sup>1</sup>

## Anexo 076

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0318 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CONTIENE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
5	Rendimiento del escenario		N	3	6	31	39	Es el cociente del valor del portafolio del escenario entre el valor indicado en el concepto "Cociente para el Rendimiento del escenario". <sup>2</sup>
6	Cociente para el Rendimiento del escenario		N	14	2	40	55	Valor de los Activos Administrados por la Sociedad de Inversión excluyendo los activos a que se refiere el anexo relativo a la Metodología para el cálculo del Valor en Riesgo (VaR) a un día usando datos históricos de las DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>2</sup>

## CATALOGO(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
019	CUSTODIOS DE LAS SIEFORES	CS
030	PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS	VP

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

## Anexo 076

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0318 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres

## Anexo 076

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0318	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

## Validaciones para formato de los datos

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDD AAAA MMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

## Anexo 076

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0318 <b>FUENTE :</b> SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

## POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

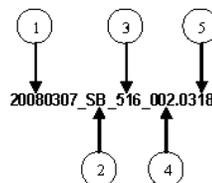
## Políticas a seguir en la transmisión de la información

- 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. 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 responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores de Previsión Social.
- IV. Este formato deberá ser enviado directamente por la Administradora o bien por la Sociedad Valuadora que contraten. Cuando la información sea enviada por la Sociedad Valuadora se deberá cumplir con lo establecido en el artículo 9 de las DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro vigente.
- V. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de una VPN (Red privada Virtual) para cada Sociedad Valuadora.
- VI. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- VII. 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 "AAAAMDD".
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 Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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 tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0318"</b> .

**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 Siefiore XXI estuviera enviando un archivo de Siefiore 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:

## Anexo 076

 <b>CONSAR</b> <small>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</small>		<b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0318	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

**20080307\_SB\_516\_002.0318.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\_516\_002.0318**

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

VIII. 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

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada</b> - 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.	586	07:00 a 10:00 Hrs.

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "586". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0314". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3 0	16 18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3 0	22 24	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8 0	25 32	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	554 0	33 586	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9 0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4 0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7 0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	8 0	49 56	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3 0	57 59	Se registrará el identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Tipo de Operación		N	3 0	60 62	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
11	Subyacente		AN	18	0 63 80	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>
12	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3	0 81 83	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
13	Divisa de Liquidación		N	2	0 84 85	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Plazo de referencia		N	4	0 86 89	En caso de que el Forward sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
15	Fecha de operación		F	8	0 90 97	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>4</sup>
16	Fecha de inicio		F	8	0 98 105	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
17	Fecha de liquidación		F	8	0 106 113	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
18	Fecha de Vencimiento		F	8	0 114 121	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>4</sup>
19	Tamaño del contrato		N	14	2 122 137	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
20	Número de contratos		N	14	0 138 151	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 152 154	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Precio o Tasa pactada		N	14	6 155 174	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
23	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0 175 180	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
24	Entrega física o diferenciales		AN	1	0 181 181	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
25	Tipo de Valor del Cheapest to Deliver		AN	4	0 182 185	Clave del Tipo de Valor del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
26	Emisora del Cheapest to Deliver		AN	7	0 186 192	Clave de la Emisora del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
27	Serie del Cheapest to Deliver		AN	6	0 193 198	Clave de la serie del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
28	Precio de CTD		N	3	6 199 207	Precio del Cheapest to Deliver en caso de Bonos. <sup>4</sup>
29	Medio de Concertación		N	1	0 208 208	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico. 2 = Electrónico. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Observaciones	
				Ent.	Dec.		
30	Contraparte		N	8	0	209 216	Se registrará el Identificador de la Contraparte (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
31	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	217 236	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>2</sup>
32	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	237 239	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
33	Calificación primera	contraparte	N	4	0	240 243	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
34	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	244 246	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	247 250	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". <sup>1</sup>
36	Observaciones y características especiales		AN	150	0	251 400	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. <sup>5</sup>
37	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	401 420	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
38	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	421 434	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
39	Socio Operador		N	8	0	435 442	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
40	Socio Liquidador		N	8	0	443 450	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
41	Espacios en blanco		AN	136	0	451 586	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición	Observaciones
				Ent.	Dec.		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	8	0	49 56	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3	0	57 59	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Tipo de Operación		N	3	0	60 62	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	63 70	Se deberá anotar el Identificador de la Bolsa de derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>
12	Subyacente		AN	18	0	71 88	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>
13	Divisa de Liquidación		N	2	0	89 90	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3	0	91 93	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
15	Plazo de referencia		N	4	0	94 97	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
16	Fecha de operación		F	8	0	98 105	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
17	Fecha de inicio		F	8	0	106 113	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
18	Fecha de liquidación		F	8	0	114 121	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
19	Fecha de Vencimiento		F	8	0	122 129	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
20	Tamaño del contrato		N	14	2	130 145	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
21	Número de contratos		N	14	0	146 159	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
22	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	160 162	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
23	Precio o Tasa pactada		N	14	6	163 182	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
24	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	183 188	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
25	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	189 189	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
26	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	190 193	Clave del Tipo de Valor del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
27	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	194 200	Clave de la Emisora del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
28	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	201 206	Clave de la serie del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
29	Precio de CTD		N	3	6	207 215	Precio del Cheapest to Deliver en caso de Bonos. <sup>2</sup>
30	Observaciones y características especiales		AN	150	0	216 365	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. <sup>5</sup>
31	Medio de Concertación		N	1	0	366 366	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
32	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	367 386	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
33	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	387 400	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
34	Socio Operador		N	8	0	401 408	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
35	Socio Liquidador		N	8	0	409 416	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
36	Espacios en blanco		AN	170	0	417 586	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	Dec. A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>

## Anexo 77

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	8	0	49 56	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3	0	57 59	Se registrará el Identificador 1 ó 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>
10	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	60 67	En el caso que la opción se realice en una Bolsa de derivados se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>
11	Tipo de opción		N	3	0	68 70	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
12	Subclase de opción		N	3	0	71 73	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
13	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	74 74	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
14	Subyacente		AN	18	0	75 92	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>
15	Divisa de Liquidación		N	2	0	93 94	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
16	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3	0	95 97	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
17	Plazo de referencia		N	4	0	98 101	En caso de que la opción sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
18	Fecha de la operación		F	8	0	102 109	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
19	Fecha de inicio		F	8	0	110 117	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
20	Fecha de Liquidación		F	8	0	118 125	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
21	Fecha de Vencimiento		F	8	0	126 133	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
22	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	134 141	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3</sup>
23	Tipo de operación		N	3	0	142 144	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>

## Anexo 77

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
24	Tamaño del contrato		N	14	2	145 160	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
25	Número de contratos		N	14	0	161 174	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
26	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	3	0	175 177	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	178 192	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
28	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	193 207	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
29	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	208 222	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
30	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	223 228	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
31	Prima Pactada		N	14	6	229 248	Se deberá anotar el monto de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
32	Contraparte		N	8	0	249 256	Identificador de la Contraparte 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 (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	257 276	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>2</sup>
34	Calificadora primera Contraparte		N	3	0	277 279	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación primera contraparte		N	4	0	280 283	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
36	Calificadora segunda Contraparte		N	3	0	284 286	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación segunda contraparte		N	4	0	287 290	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
38	Observaciones características especiales y		AN	150	0	291 440	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. <sup>5</sup>
39	Medio de Concertación		N	1	0	441 441	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico. 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
40	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	442 461	Corresponde al identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
41	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	462 469	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura. <sup>2</sup>

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
42	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	470 483	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
43	Socio Operador		N	8	0	484 491	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
44	Socio Liquidador		N	8	0	492 499	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
45	Espacios en blanco		AN	87	0	500 586	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	8	0	49 56	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3	0	57 59	Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Fecha de operación		F	8	0	60 67	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
11	Fecha de inicio		F	8	0	68 75	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
12	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	76 78	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. <sup>1</sup>
13	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	79 81	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. <sup>1</sup>
14	Fecha de próxima liquidación a entregar		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo. <sup>3</sup>
15	Fecha de próxima liquidación a recibir		F	8	0	90 97	Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo. <sup>3</sup>
16	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	98 101	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. <sup>1</sup>
17	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	102 105	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. <sup>1</sup>
18	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	106 108	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
19	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	109 111	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras.
20	Número de cupones a entregar		N	3	0	112 114	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. <sup>1</sup>
21	Número de cupones a recibir		N	3	0	115 117	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. <sup>1</sup>
22	Valor notional		N	14	6	118 137	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). <sup>2</sup>
23	Valor notional 2		N	14	6	138 157	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). <sup>2</sup>
24	Tipo de cambio pactado		N	12	6	158 175	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
25	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	176 181	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para notacionales, 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. En caso de que ambas divisas sean iguales se deberá registrar las tres primeras posiciones. <sup>2</sup>
26	Divisa del notional a entregar		N	3	0	182 184	Se registrará el identificador de la divisa del notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Divisa del notional a recibir		N	3	0	185 187	Se registrará el identificador de la divisa del notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	188 189	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
29	Subyacente a entregar		AN	18	0	190 207	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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 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. <sup>5</sup>
30	Subyacente a recibir		AN	18	0	208 225	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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 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. <sup>5</sup>
31	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	226 231	Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
32	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	232 237	Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
33	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	238 253	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
34	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	254 269	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
35	Sobretasa a entregar		N	3	2	270 274	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
36	Sobretasa a recibir		N	3	2	275 279	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
37	Tipo tasa a entregar		N	3	0	280 282	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
38	Tipo tasa a recibir		N	3	0	283 285	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
39	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	286 295	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
40	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	296 305	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
41	Amortiza Capital		N	1	0	306 306	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
42	Tipo de intercambios		N	3	0	307 309	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
43	Contraparte		N	8	0	310 317	Se registrará el Identificador de la Contraparte (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
44	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	318 337	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
45	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	338 340	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
46	Calificación contraparte primera		N	4	0	341 344	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
47	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	345 347	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
48	Calificación contraparte segunda		N	4	0	348 351	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
49	Medio de Concertación		N	1	0	352 352	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico <sup>1</sup> 2 = Electrónico <sup>1</sup>
50	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	353 372	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
51	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	373 386	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
52	Observaciones y características especiales		AN	117	0	387 503	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. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
53	Socio Operador		N	8	0	504 511	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
54	Socio Liquidador		N	8	0	512 519	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
55	Espacios en blanco		AN	67	0	520 586	Vacios. <sup>6</sup>

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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	8	0	49	56	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Tipo de Cupón		N	1	0	57	57	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. <sup>1</sup>
10	Numero de Cupón		N	3	0	58	60	Comenzando con el cupón vigente. <sup>1</sup>
11	Fecha Inicio		F	8	0	61	68	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. <sup>3</sup>
12	Fecha Final		F	8	0	69	76	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. <sup>3</sup>
13	Días de cupón		N	3	0	77	79	Días de cupón. <sup>1</sup>
14	Monto de referencia para amortizar		N	14	6	80	99	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor nominal. <sup>2</sup>
15	Nominal		N	14	6	100	119	Se deberá anotar el monto del valor nominal del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. <sup>2</sup>
16	Subyacente		AN	18	0	120	137	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie de un bien en específico si éste existe cotizando en el mercado, 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 caso de el subyacente no sea un bien específico, se utilizará el catálogo de emisoras o de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
17	Sobretasa		N	3	2	138	142	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. <sup>2</sup>

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :	

**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	
18	Observaciones Características Especiales <sup>0</sup>		AN	50	0	143 192	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. <sup>5</sup>
19	Fecha Inicial de Vigencia del cupón		F	8	0	193 200	Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
20	Fecha Final de Vigencia del cupón		F	8	0	201 208	Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
21	Espacios en blanco		AN	378	0	209 586	Vacíos. <sup>6</sup>

**DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS**

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 "306". <sup>1</sup>
2	Tipo Garantía		N	1	0	4 4	Se deberá anotar el identificador de la garantía que corresponda según el catálogo de Tipo de Garantía. <sup>1</sup>
3	ISIN de la Garantía		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
4	Cusip o Cins de la Garantía		AN	9	0	17 25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
5	Sedol de la Garantía		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
6	Tipo de Valor de la Garantía		AN	4	0	33 36	Se deberá anotar la Clave del Tipo de Valor según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
7	Emisora de la Garantía		AN	7	0	37 43	Se deberá anotar la Emisora según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
8	Serie de la Garantía		AN	7	0	44 50	Se deberá anotar la serie según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
9	Consecutivo de la Garantía		AN	8	0	51 58	Indicador consecutivo del instrumento según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
10	Contraparte de la Garantía		N	8	0	59 66	Identificador de la Contraparte (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
11	Número de títulos		N	14	0	67 80	Se deberá anotar el número de títulos respecto de la garantía recibida o entregada, en el caso de efectivo o Threshold se solicitará 1 título. <sup>1</sup>
12	Valor de mercado en pesos de la garantía		N	14	6	81 100	Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado con respecto a los precios del proveedor de precios y en su caso al tipo de cambio fix vigente a la fecha de envío, en el caso de efectivo en pesos, se anotará únicamente el monto dejado en garantía. En caso de Threshold se deberá enviar cero. <sup>1</sup>
13	Threshold		N	9	0	101 109	Se deberá anotar el monto umbral establecido por la contraparte en la moneda pactada en caso de Threshold, cero en otro caso. <sup>1</sup>
14	Divisa del Threshold		N	2	0	110 111	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas en caso de Threshold, "1" en otro caso. <sup>1</sup>
15	Espacios en blanco		AN	475	0	112 586	Vacíos. <sup>6</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307". <sup>1</sup>	
2	Aperturas y Cierres		N	1 0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. <sup>5</sup>	
3	ISIN		AN	12 0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>	
4	Cusip o Cins		AN	9 0	17 25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>	
5	Sedol		AN	7 0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>	
6	Tipo Valor		AN	4 0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>	
7	Emisora		AN	7 0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>	
8	Serie		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. <sup>5</sup>	
9	Consecutivo		AN	8 0	50 57	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>	
10	Estatus de operación		N	3 0	58 60	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>	
11	Tipo de Operación		N	3 0	61 63	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1 - Largo 2 - Corto <sup>1</sup>	
12	Subyacente		AN	18 0	64 81	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>	
13	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3 0	82 84	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>	
14	Divisa de Liquidación		N	2 0	85 86	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>	
15	Plazo de referencia		N	4 0	87 90	En caso de que el Forward sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>	
16	Fecha de operación		F	8 0	91 98	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>	
17	Fecha de inicio		F	8 0	99 106	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>	
18	Fecha de Vencimiento		F	8 0	107 114	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>	
19	Tamaño del contrato		N	14 2	115 130	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>	

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
20	Número de contratos		N	14	0	131 144	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	145 147	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	6	148 167	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó inicialmente, la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
23	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	6	168 187	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
24	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	188 203	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición. <sup>2</sup>
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	204 209	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	210 210	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
27	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	211 214	Clave del Tipo de Valor del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
28	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	215 221	Clave de la Emisora del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
29	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	222 227	Clave de la serie del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
30	Precio de CTD		N	3	6	228 236	Precio del Cheapest to Deliver en caso de Bonos. <sup>2</sup>
31	Medio de Concertación		N	1	0	237 237	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico. <sup>1</sup> 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
32	Contraparte		N	8	0	238 245	Se registrará el Identificador de la Contraparte (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	246 265	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
34	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	266 268	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación primera	contraparte	N	4	0	269 272	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
36	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	273 275	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	276 279	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". <sup>1</sup>
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	280 429	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. <sup>5</sup>
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	430 449	Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	450 463	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
41	Socio Operador		N	8	0	464 471	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
42	Socio Liquidador		N	8	0	472 479	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
43	Espacios en blanco		AN	107	0	480 586	Vacios. <sup>6</sup>

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		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "308". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17 25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		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. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	8	0	50 57	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0	58 60	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo 1
11	Tipo de Operación		N	3	0	61 63	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo <sup>1</sup> 2-Corto <sup>1</sup>
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	64 71	Se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE B: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
13	Subyacente		AN	18	0	72 89	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>
14	Divisa de Liquidación		N	2	0	90 91	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
15	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3	0	92 94	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
16	Plazo de referencia		N	4	0	95 98	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
17	Fecha de operación		F	8	0	99 106	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>4</sup>
18	Fecha de inicio		F	8	0	107 114	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada y sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
19	Fecha de Vencimiento		F	8	0	115 122	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>5</sup>
20	Tamaño del contrato		N	14	2	123 138	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
21	Número de contratos		N	14	0	139 152	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
22	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	153 155	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
23	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	6	156 175	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
24	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	6	176 195	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
25	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	196 211	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición. <sup>2</sup>
26	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	212 217	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
27	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	218 218	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
28	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	219 222	Clave del Tipo de Valor del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
29	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	223 229	Clave de la Emisora del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
30	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	230 235	Clave de la serie del instrumento subyacente Cheapest to Deliver en caso de bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
31	Precio de CTD		N	3	6	236 244	Precio del Cheapest to Deliver en caso de Bonos. <sup>4</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
32	Observaciones y características especiales		AN	150	0	245 394	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. <sup>8</sup>
33	Medio de Concertación		N	1	0	395 395	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
34	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	396 415	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
35	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	416 429	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
36	Socio Operador		N	8	0	430 437	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>5</sup>
37	Socio Liquidador		N	8	0	438 445	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
38	Espacios en blanco		AN	141	0	446 586	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De. A:	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17 25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		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. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	8	0	50 57	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0	58 60	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	61 68	En el caso que la opción se realice en una Bolsa de derivados se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes, en caso contrario, se llenará con ceros. <sup>1</sup>
12	Tipo de opción		N	3	0	69 71	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
13	Subclase de opción		N	3	0	72 74	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
14	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	75 75	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
15	Subyacente		AN	18	0	76 93	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. 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. <sup>5</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0	94 95	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
17	Divisa de cotización del bien subyacente		N	3	0	96 98	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia		N	4	0	99 102	En caso de que la opción sea de tasa de interés, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
19	Fecha de la operación		F	8	0	103 110	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
20	Fecha de inicio		F	8	0	111 118	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
21	Fecha de Vencimiento		F	8	0	119 126	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
22	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	127 134	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3</sup>
23	Tipo de operación		N	3	0	135 137	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto <sup>1</sup>
24	Tamaño del contrato		N	14	2	138 153	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
25	Número de contratos		N	14	0	154 167	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
26	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0	168 169	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	6	170 189	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
28	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	6	190 209	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
29	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	210 225	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE % CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
30	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	226 240	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
31	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	241 255	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
32	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	256 270	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
33	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	271 276	Para derivados de tipo de cambio, 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 conforme al catálogo de divisas. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
34	Prima Pactada		N	14	6	277 296	Se deberá anotar el monto de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
35	Contraparte		N	8	0	297 304	Identificador de la Contraparte 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 (Catálogo contrapartes).
36	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	305 324	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
37	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	325 327	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
38	Calificación contraparte primera		N	4	0	328 331	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>4</sup>
39	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	332 334	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
40	Calificación contraparte segunda		N	4	0	335 338	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
41	Observaciones y características especiales		AN	150	0	339 488	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. <sup>5</sup>
42	Medio de Concertación		N	1	0	489 489	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
43	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	490 509	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
44	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	510 517	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
45	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	518 531	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
46	Socio Operador		N	8	0	532 539	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
47	Socio Liquidador		N	8	0	540 547	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Espacios en blanco		AN	39	0	548 586	Vacios. <sup>6</sup>

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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		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. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	8	0	50	57	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0	58	60	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación), Anexo 1.
11	Fecha de operación		F	8	0	61	68	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
12	Fecha de inicio		F	8	0	69	76	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
13	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	77	79	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. <sup>1</sup>
14	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	80	82	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. <sup>1</sup>
15	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	83	86	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. <sup>1</sup>
16	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	87	90	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. <sup>1</sup>
17	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	91	93	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
18	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	94 96	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras.
19	Número de cupones a entregar		N	3	0	97 99	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. <sup>1</sup>
20	Número de cupones a recibir		N	3	0	100 102	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. <sup>1</sup>
21	Valor notional		N	14	6	103 122	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). <sup>2</sup>
22	Valor notional 2		N	14	6	123 142	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). <sup>2</sup>
23	Tipo de cambio pactado		N	12	6	143 160	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
24	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	161 166	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para notacionales, 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. En caso de que ambas divisas sean iguales se deberá registrar las tres primeras posiciones. <sup>5</sup>
25	Divisa del notional a entregar		N	2	0	167 168	Se registrará el identificador de la divisa del notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Divisa del notional a recibir		N	2	0	169 170	Se registrará el identificador de la divisa del notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Divisa de Liquidación		N	2	0	171 172	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
28	Subyacente a entregar		AN	18	0	173 190	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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 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. <sup>5</sup>
29	Subyacente a recibir		AN	18	0	191 208	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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 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. <sup>5</sup>
30	Divisa del subyacente a entregar		AN	3	0	209 211	Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
31	Divisa del subyacente a recibir		AN	3	0	212 214	Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
32	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	215 230	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
33	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	231 246	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
34	Sobretasa a entregar		N	3	2	247 251	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
35	Sobretasa a recibir		N	3	2	252 256	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
36	Tipo tasa a entregar		N	3	0	257 259	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
37	Tipo tasa a recibir		N	3	0	260 262	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
38	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	263 272	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
39	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	273 282	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
40	Amortiza Capital		N	1	0	283 283	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
41	Tipo de intercambios		N	3	0	284 286	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
42	Contraparte		N	8	0	287 294	Se registrará el Identificador de la Contraparte (Catálogo contrapartes). <sup>1</sup>
43	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	295 314	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
44	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	315 317	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
45	Calificación contraparte primera		N	4	0	318 321	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
46	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	322 324	Se registrará el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
47	Calificación contraparte segunda		N	4	0	325 328	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser distinta a la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
48	Medio de Concertación		N	1	0	329 329	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico. <sup>1</sup> 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
49	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	330 349	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
50	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	350 363	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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
51	Observaciones características especiales	y	AN	117	0	364 480	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. <sup>5</sup>

Anexo 77

	COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	PROCESO : FINANCIERO
FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
52	Socio Operador		N	8	0	481 488	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
53	Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición		N	14	6	489 508	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
54	Monto Neto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	509 524	Se deberá anotar el monto neto liquidado en pesos, al cierre de la posición. <sup>2</sup>
55	Socio Liquidador		N	8	0	525 532	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
56	Espacios en blanco		AN	54	0	533 586	Vacios. <sup>3</sup>

CATALOGO(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)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
---	--

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
---	--

## Anexo 77

Clave de Entidad		Descripción	
334		PROFUTURO	
364		METLIFE	

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	534	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## Anexo 77

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
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

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
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
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipo de Opción		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Americana	AM
2	Europea	EU
100	Otros	OT

Catálogo de Subclase de Opción		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Plain Vanilla	PV
7	Otros	OT

Catálogo de Estatus de Operación	
Identificador	Descripción
1	Posición Abierta
7	Se ejerce la opción (Este estatus se empleará únicamente en la fecha de ejercicio de la opción)
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

Catálogo de Tipos de Tasa		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Tasa Fija	TF
2	Tasa Variable al Inicio del Cupón	TVI
3	Tasa Variable al Final del Cupón	TVF
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 Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Clasificadora de Riesgos, 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

Catálogo de Tipo de Intercambios	
Identificador	Descripción
0	No intercambia notacionales
1	Intercambia notacionales al inicio
2	Intercambia notacionales al final
3	Intercambia notacionales al inicio y al final

Catálogo de Tipo de Operación		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Largo	Co
2	Corto	Ve

Catálogo de Tipo de Entrega	
Identificador	Descripción
F	Entrega Física
D	Diferenciales

Catálogo de Calificaciones Homologadas
--

## Anexo 77

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :		

Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>				
AAA (mex)	Aaa.mx	mxAAA	HR AAA	1000
AA+ (mex)	Aa1.mx	mxAA+	HR AA+	1001
AA (mex)	Aa2.mx	mxAA	HR AA	1002
AA- (mex)	Aa3.mx	mxAA-	HR AA-	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mxBB+	HR BB+	1010
BB (mex)	Ba2.mx	mxBB	HR BB	1011
BB- (mex)	Ba3.mx	mxBB-	HR BB-	1012
B+ (mex)	B1.mx	mxB+	HR B+	1013
B (mex)	B2.mx	mxB	HR B	1014
B- (mex)	B3.mx	mxB-	HR B-	1015
CCC+ (mex)	Caa1.mx	mxCCC+	HR C+	1016
CCC (mex)	Caa2.mx	mxCCC		1017
CCC- (mex)	Caa3.mx	mxCCC-		1018
CC (mex)	Ca.mx	mxCC	HR C	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-	1020
D (mex)		mxD	HR D	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>				
F1+ (mex)	MX-1	mxA-1+	HR+1	1022
F1 (mex)	MX-2	mxA-1	HR1	1023
F2 (mex)	MX-3	mxA-2	HR2	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	1025
B (mex)	MX-4	mxB	HR4	1026
C (mex)		mxC	HR5	1027
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>				
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

## Anexo 77

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :		

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
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	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

Catálogo de Tipo de Garantía	
Identificador	Descripción
1	<b>Garantía otorgada por la SIEFORE</b> en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados
2	<b>Garantía recibida por la SIEFORE</b> en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados
3	<b>Threshold de Contraparte (Monto umbral establecido por la contraparte)</b>
4	<b>Threshold de Siefore (Monto umbral establecido por la Siefore)</b>

Catálogo de Contrapartes
--------------------------

## Anexo 77

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

Identificador	Descripción
002001	Banco de México
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin
013005	Scotia Inverfat, Casa de Bolsa
013006	HSBC Casa de Bolsa
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer
013011	Multivalores Casa de Bolsa
013012	Finamex Casa de Bolsa
013013	IXE Casa de Bolsa
013015	Interacciones Casa de Bolsa
013018	Casa de Bolsa Arka
013019	Value Casa de Bolsa
013020	Activer Casa de Bolsa
013021	Monex Casa de Bolsa
013026	Vector Casa de Bolsa
013027	Casa de Bolsa Banorte
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa
013041	Invex Casa de Bolsa
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa
013120	UBS Casa de Bolsa
013121	Protego Casa de Bolsa
013122	Base Internacional Casa de Bolsa
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa
013124	Intercam Casa de Bolsa

Identificador	Descripción
080020	Valores Finamex International Incorporated
080021	Finamex Securities Incorporated
080022	Valores Finamex Limited
080023	Interacciones Global Incorporated
080024	Inter-Financial Services, Limited
080025	Monex Securities Incorporated
080026	Invex Incorporated
080027	GBM International Incorporated
080028	Foreign Holdings Ltd.
080029	Portfolio Investment Incorporated
080030	Arka International, Corp.
080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
080032	Banorte Asset Management, Inc.
080033	Afin International Holdings, Inc.
080034	Banorte I, LLC.
080037	Invex International, S.A.
080038	Invex Worldwide, S.A.
080041	Inbursa International, Inc.
080042	Inbursa Securities, Inc.
080043	IXE Holdings, Inc.
082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid,

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	062030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	BullTick Casa de Bolsa	062031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.		Confía Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	062035	
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	062037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	062039	Bancroer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016041	Casa de Cambio Tiber	062042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016044	Eurofinex, Casa de Cambio	062043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016067	Masari, Casa de Cambio	062044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	062048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016408	B y B Casa de Cambio	062049	Bancomer Sucursal en Houston
016419	Finamex Casa de Cambio		Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016507	Casa de Cambio Tambe	700000	Otros Bancos Extranjeros
016533	Casa de Cambio Majapara	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
016587	Sterling Casa de Cambio	701001	Abasis
016629	Money Tron Casa de Cambio	701002	American Express (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016719	Unica Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701010	Bank One (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701011	Banque Paribas (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025014	Fujos por pago de cupón o dividendo	701013	Bear Stearns (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037135	Nacional Financiera	701017	Citibank (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701018	Comerica Bank (Extranjero)
		701019	Commerzbank (Extranjero)

## Anexo 77

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Invex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040106	Bank of America México	701041	Societe Generale (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040110	Banco J.P. Morgan	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040112	Banco Monex	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040113	Banco Ve por Más	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040116	ING Bank (México)	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701048	Union Bank (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701049	Westdeutsche Landeszbank Girozentrale (Extranjero)
040128	Banco Autofin México	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040129	Barclays Bank México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040130	Banco Compartamos	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity Exchange Incorporated – New York
040137	BanCoppel	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)

## Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040138	Banco Amigo	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040139	UBS Bank México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040140	Banco Fácil		
040141	Volkswagen Bank	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040142	El Banco Deuno	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040143	Consultoría Internacional Banco	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801153	Pershing Inc.
040145	Banco Base	801154	Calyon Financial Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076000	Otros Operadores	801157	Segregación de Instrumentos
076001	Derfin	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076008	Stock & Price	801159	Reclasificaciones
076010	Scotia Inverfat Derivados	801160	Acciones Propias
076014	García Macías, Araneda y Asociados GMAAA Derivados	801161	Cortes Transversales
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serati)	801162	Bank West
076022	Darka	801163	Bcpbank Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801164	Bridgewater Bank
076043	Timber Hill LLC.	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076044	Erlace Derivados	801166	Canadian Tire Bank
076048	Interam Derivados	801167	Canadian Western Bank
079001	Bancomer Holding Islas Caimán	801168	Citizens Bank Of Canada
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801169	Cs Alterna Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc.-Delaware, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo	801171	First Nations Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited. Islas Caimán	801172	General Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801173	Laurentian Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801174	Manulife Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust – Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079016	BJ. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.

## Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079017	BJ. Bank and Trust.- Islas Caimán	801180	Suntrust Bank
079018	BJ. Remittances Company.- Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801183	Regions Bank
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801184	National City Bank
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801185	Branch Bkg & TC
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801186	State Street B&TC
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801187	Countrywide Bank N.A.
079028	BBVA Bancomer USA	801188	Pnc Bank N.A.
079029	Dinero Express	801189	Keybank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801191	North Fork Bank
079032	INB Delaware Corporation	801192	Manufacturers & Traders Tc
079033	Inter Nacional Bank	801193	Bank Of The West
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801194	Fifth Third Bank
080001	Acci Securities Incorporated	801195	Northern TC
080004	Ain Securities International Limited	801196	Goldman Sachs Paris
080005	Arka Securities Incorporated	900000	Otros mandatarios
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.		
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation		
080013	Vectomex Incorporated		
080014	Vectomex Global Advisors Incorporated		
080015	Vectomex International Incorporated		
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.		

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

## Validaciones para formato de los datos

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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, para el caso de ser positivo indicar la 1ª posición será 0.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

## Anexo 77

 <b>COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0314
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES
<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser "AAAAAMDDAAAMDD" 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.

<sup>5</sup> 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 un ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

<sup>6</sup> 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.

<sup>8</sup> 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.

<sup>12</sup> 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, si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con CEROS.

<sup>13</sup> 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, si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con CEROS.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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, si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con CEROS.

#### 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 CER0 y espacios en blanco.

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

## Anexo 77

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

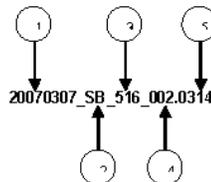
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- 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. 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 responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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 "AAAAMDD".
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 Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores 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 tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0314"</b> .

**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 Siefiore XXI estuviera enviando un archivo de Siefiore 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\_516\_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\_516\_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:

## Anexo 77

 <b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0314
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES
<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0300 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información del desglose de valores en reporte, 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 <sup>1</sup> , 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	PERIODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	343	07:00 a 10:00 Hrs.

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "343"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0300"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3 0	16 18	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3 0	22 24	Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8 0	25 32	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	311 0	33 343	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP O CINS		AN	9 0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4 0	32 35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>

## Anexo 078

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indevaf.
8	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
10	Plazo Actual del Reporto		N	6	0	66 71	El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. <sup>1</sup>
11	Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto		N	12	0	72 83	Número de títulos de la operación en Reporto adquiridos (en unidades). <sup>1</sup>
12	Costo total de adquisición del Reporto		N	14	2	84 99	Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. <sup>2</sup>
13	Tasa Premio		N	3	3	100 105	Tasa Premio pactada del Reporto. <sup>2</sup>
14	Precio Pactado		N	9	6	106 120	Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
16	Premio devengado		N	14	2	137 152	Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Valor razonable		N	14	2	153 168	Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
18	Tipo de garantía pactada		N	2	0	169 170	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores <sup>1</sup>
19	Tasa de mercado		N	3	3	171 176	Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. <sup>2</sup>
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 Divisas <sup>1</sup> .
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	179 180	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Tipo de cambio pactado		N	9	6	181 195	Tipo de cambio pactado <sup>2</sup> , en el reporte para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. <sup>9</sup>
23	Contraparte		N	6	0	196 201	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
24	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	202 204	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>

## Anexo 078

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De	A:	
25	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera		N	4	0	205	208	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporte 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. <sup>1</sup>
26	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	209	211	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
27	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda		N	4	0	212	215	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporte 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. <sup>1</sup>
28	Folio de operación		N	12	0	216	227	Se deberá anotar un folio único por cada operación de reporte el cual está asociado al folio del colateral de la operación en su caso. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Colateral recibido por concepto de operaciones en reporte y garantías recibidas por concepto de préstamos de valores). En caso de no recibir sobrolateral llenar con ceros. <sup>1</sup>
29	Espacios en blanco		AN	116	0	228	343	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DÍA								
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". <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. <sup>1</sup>
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 12 para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones tercerizadas. <sup>1</sup>

## Anexo 078

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. <sup>1</sup>
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
6	ISIN		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. <sup>12</sup>
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Administradora para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV. <sup>5</sup>
11	Serie		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 Administradora el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101.  Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>5</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59	68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros. <sup>5</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación. <sup>3</sup>
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. <sup>1</sup>

## Anexo 078

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104	118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
17	Monto total a liquidar/ Monto Expuesto		N	14	2	119	134	Monto total a liquidar en la operación en pesos. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" y la Clase de la Inversión tercerizada sea "1 o 2" se deberá reportar el monto expuesto en la divisa. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". <sup>2</sup>
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. <sup>1</sup>
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
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. <sup>1</sup>
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio <sup>9</sup> promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172	175	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporte se deberá llenar con ceros. <sup>10</sup>
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176	176	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. <sup>1</sup>
26	Medio de concertación		N	1	0	177	177	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación. <sup>1</sup>

## Anexo 078

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO		
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
27	Sistema de concertación		N	2	0	178 179 En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – Accipresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO. <sup>1</sup>
28	Tipo de postura		N	1	0	180 180 Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 0 – No aplica 1 – Agresor 2 – Agredido. <sup>1</sup>
29	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	181 183 Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros. <sup>1</sup>
30	Observaciones		AN	20	0	184 203 Se deberá anotar el nombre de la contraparte en caso de haber utilizado el Identificador 076000 "otros operadores" o 700000 "otros Bancos extranjeros" como Contraparte <sup>6</sup> .
31	Compra en mercado primario		N	1	0	204 204 En caso de reportar compras realizadas en mercado primario anotar 1. En otro caso se deberá anotar 0. <sup>1</sup>
32	Espacios en blanco		AN	139	0	205 343 Vacíos. <sup>6</sup>

## Anexo 078

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 7 para Garantías entregadas por operaciones con Instrumentos Financieros Derivados, 11 para el Inst. de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados, 14 para Inversiones tercerizadas 15 para Garantías entregadas por operaciones con instrumentos estructurados. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Administradora para cada mandatario. <sup>5</sup>
9	Serie		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 Administradora el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>5</sup>

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
10	Consecutivo		AN	10	0	54 63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. <sup>5</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64 75	Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
12	Costo promedio unitario en pesos de Adquisición		N	9	6	76 90	En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
13	Costo Total de Adquisición / Monto Expuesto		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 reporte 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" y la Clase de Activos de la Inversión tercerizada sea "1 o 2" se deberá reportar el monto expuesto en pesos. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. <sup>2</sup>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107 121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122 137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. <sup>2</sup>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138 153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>

## Anexo 078

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		PROCESO : FINANCIERO			
CON SAR Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :			
<b>DETALLE 3: CARTERA DE VALORES</b>							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154 159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
18	País de origen		N	2	0	160 161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario. <sup>1</sup>
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162 164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169 171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172 175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176 178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179 182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183 185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186 189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
27	Tipo de derecho o modificación accionaria		N	2	0	190 191	Se deberá anotar el identificador del tipo de derecho o modificación accionaria decretado según el Catálogo de Tipo de Derechos. Solamente en el caso de acciones, de lo contrario llenar con ceros. <sup>1</sup>
28	Fecha en que se decreta el derecho o modificación accionaria		F	8	0	192 199	Si se ha decretado algún tipo de derecho o modificación accionaria 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, de lo contrario llenar con ceros. <sup>3</sup>
29	Proporción de la modificación accionaria		N	6	6	200 211	Indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones en según los siguientes ejemplos: VIII. Cambio de serie 1 a 1 "1", IX. Split 2 a 1 "2", X. Dividendos en acciones 2.5 a 1 "2.5", etc. Solamente en el caso de acciones. <sup>2</sup>
30	Ejercicio del derecho o modificación accionaria		N	1	0	212 212	En caso de ejercerse en la fecha del reporte el derecho o modificación accionaria se deberá anotar "1" si no "0". <sup>1</sup>
31	Monto del Derecho		N	14	2	213 228	Si el tipo de derecho decretado es pago de dividendos en efectivo se deberá anotar el monto decretado de pago de dividendos por unidad accionaria. <sup>2</sup>
32	Valor Nominal Actualizado		N	14	6	229 248	Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos). Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen). En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
33	Títulos en circulación		N	14	0	249 262	Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
35	Títulos en Circulación Inicial		N	14	0	283 296	Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
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 administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
37	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	311 313	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. <sup>1</sup>
38	Aviso de Recomposición		N	1	0	314 314	Se deberá anotar el identificador con forme al catálogo de Aviso de Recomposición. <sup>1</sup>
39	Índice de Mandato		N	3	8	315 325	Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberá reportar el índice del mandato construido con base 1, afectado por la rentabilidad en pesos diaria del Mandato. En otro caso llenar con ceros. <sup>2</sup>
40	Observaciones		AN	18	0	326 343	Si el tipo de derecho o modificación accionaria es "8" se deberá especificar el nombre anterior de la emisora. Si el tipo de derecho o modificación accionaria 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 intermedios. <sup>5</sup>

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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	Capital Contable (Activo Total de la Sociedad de Inversión)		N	14	2	4	19	Es el capital contable, la suma del Activo Administrado por una Sociedad de Inversión y de los Activos Administrados por los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
3	Activo Administrado por la Sociedad de Inversión		N	14	2	20	35	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión directamente gestionado en materia de inversiones por ésta, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
4	Activo Administrado por los Mandatarios		N	14	2	36	51	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión que se encuentre bajo la gestión financiera de los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
5	Acciones en circulación finales		N	12	0	52	63	Es la cantidad de acciones en circulación en día que se está reportando. <sup>1</sup>
6	Precio de la acción		N	9	6	64	78	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales. <sup>2</sup>
7	Espacios en blanco		AN	265	0	79	343	Vacios. <sup>6</sup>

## Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRÉSTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 8 para Garantías recibidas por operaciones de Reporto, 10 para Garantías recibidas por Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
9	Serie		AN	7	0	47	53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>5</sup>
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). <sup>1</sup>
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. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. <sup>2</sup>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión. <sup>1</sup>
18	País de origen		N	2	0	160	161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>

## Anexo 078

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRESTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162 164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169 171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172 175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176 178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179 182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183 185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186 189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
27	Contraparte		N	6	0	190 195	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes <sup>1</sup> .
28	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	196 198	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
29	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	199 202	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>

## Anexo 078

	COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTIAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRESTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
30	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	203 205	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
31	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	206 209	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
32	Folio de operación		N	12	0	210 221	Se deberá anotar el folio asociado a la operación de reporte o préstamo de valores; deberá ser el mismo reportado en los detalle 1 (Desglose de Valores en Reporto) y 6 (Desglose de valores en préstamo) respectivamente <sup>1</sup> .
33	Espacios en blanco		AN	122	0	222 343	Vacíos <sup>6</sup> .

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO								
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 "306". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
11	Cantidad de Títulos en préstamo		N	12	0	72	83	Número de títulos en préstamo (en unidades). <sup>1</sup>

## Anexo 078

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
12	Valor inicial de mercado del Préstamo de Valores		N	9	6	84 98	Precio unitario pactado para la operación de Préstamo de Valores en pesos. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
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 pactado <sup>2</sup> .
15	Tasa Premio		N	3	3	131 136	Tasa Premio pactada para el Préstamo de Valores. <sup>2</sup>
16	Premio devengado		N	14	2	137 152	Premio devengado del Préstamo de Valores a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Tipo de garantía pactada		N	2	0	153 154	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
18	Divisa		N	2	0	155 156	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
19	Divisa de Liquidación		N	2	0	157 158	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
20	Tipo de cambio pactado		N	9	6	159 173	Tipo de cambio <sup>3</sup> pactado, en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. <sup>2</sup>
21	Contraparte		N	6	0	174 179	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
22	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	180 182	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
23	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	183 186	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. <sup>1</sup>
24	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	187 189	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
25	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	190 193	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. <sup>1</sup>
26	Folio de operación		N	12	0	194 205	Se deberá anotar un folio único por cada operación de préstamo de valores 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, préstamos de valores y derivados que no forman parte del activo total de la sociedad de inversión). <sup>1</sup>

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
27	Espacios en blanco		AN	138	0	206 343 Vacíos <sup>6</sup> .

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO DIA Y FECHA VALOR						
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 "307". <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	4	0	4 7 Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Subtipo de movimiento <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	8 19 Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	20 28 Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	SEDOL		AN	7	0	29 35 Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo de Valor		AN	4	0	36 39 Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo (En el caso de subtipos de movimiento con identificador 2 y 3). <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	40 46 Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo (En el caso de subtipos de movimiento con identificador 2 y 3). <sup>5</sup>
8	Serie		AN	7	0	47 53 Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo (En el caso de subtipos de movimiento con identificador 2 y 3). <sup>5</sup> 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. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	54 63 Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
10	Tipo de Movimiento		N	3	0	64 66 Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento (1 Ingreso o Cuenta por cobrar y 2 Egresos o cuenta por pagar). <sup>1</sup>
11	Tipo de Liquidación		N	2	0	67 68 Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. <sup>1</sup>
12	Tipo de Instrumento		N	2	0	69 70 Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento (En el caso de subtipos de movimiento con identificador 2 y 3). <sup>1</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	71 78 Fecha de Liquidación de la operación. <sup>3</sup>
14	Cantidad de Títulos o Unidades		N	12	0	79 90 Número de Títulos operados o número de unidades según corresponda. (En el caso de subtipos de movimiento con identificador 1, 2 y 3). <sup>1</sup>
15	Valor unitario		N	9	6	91 105 Valor unitario en pesos de los títulos operados. <sup>2</sup>
16	Monto total a liquidar		N	14	2	106 121 Monto total a liquidar en la operación en pesos. <sup>2</sup>

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO DIA Y FECHA VALOR							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
17	Divisa		N	2	0	122 123	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para la liquidación de operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
18	Tipo de cambio aplicado		N	9	6	124 138	Tipo de cambio aplicado <sup>9</sup> para liquidar operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. <sup>2</sup>
19	Índice		N	3	0	139 141	En el caso de acciones o vehículos, se deberá anotar el identificador del índice al que pertenece la acción según el catálogo de Índices que se encuentra publicada en la página oficial de esta comisión; cualquier otro caso se deberá anotar cero. <sup>1</sup>
20	Contraparte		N	6	0	142 147	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
21	Hora de liquidación de la operación mismo día		N	4	0	148 151	Hora de concertación de la operación en caso de ser liquidada el mismo día. <sup>10</sup>
22	Observaciones		AN	16	0	152 167	Se deberá anotar una descripción corta en caso de haber utilizado el Identificador 9 del Catálogo de Subtipo de movimiento. <sup>5</sup>
23	Espacios en blanco		AN	176	0	168 343	Vacíos. <sup>6</sup>

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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "308". <sup>1</sup>
2	Contraparte		N	6	0	4	9	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
3	Divisa		N	2	0	10	11	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". <sup>1</sup>
4	Monto en divisa		N	12	2	12	25	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de liquidación. <sup>2</sup>
5	Monto		N	12	2	26	39	En este campo se debe reportar el valor en pesos mexicanos del depósito o en su caso aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados. <sup>2</sup>
6	Tipo de Depósito		N	1	0	40	40	Se deberá anotar el tipo de depósito según el catálogo de tipo de depósito. <sup>1</sup>
7	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	41	43	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
8	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	44	47	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
9	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	48	50	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
10	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	51	54	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
11	Espacios vacíos		AN	289	0	55	343	Vacíos. <sup>6</sup>

## Anexo 078

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 9: FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRANSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC).

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De.	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". <sup>1</sup>
2	Divisa del Flujo		N	2	0	4	5	Se reportará el identificador de la divisa en la que se liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
3	Tipo de Operación		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. <sup>1</sup>
4	Monto por liquidar		N	12	2	7	20	Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, para la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar en pesos mexicanos. <sup>2</sup>
5	Espacios vacíos		AN	323	0	21	343	Vacíos. <sup>3</sup>

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De.	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". <sup>1</sup>
2	Identificador Mandato		AN	4	0	4	7	Se indicará el valor constante MDT. <sup>5</sup>
3	Identificador Mandatario		AN	7	0	8	14	Deberá ser definido por la Administradora para cada mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Emisora reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. <sup>5</sup>
4	Consecutivo mandato		AN	7	0	15	21	Deberá ser un consecutivo definido por la Administradora 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. <sup>5</sup>
5	Límite permitido para valores extranjeros		N	14	2	22	37	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en valores extranjeros en el mandato. <sup>1</sup>
6	Límite consumido para valores extranjeros		N	14	2	38	53	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en valores extranjeros. <sup>1</sup>
7	Límite permitido para Renta Variable		N	14	2	54	69	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en renta variable en el mandato. <sup>1</sup>
8	Límite consumido 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. <sup>1</sup>
9	Límite permitido para Mercancías		N	14	2	86	101	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en mercancías. <sup>1</sup>
10	Límite consumido para Mercancías		N	14	2	102	117	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en mercancías. <sup>1</sup>
11	Límite permitido para Divisas		N	14	2	118	133	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en divisas. <sup>1</sup>
12	Límite consumido para divisas		N	14	2	134	149	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en divisas. <sup>1</sup>

## Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
13	Límite permitido para Medida de Control de Riesgo		N	3	8	150 160	Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecido por la Administradora correspondiente al límite de medida de control de riesgo. <sup>1</sup>
14	Límite consumido para Medida Control de Riesgo		N	3	8	161 171	Se deberá anotar el límite consumido, en porcentaje, por el mandato correspondiente al límite de medida de control de riesgo. <sup>1</sup>
15	Espacios vacíos		AN	172	0	172 343	Vacíos. <sup>6</sup>

## CATALOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPEL
578	PENSIONISSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	578	005	PENSIONISSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## Catálogo de Tipo de Inversión

Id	Abreviación	Descripción
0	Di	Directo
1	Re	Reporto
6	Pv	Préstamo de Valores
7	Gd	Garantías entregadas por operaciones con IFD
8	Gr	Garantías recibidas por operaciones de Reporto
10	Gp	Garantías recibidas por Préstamo de Valores
11	Ce	Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados
12	Ef	Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa
13	Ec	Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa.
14	It	Inversiones tercerizadas
15	Ge	Garantías entregadas por instrumentos Estructurados

## Catálogo de Tipo de Liquidación

Id	Abreviación	Descripción
1	MD	Mismo Día
2	24	24 Hrs.
3	48	48 Hrs.
4	72	72 Hrs.
5	96	96 Hrs.
6	120	120 Hrs.
7	144	144 Hrs.
8	168	168 Hrs.
9	192	192 Hrs.

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300
	FUENTE :	SIEFORES
	PROCESO :	FINANCIERO
	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
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
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción
1	BCC	Bono Cupón Cero
2	BTF	Bono Tasa Fija
3	TFA	Bono Tasa Fija Amortizable
4	BTV	Bono Tasa Flotante
5	TVA	Bono Tasa Flotante Amortizable
6	ACC	Acciones
7	ETF	Exchange Traded Funds
8	NEP	Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento
9	TRK	Instrumentos conocidos como Trackers
10	EFF	Efectivo
11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
12	MDT	Inversión Tercerizada
13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente

Catálogo de Sistema de Concertación	
Identificador	Descripción
0	No aplica
1	MEI
2	SIPO
3	VAR
4	Accipresval
5	Corros Monex
99	OTRO

Catálogo de Intermediación	
Identificador	Descripción
0	Por cuenta propia
1	Banco de trabajo
9	Otro

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0300 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Tipo de Derechos	
Identificador	Descripción
1	Dividendos en efectivo
2	Dividendos en acciones
3	Escisión
4	Fusión
5	Cambio de Valor Nominal
6	Split
7	Split Inverso
8	Cambio de emisora
9	Cambio de serie
10	Canjes
11	Derechos por CKD's o Fibras

Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores	
Identificador	Descripción
0	Ninguna, el reporto o préstamo de valores no se encuentra garantizado
1	Caución bursátil
2	Prenda
3	Fideicomiso de garantía
4	Depósito bancario de dinero

Catálogo de Tipo de Movimiento			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	001	Ing	Ingreso o cuenta por cobrar
2	002	Egr	Egreso o cuenta por pagar

Catálogo de Subtipo de Movimiento			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	1000-1999	LDVS	Flujo de efectivo en divisas (se reporta en la fecha de concertación, en el campo de observaciones se deberá especificar el concepto)
2	2000-2999	LINT	Flujo de efectivo por liquidación de Intereses o cupones
3	3000-3999	LDIV	Flujo de efectivo por liquidación de Dividendos o derechos.
4	4000-4999	LPRM	Flujo de efectivo por liquidación de Primas, I.F.D.
5	5000-5999	APRT	Flujo de efectivo por operaciones con I.F.D. listados. Aportación de I.F.D.
6	6000-6999	GCC	Flujo por gastos (Especificar en observaciones el tipo de gasto y el proveedor)
7	7000-7999	LCSS	Liquidación de Comisiones Sobre Saldo
8	8000-8999	LJOP	Flujo de efectivo por operaciones con I.F.D. OTC
9	9000-9999	OTRO	Otro (Especificar en Observaciones)

**NOTA:** Referirse al punto VII de las políticas, cuando se utilice el catálogo Subtipo de Movimiento.

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>				
AAA (mex)	Aaa.mx	mxAAA	HR AAA	1000
AA+ (mex)	Aa1.mx	mxAA+	HR AA+	1001
AA (mex)	Aa2.mx	mxAA	HR AA	1002
AA- (mex)	Aa3.mx	mxAA-	HR AA-	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mxBB+	HR BB+	1010
BB (mex)	Ba2.mx	mxBB	HR BB	1011
BB- (mex)	Ba3.mx	mxBB-	HR BB-	1012
B+ (mex)	B1.mx	mxB+	HR B+	1013
B (mex)	B2.mx	mxB	HR B	1014
B- (mex)	B3.mx	mxB-	HR B-	1015
CCC+ (mex)	Caa1.mx	mxCCC+	HR C+	1016
CCC (mex)	Caa2.mx	mxCCC		1017
CCC- (mex)	Caa3.mx	mxCCC-		1018
CC (mex)	Ca.mx	mxCC	HR C	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-	1020
D (mex)		mxD	HR D	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>				
F1+ (mex)	MX-1	mxA-1+	HR+1	1022
F1 (mex)	MX-2	mxA-1	HR1	1023
F2 (mex)	MX-3	mxA-2	HR2	1024

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :		

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
F 3 (mex)		mxA-3	HR3	1025
B (mex)	MX-4	mxB	HR4	1026
C (mex)		mxC	HR5	1027
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	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

## Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO :	PROCESO :
	0300	FINANCIERO	
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

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

## Anexo 078

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300
	FUENTE :	SIEFORES
	PROCESO :	FINANCIERO
	ACTUALIZACIÓN :	

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080020	Valores Finamex International Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080021	Finamex Securities Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080022	Valores Finamex Limited
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080023	Interacciones Global Incorporated
013006	HSBC Casa de Bolsa	080024	Inter-Financial Services, Limited
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080025	Monex Securities Incorporated
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finamex Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013013	IXE Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013018	Casa de Bolsa Arka	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013019	Value Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013020	Actinver Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013021	Monex Casa de Bolsa	080034	Banorte I, LLC.
013026	Vector Casa de Bolsa	080037	Invex International, S.A.
013027	Casa de Bolsa Banorte	080038	Invex Worldwide, S.A.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013041	Invex Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082004	Banamex Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013120	UBS Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013121	Protego Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0300	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			Aires, Argentina.
013124	Intercom Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	Bulltick Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	082035	Conifa Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	082037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrocer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofinex, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082046	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	082049	Bancomer Sucursal en Houston
016408	B y B Casa de Cambio	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016419	Finamex Casa de Cambio	700000	Otros Bancos Extranjeros
016507	Casa de Cambio Tamibe	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701001	Abasis
016587	Sterling Casa de Cambio	701002	American Express (Extranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016712	Intercom Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016719	Unica Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701010	Bank One (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701011	Banque Paribas (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701013	Bear Stearns (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701017	Citibank (Extranjero)
037135	Nacional Financiera	701018	Comerica Bank (Extranjero)

## Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701019	Commerzbank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Invex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040106	Bank of America México	701041	Societe Generale (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040110	Banco J.P. Morgan	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040112	Banco Monex	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040113	Banco Ve por Más	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040116	ING Bank (México)	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701048	Union Bank (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701049	Westdeutsche Landeszbank Girozentrale (Extranjero)
040128	Banco Autofin México	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040129	Barclays Bank México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040130	Banco Compartamos	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapore Stock Exchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity Exchange Incorporated – New York
040137	BanCoppel	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)

## Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040138	Banco Amigo	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040139	UBS Bank México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040140	Banco Fácil		
040141	Volkswagen Bank	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040142	El Banco Deuno	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040143	Consultoría Internacional Banco	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801153	Pershing Inc.
040145	Banco Base	801154	Calyon Financial Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076000	Otros Operadores	801157	Segregación de Instrumentos
076001	Derfin	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076008	Stock & Price	801159	Redificaciones
076010	Scotia Inverlat Derivados	801160	Acciones Propias
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMA Derivados	801161	Cortes Transversales
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801162	Bank West
076022	Darka	801163	Bcpbank Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801164	Bridgewater Bank
076043	Timber Hill LLC.	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076044	Enlace Derivados	801166	Canadian Tire Bank
076048	Interam Derivados	801167	Canadian Western Bank
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801168	Citizens Bank Of Canada
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801169	Cs Alterra Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc.-Delaware, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo	801171	First Nations Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán	801172	General Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801173	Laurentian Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801174	Manulife Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079016	BJ. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079017	BJ. Bank and Trust.- Islas Caimán	801180	Surtrust Bank

## Anexo 078

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079018	BJ. Remitances Company - Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc. - Delaware, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc. - Delaware, E.U.A.	801183	Regions Bank
079024	CMX International Bank and Trust - Islas Caimán.	801184	National City Bank
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801185	Branch Bkg & TC
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801186	State Street B&TC
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801187	Countrywide Bank N.A.
079028	BBVA Bancomer USA	801188	Pnc Bank N.A.
079029	Dinero Express	801189	Keybank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801191	North Fork Bank
079032	INB Delaware Corporation	801192	Manufacturers & Traders Tc
079033	Inter Nacional Bank	801193	Bank Of The West
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801194	Fifth Third Bank
080001	Accl Securities Incorporated	801195	Northern TC
080004	Ain Securities International Limited	801196	Goldman Sachs Paris
080005	Arka Securities Incorporated	900000	Otros mandatarios
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.		
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation		
080013	Vectomex Incorporated		
080014	Vectomex Global Advisors Incorporated		
080015	Vectomex International Incorporated		
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.		

## Catálogo de Aviso de Reconposición

Clave Tipo de Entidad	Descripción
0	No aplica reconposición
1	En caso de encontrarse en proceso de reconposición se opta por conservar el instrumento
2	En caso de encontrarse en proceso de reconposición se opta por vender el instrumento

## Catálogo de Tipo de Depósito

Clave Tipo de Entidad	Descripción
1	Depósitos en instituciones financieras
2	Depósitos con custodios
3	Depósitos con socios liquidadores (aportaciones de derivados)

## Anexo 078

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0300 <b>FUENTE :</b> SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDD AAAA MMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> El valor de mercado del reporto se deberá calcular conforme a lo siguiente:

$$\text{Valor de mercado del reporto} = \text{Monto} \times \frac{\left( 1 + \frac{\text{Tasa Premio} \times \text{Plazo}}{360} \right)}{\left( 1 + \frac{\text{Tasa Valuación} \times \text{Días por Vencer}}{360} \right)}$$

**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 reporto.

## Anexo 078

 <b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0300
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES
<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

<sup>8</sup> 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.

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

<sup>10</sup> 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.

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

<sup>12</sup> 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.

<sup>13</sup> 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.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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. 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.

## Anexo 078

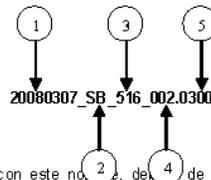
		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

- 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.
- 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. En el detalle **307**, las operaciones que correspondan a los conceptos de los identificadores 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8 y 9, señalados en el "Catálogo de Subtipo de Movimiento" se deberán reportar el día de su liquidación con el tipo de liquidación "1", Mismo día, las operaciones que correspondan al indicador 1 del "Catálogo de Subtipo de Movimiento", se deberán reportar de acuerdo con su fecha de liquidación, misma que podrá corresponder al tipo de liquidación 1, 2 o 3
- VIII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUJpg.
- 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 "AAAAMDD".
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 ("Sólo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0300"</b> .

**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 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, de encriptarse con el programa GNUJpg, el cual lo renombrará con el siguiente nombre:

**20080307\_SB\_516\_002.0300.jpg**

## Anexo 078

 <b>CONSAR</b> <small>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</small>		<b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0300	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

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\_516\_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.

X. 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

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0317	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información del desglose de operaciones con notas estructuradas.			
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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0317". <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
5	Subtipo de Entidad		N	3	0	14	16	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Fecha de Información		F	8	0	17	24	Fecha de la Operación que se reporta. <sup>3</sup>
7	Tamaño del Registro		N	3	0	25	27	Número de caracteres por registro = Constante "212". <sup>1</sup>
8	Número de Registros		N	5	0	28	32	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
9	Espacios en blanco		AN	180	0	33	212	Vacios. <sup>6</sup>

## SUBENCABEZADO

SUBENCABEZADO 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS NOTAS ESTRUCTURADAS								
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 "401". <sup>1</sup>
2	ID		AN	8	0	4	11	Consecutivo Interno de la Nota que será determinado por la Administradora para cada Nota en cada Siefore. <sup>19</sup>
3	Estatus de la operación		N	1	0	12	12	Se deberá anotar el identificador correspondiente al estatus de la operación según el catálogo de Estatus de Registro, en donde se anotará 1 para el día de apertura de la Nota Estructurada y mientras se realiza la compra/venta de acciones o vehículos que conforman un componente de la nota, con el propósito de que dicho componente cumpla con la desviación permitida; y 4 para constante una vez que se ha concluido la apertura de la nota y en adelante. <sup>1</sup>

## Anexo 79

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0317		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : SIEFORES		ACTUALIZACIÓN :	

SUBENCABEZADO 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS NOTAS ESTRUCTURADAS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
4	Fecha de inicio de la Operación		F	8	0	13 20	Se deberá anotar la fecha de inicio de la operación de la Nota Estructurada. <sup>3</sup>
5	Cantidad de Instrumentos.		N	2	0	21 22	Se deberá anotar el número de los distintos Instrumentos que componen a la Nota Estructurada y que se encuentran registrados en los Detalles 2 a 6 del presente Subencabezado. <sup>1</sup>
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 Nota Estructurada 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. <sup>6</sup>
7	Espacios en blanco		AN	189	0	24 212	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS NOTAS ESTRUCTURADAS 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.	Dg.	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la Nota Estructurada. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de la Nota Estructurada. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL la Nota Estructurada. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor de la Nota Estructurada. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora de la Nota Estructurada. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie de la Nota Estructurada. 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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo de la Nota Estructurada. <sup>5</sup>
9	Fecha de colocación de la Nota Estructurada.		F	8	0	60	67	Se deberá anotar la fecha de colocación de la Nota Estructurada. <sup>3</sup>
10	Fecha de vencimiento		F	8	0	68	75	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la Nota Estructurada. <sup>3</sup>
11	Valor Nominal		N	14	2	76	91	Se deberá anotar el Valor Nominal, en la divisa de cotización, de la Nota Estructurada en Directo (Principal Protegido a Vencimiento). <sup>2</sup>

## Anexo 79

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0317 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS NOTAS ESTRUCTURADAS 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		
12	Número de Títulos		N	12	0	92	103	Se deberá anotar el número de títulos de la Nota Estructurada adquiridos por la Siefore. <sup>1</sup>
13	Divisa de la Nota Estructurada		N	2	0	104	105	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización de la Nota Estructurada según el catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Observaciones		AN	107	0	106	212	Observaciones del Instrumento Estructurado. <sup>5</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA INSTRUMENTO DE DEUDA O VALOR EXTRANJERO DE DEUDA AL QUE SE VINCULA LA NOTA DEL SUBENCABEZADO 1.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent. Dec.	Dez. A:			
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>13</sup>
4	SEDOL		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. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. 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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
9	Número de Títulos		N	12	0	60	71	Cantidad de Títulos del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que componen la Nota. <sup>1</sup>
10	Fecha de Vencimiento		F	8	0	72	79	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la Nota. <sup>3</sup>
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 Nota. <sup>2</sup>

## Anexo 79

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0317 PROCESO : FINANCIERO FUENTE : SIEFORES ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE CADA INSTRUMENTO DE DEUDA O VALOR EXTRANJERO DE DEUDA AL QUE SE VINCULA LA NOTA DEL SUBENCABEZADO 1.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
12	Divisa		N	2	0	86 87	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la Nota. <sup>1</sup>
13	Espacios en blanco		AN	125	0	88 212	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE CADA UNA DE LAS DIFERENTES ACCIONES ADQUIRIDAS EN DIRECTO PARA CONFORMAR LA NOTA.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". <sup>1</sup>
2	ISIN Acción		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Acción		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>13</sup>
4	SEDOL Acción		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Acción		AN	4	0	32 35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>5</sup>
6	Emisora Acción		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>5</sup>
7	Serie Acción		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>5</sup>
8	Consecutivo Acción		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo de la acción utilizada para conformar la Nota. <sup>5</sup>
9	Número de Acciones		N	12	0	60 71	Número de Acciones que componen la Nota a la fecha del reporte. <sup>1</sup>
10	Divisa		N	2	0	72 73	Se anotará el identificador de la Divisa en la cual está cotizada la acción, según el catálogo de Divisas. <sup>2</sup>
11	Índice o Subíndice		AN	18	0	74 91	En caso de que la posición en acciones se use para la replicación de algún Índice o Subíndice, este campo estará conformado por el Tipo de Valor, Emisora y Serie del Índice 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. <sup>5</sup>
12	Espacios en blanco		AN	121	0	92 212	Vacíos. <sup>6</sup>

## Anexo 79

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0317	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES DERIVADOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA NOTA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	ISIN Derivado		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Derivado		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL Derivado		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Derivado		AN	4	0	32 35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota. <sup>5</sup>
6	Emisora Derivado		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota. <sup>5</sup>
7	Serie Derivado		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota. 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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo Derivado		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota. <sup>5</sup>
9	Fecha de vencimiento		F	8	0	60 67	Se deberá anotar la fecha en que teóricamente vence el Instrumento Derivado. <sup>3</sup>
10	Fecha de liquidación		F	8	0	68 75	Se deberá anotar la fecha en la que se liquida o se intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
11	Tamaño del contrato		N	14	2	76 91	Se deberá anotar el tamaño del contrato o Monto Ncional pactado en valor absoluto en la Divisa pactada. En caso de ser un Swap, se deberá anotar el Monto Ncional de los flujos a entregar en la divisa pactada. <sup>2</sup>
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 Ncional pactado para los flujos a recibir en valor absoluto en la Divisa pactada. Se dejará en cero en otro caso. <sup>2</sup>
13	Número de contratos		N	14	0	108 121	Se deberá anotar el número de contratos del Derivado que componen la Nota en la fecha del reporte. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
15	Delta		N	3	6	123 131	Se deberá anotar la delta del Instrumento Derivado proporcionada por el proveedor de precios, sólo aplica para opciones, en otro caso será igual a 1. <sup>2</sup>

## Anexo 79

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0317 FUENTE : SIEFORES
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES DERIVADOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA NOTA

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De.	A:	
16	Divisa Tamaño Contrato		N	2	0	132	133	Se anotará el identificador de la Divisa en la cual se pacta el Tamaño de Contrato o Monto Ncional, según el catálogo de Divisas. En caso de tratarse de un Swap se deberá de anotar el identificador de la divisa correspondiente al Monto Ncional de los flujos a entregar <sup>2</sup>
17	Divisa Tamaño Contrato 2		N	2	0	134	135	En caso de tratarse de un Swap, se anotará el identificador de la Divisa en la cual se pacta el Monto Ncional a recibir, según el catálogo de Divisas. Se dejará vacío en otro caso <sup>2</sup>
18	Subyacente		AN	18	0	136	153	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, 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 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. <sup>5</sup>
19	Espacios en blanco		AN	59	0	154	212	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHICULOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA NOTA.

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". <sup>1</sup>
2	ISIN Vehículo		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo que conforma la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Vehículo		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Vehículo que conforma la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL Vehículo		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Vehículo que conforma la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Vehículo		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Vehículo que conforma la Nota. <sup>5</sup>
6	Emisora Vehículo		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Vehículo que conforma la Nota. <sup>5</sup>

## Anexo 79

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0317	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

**DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHICULOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA NOTA.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
7	Serie Vehículo		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Vehículo que conforma la Nota. 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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo Vehículo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Vehículo que conforma la Nota. <sup>5</sup>
9	Cantidad de títulos		N	12	0	60 71	Cantidad de Títulos o acciones del Vehículo que componen la Nota en la fecha del reporte. <sup>1</sup>
10	Espacios en blanco		AN	141	0	72 212	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE TODOS LOS INSTRUMENTOS DEFINIDOS COMO ESTRUCTURADOS QUE COMPONEN LA NOTA**

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 "306". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Estructurado, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>7</sup>
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Instrumento Estructurado, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>8</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento Estructurado, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>9</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32 35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento Estructurado. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento Estructurado. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Instrumento Estructurado. 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. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento Estructurado. <sup>5</sup>
9	Fecha de colocación del Instrumento Estructurado		F	8	0	60 67	En caso de que el Instrumento Estructurado no sea una Acción o Título de Participación, se deberá anotar la fecha de colocación del Instrumento Estructurado, caso contrario, anotar la fecha de estructuración de la nota. <sup>3</sup>
10	Fecha de vencimiento		F	8	0	68 75	En caso de que el Instrumento Estructurado no sea una Acción o Título de Participación, se deberá anotar la fecha de vencimiento del Instrumento Estructurado, caso contrario, anotar la fecha de vencimiento de la nota. <sup>3</sup>
11	Número de Títulos		N	12	0	76 87	Se deberá anotar el número de títulos del Instrumento Estructurado Adquirido. <sup>1</sup>
12	Observaciones		AN	125	0	88 212	Observaciones del Instrumento Estructurado. <sup>5</sup>

## Anexo 79

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
 <b>CONSAR</b> <small>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</small>	FORMATO DEL ARCHIVO : 0317	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## CATALOGO(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)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

## Anexo 79

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0317	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## Anexo 79

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0317	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

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
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
99	OTR	Otras Divisas

(Continúa en la Cuarta Sección)

## CUARTA SECCION

# SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

(Viene de la Tercera Sección)

### Anexo 79

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0317 <b>FUENTE :</b> SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDD AAAA MMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>12</sup> 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.

<sup>13</sup> 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.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

<sup>19</sup> El ID será el consecutivo interno asignado por la Administradora.

## Anexo 79

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0317 <b>FUENTE :</b> SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**POLITICAS 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.

**POLITICAS ESPECIFICAS 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, 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 GNUJpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

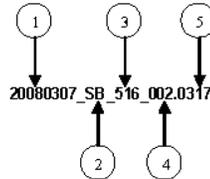
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo 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 ("Sólo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0317"</b> .

**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.

## Anexo 79

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0317 <b>FUENTE :</b> SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefore XXI 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\_516\_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\_516\_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 92

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0321 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada</b> - 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "136"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0321"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexas. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexas. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	104	0	33	136	Vacios. <sup>6</sup>

## 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios <sup>12</sup> .
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios <sup>13</sup> .
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios <sup>14</sup> .
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .

## Anexo 92

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0321 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: DETERMINACION DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACION DE LA ACCION POR SERIE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo <sup>2</sup> .
9	Porcentaje de Participación		N	2	6	60	67	Determinar el % que representa, el capital contable de cada serie respecto del capital contable, se deberá anotar el resultado en forma de porcentaje a seis decimales <sup>2</sup> .
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 decimales <sup>2</sup> .
11	Acciones en circulación iniciales		N	12	0	74	85	Es la cantidad de acciones en circulación finales por Serie del día anterior <sup>1</sup> .
12	Acciones vendidas		N	12	0	86	97	Es la cantidad de acciones por Serie vendidas del día que se está reportando <sup>1</sup> .
13	Acciones compradas		N	12	0	98	109	Es la cantidad de acciones por Serie compradas del día que se está reportando <sup>1</sup> .
14	Acciones en circulación finales		N	12	0	110	121	Es la cantidad de acciones en circulación por Serie en día que se está reportando <sup>1</sup> .
15	Precio de la acción		N	9	6	122	136	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales <sup>2</sup> .

## CATALOGO(S)

Catálogo de Tipos de Entidades		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
001	AFORES	AF
002	SIEFORES BASICA	SB
003	SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS	AC
<b>004</b>	<b>SIEFORES PREVISION SOCIAL</b>	<b>PS</b>
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
011	ICEFAS	IC
013	BANKICO	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)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

## Anexo 92

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0321	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:

## Anexo 92

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0321 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

**Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAA MMDD AAAA MMDD" 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.

## Anexo 92

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0321	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

...

<sup>11</sup> El Activo Neto será el definido por la Circular CONSAR serie 15 vigente.

<sup>12</sup> 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.

<sup>13</sup> 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.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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. 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 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.

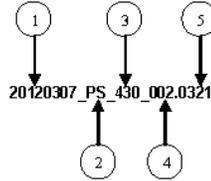
- VI. En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando las claves según la BMV si éstas existen o si el proveedor de precios les ha asignado valor, de lo contrario se llenarán los espacios vacíos con CEROS.
- VII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUJpg.
- VIII. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

Anexo 92

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0321	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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 "AAAAMDD".
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 catalogo 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 tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0321"</b> .

**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 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 93

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0310	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :

DESCRIPCION DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada</b> - Este archivo contiene vector de precios de Instrumentos de Deuda, Divisas, Tasas, Acciones, Vehículos, Instrumentos Estructurados, Fibras y otros			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERIODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	142	16:00 a 20:00 Hrs.

## VECTOR

VECTOR DE PRECIOS DE INSTRUMENTOS DE DEUDA, DIVISAS, VEHICULOS, TASAS, ACCIONES, INSTRUMENTOS ESTRUCTURADOS Y FIBRAS PARA SIEFÓRES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		AN	2	0	1	2	Identificador de registro Constante "H" <sup>4</sup> .
2	Tipo de Mercado		AN	2	0	3	4	Constante: - "MD" Mercado de Deuda - "MC" Mercado de Capitales <sup>4</sup> .
3	Fecha del Vector		F	8	0	5	12	Fecha de información <sup>3</sup> .
4	Tipo de Valor		AN	4	0	13	16	Tipo de Valor <sup>4</sup> .
5	Emisora		AN	7	0	17	23	Nombre de la Emisora <sup>4</sup> .
6	Serie		AN	6	0	24	29	Serie de la Emisora. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval <sup>4</sup> .
7	Precio Sucio		N	9	6	30	44	Precio de origen en pesos, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
8	Precio Limpio		N	9	6	45	59	Precio Sucio menos Intereses al día de valuación en pesos <sup>2</sup> .
9	Intereses		N	6	6	60	71	Factor de Interés en pesos, que se aplica al título de acuerdo a las características del mismo calculado al día de valuación <sup>2</sup> .
10	ID del Proveedor		N	6	0	72	77	ID del proveedor de Precios de acuerdo al "Catálogo de Proveedores de Precios" <sup>4</sup> .
11	Días por Vencer		N	6	0	78	83	Son los días que faltan para el vencimiento de la emisión <sup>1</sup> .
12	Tasa de descuento		N	3	6	84	92	Tasa de Descuento de la Emisión <sup>2</sup> .
13	ISIN		AN	12	0	93	104	Se deberá anotar la clave del ISIN <sup>6</sup> .
14	CUSIP o CINS		AN	9	0	105	113	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS <sup>9</sup> .
15	SEDOL		AN	7	0	114	120	Se deberá anotar la clave del SEDOL <sup>7</sup> .
16	Consecutivo		AN	10	0	121	130	Clave que le otorgue como consecutivo el proveedor de precios al activo <sup>4</sup> .
17	Tasa de Rendimiento		N	6	6	131	142	Para el caso de instrumentos de deuda se deberá anotar la tasa de rendimiento al vencimiento del instrumento. En otro caso 0 <sup>2</sup> .

## Anexo 93

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0310	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :	

## CATALOGOS(S)

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

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

## Validaciones para formato de los datos

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

## POLITICAS 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.

**Anexo 93**

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0310 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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 observaciones de cada campo; de lo contrario se llenarán con un CERO y espacios en blanco.

**POLITICAS ESPECIFICAS DEL PROCESO**

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

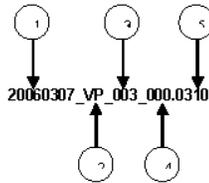
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de 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	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0310</b> .

**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\_000.0310**

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 ACCION	RUTA
Envío Normal	Definido en su VPN hacia E:(consarinfo)
Recuperación de Acuse	exporthome/rec/VECTORH/TRANSMISION



## Anexo 94

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

## CATALOGO(S)

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 Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
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
99	OTR	Otras Divisas

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

## Anexo 94

 <b>CONSAR</b> <small>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</small>		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0311	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :	

## ANEXO I

**1. Claves de emisora de Swaps**

En el caso de los Swaps, la emisora se compondrá de la siguiente forma:

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

Tasas	Clave
Fija-Fija	0
Fija-Variable	1
Variable-Variable	2
Variable – Fija	3
<b>Cross Currency</b>	
Fija-Fija	4
Fija-Variable	5
Variable-Variable	6
Variable - Fija	7

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

**2. Swaps de Tasas:**

Se deberá especificar el tipo de tasas a intercambiar, en primer lugar se pondrá la clave que entregue la SIEFORE y en segundo lugar la clave que reciba. La tasa fija se identificará con la clave de la moneda de origen de la tasa y la tasa variable se identificará con la clave de la tasa.

Las claves para las tasas y monedas serán de 3 caracteres, utilizando la "clave corta" definida en las Reglas para Emisoras.

**3. Swap de Divisas (Cross Currency Swaps) se considera:**

Se deberá especificar el tipo de tasas a intercambiar, en primer lugar se pondrá la clave que entregue la SIEFORE y en segundo lugar la clave que reciba. La tasa fija se identificará con la clave de la moneda de origen de la tasa y la tasa variable se identificará con la clave de la tasa.

Las claves para las tasas y monedas serán de 3 caracteres, utilizando la "clave corta" definida en las Reglas para Emisoras.

Un ejemplo del uso de las claves se presenta a continuación:

Operación	1	2	3	4	5	6	7	Resultado
Swap tasa fija 8.25 vs CETES (Siefore entrega Cetes y recibe fija 8.25)	1	C	E	T	M	X	P	1CETMXP
Swap TIIE vs Cetes (Siefore entrega TIIE y recibe CETES)	2	T	I	E	C	E	T	2TIECET
Swap MXP 7.28 vs USD 2.00 (Siefore entrega tasa Pesos y recibe tasa Dólares)	3	M	X	P	U	S	D	3MXPUSD
Swap EUR 1.35 vs USD Libor (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

## Anexo 94

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0311	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :	

## Reglas para Emisoras

Descripción	Clave Larga	Clave Corta	Categoría
TIE 28	TIE28	TIE	Tasa
TIE 91	TIE91	TIE	Tasa
Libor en Dólares	LIUSD	LUS	Tasa
Libor en Euros	LIEUR	LEU	Tasa
Libor en Yenes	LIJPY	LJP	Tasa
Cetes 28	CET28	CET	Tasa
Cetes 91	CET91	CET	Tasa
Cetes 182	CET182	CET	Tasa
Cetes 360	CET360	CET	Tasa

- 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 TIE se conforman de la siguiente manera: las primeras cuatro letras con el texto TIEE y las siguientes con el plazo de la TIEE.
- Las claves cortas para TIEE se conforman del texto TIE.

Ejemplos:

Descripción	Clave Larga	Clave Corta	Categoría
TIEE 28	TIEE28	TIE	Tasa
TIEE 91	TIEE91	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

## Anexo 94

 <b>CONSAR</b> <small>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</small>		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0311	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

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

## Anexo 94

 <b>COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO</b>			
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0311	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

No. de carácter	Descripción
<b>1</b>	Letra Inicial de Proveedor P = PIP, V = VALMER
<b>2-3</b>	Clave que identifica el año en el que se dio de alta el Derivado 03 = 2003, 04 = 2004... y así sucesivamente.
<b>4-8</b>	Número consecutivo de la operación, el cual será diferente para cada proveedor; dado que dependerá de las operaciones que sus clientes vayan realizando. Será incrementado en uno cada vez que exista duplicidad en "Tipo de valor", "Emisora" y "Serie".

Para el caso de los derivados de Mexder se aplicará el consecutivo de la siguiente forma:

- Si se trata de posiciones nuevas, es decir operaciones concertadas en la fecha de información se considerará el nivel de entrada con la posición, este consecutivo será:

No. de carácter	Descripción
<b>1-5</b>	Parte entera del nivel de entrada.
<b>6-8</b>	Decimales del nivel de entrada.

Ejemplo:

Operación	TV	EMISORA	SERIE	CONSECUTIVO
Futuro del dólar al 11.462	FD	DEUA	DC03	00011462
Futuro del bono al 102.55	FB	M10	DC03	00102550
Futuro del IPC al 106.35	FI	IPC	DC03	10635000
Futuro de la TIIE al 6.48	FB	TE28	DC03	00006480

- Para el caso de posiciones con más de un día de vigencia o que hayan sido concertadas un día hábil antes de la fecha de información, se considerará el consecutivo estándar; igual que los demás derivados.

Ejemplo:

Operación	TV	EMISORA	SERIE	CONSECUTIVO
Futuro del dólar al 11.4625	FD	DEUA	DC03	V0000001
Futuro del bono al 102.55	FB	M10	DC03	P0000001
Futuro del bono al 100.35	FB	M10	DC03	P0000002
Futuro de la TIIE al 6.48	FB	TE28	DC03	V0000001

#### POLITICAS 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.



## Anexo 95

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0312 FUENTE : Proveedores de precios	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene vector de índices accionarios y vehículos.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	136	16:00 a 20:00 Hrs.

## VECTOR

## VECTOR DE INDICES ACCIONARIOS

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De.	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		AN	2	0	1	2	Identificador de registro Constante "H" <sup>4</sup> .
2	Tipo de Mercado		AN	2	0	3	4	Constante: - "MC" Mercado de Capitales <sup>4</sup> .
3	Fecha del Vector		F	8	0	5	12	Fecha de información <sup>3</sup> .
4	Tipo de Valor		AN	4	0	13	16	Tipo de Valor <sup>4</sup> .
5	Emisora		AN	7	0	17	23	Nombre de la Emisora <sup>4</sup> .
6	Serie		AN	6	0	24	29	Serie de la Emisora <sup>4</sup> .
7	Precio Sucio		N	9	6	30	44	Nivel de cierre del Índice mismo día en la divisa de origen, en el caso de Vehículos se deberá reportar nivel de cierre mismo día en la divisa de cotización <sup>2</sup> .
8	Precio Limpio		N	9	6	45	59	Constante: "00000000000000" <sup>2</sup>
9	Intereses		N	6	6	60	71	Constante: "000000000000" <sup>2</sup>
10	Divisa		AN	6	0	72	77	Se deberá anotar el identificador de la Divisa correspondiente según el catálogo del proveedor <sup>5</sup> .
11	ID del Proveedor		AN	6	0	78	83	ID del proveedor de Precios de acuerdo al "Catálogo de Proveedores" <sup>4</sup> .
12	Días por Vencer		N	6	0	84	89	Constante: "000000" <sup>1</sup>
13	Tasa de descuento		N	3	6	90	98	Constante: "00000000" <sup>2</sup>
14	ISIN		AN	12	0	99	110	Se deberá anotar la clave del ISIN <sup>6</sup> .
15	CUSIP o CINS		AN	9	0	111	119	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS <sup>6</sup> .
16	SEDOL		AN	7	0	120	126	Se deberá anotar la clave del SEDOL <sup>7</sup> .
17	Consecutivo		AN	10	0	127	136	Clave que le otorgue como consecutivo el proveedor de precios al activo <sup>4</sup> .

## CATALOGO(S)

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

## Anexo 95

 <b>CONSAR</b> Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0312	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

**POLITICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

1° ISIN, de no existir éste,

2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

3° SEDOL.

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

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

Anexo 95

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0312	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**POLITICAS ESPECIFICAS DEL PROCESO**

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

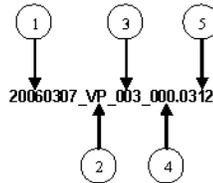
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de 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 Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0312</b> .

**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\_000.0312**

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 ACCION	RUTA
Envío Normal	Definido en su VPN hacia E:(consarinfo)
Recuperación de Acuse	export/home/rec/VECTORH/TRANSMISION

## Anexo 97

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0320	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada</b> - Este archivo contiene información del desglose de instrumentos subyacentes ligados a notas estructuradas.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	164	07:00 a 10:00 Hrs.

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE INSTRUMENTOS SUBYACENTES LIGADOS A NOTAS ESTRUCTURADAS								
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". <sup>1</sup>
2	Fecha de Información		F	8	0	4	11	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
3	Tipo de Valor		AN	4	0	12	15	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
4	Emisora		AN	7	0	16	22	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
5	Serie		AN	7	0	23	29	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
6	Consecutivo		AN	10	0	30	39	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
7	ISIN		AN	12	0	40	51	Se deberá anotar el ISIN que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>12</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	52	60	Se deberá anotar el CUSIP / CINS que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>13</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	61	67	Se deberá anotar el SEDOL que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>14</sup>
10	Serial Subyacente		AN	8	0	68	75	Tres posiciones para el # de subyacente de # de subyacentes, ejemplos: 001de001, 009de012. <sup>4</sup>
11	Tipo de Valor instrumento subyacente		AN	4	0	76	79	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
12	Emisora instrumento subyacente		AN	7	0	80	86	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
13	Serie instrumento subyacente		AN	7	0	87	93	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
14	ISIN del instrumento subyacente		AN	12	0	94	105	Se deberá anotar el ISIN que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>12</sup>
15	CUSIP O CINS del instrumento subyacente		AN	9	0	106	114	Se deberá anotar el CUSIP / CINS que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>13</sup>
16	SEDOL del instrumento subyacente		AN	7	0	115	121	Se deberá anotar el SEDOL que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>14</sup>
17	Divisa de cotización del instrumento subyacente		N	2	0	122	123	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia al país o forma de cotizar. <sup>16</sup>

## Anexo 97

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0320 FUENTE : Proveedores de precios	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS SUBYACENTES LIGADOS A NOTAS ESTRUCTURADAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
18	Valor unitario a Mercado del instrumento subyacente		N	9	6	124	138	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado del instrumento subyacente a la fecha del reporte <sup>2</sup> .
19	Delta		N	3	3	139	144	Se deberán anotar con signo más o menos el valor de la delta del instrumento subyacente con respecto a un título de la Nota estructurada <sup>2</sup> .
20	Nocional		N	14	6	145	164	Se deberá anotar el valor nocional implícito del instrumento derivado que cubre el índice asociado subyacente de la Nota estructurada <sup>2</sup> .

## CATALOGO(S)

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
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
99	OTR	Otras Divisas

## Anexo 97

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0320	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :	

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>12</sup> 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.

<sup>13</sup> 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.

<sup>14</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official 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.

<sup>16</sup> El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

**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 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;

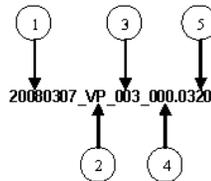
Anexo 97

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0320 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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 "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0320</b> .

**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:

**A20080307\_VP\_003\_000.0320**

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 ACCION	RUTA
Envío Normal	Definido en su VPN hacia E:(consarinfo)
Recuperación de Acuse	export/home/rec/VECTORH/TRANSMISION

## Anexo 106

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0303	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

**Información de Tipo Agregada** - Este archivo contiene Información de las operaciones de compra-venta, Reporto y Préstamo de Valores realizadas por las Siefiores, transferencias de valores y la posición diaria de sus carteras, así como de los valores otorgados en préstamo y en garantía.

PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERIODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	151	08:30 a 10:00 Hrs

## ENCABEZADO

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 "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante "151". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0303". <sup>1</sup>
5	Fecha de Operación		F	8	0	16	23	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3	0	24	26	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipo de Entidad anexo. <sup>1</sup>
7	Entidad		N	6	0	27	32	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades de los Custodios de las siefiores, anexo. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	119	0	33	151	Vacios. <sup>6</sup>

## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	Id Siefiore		AN	2	0	4	5	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
3	Folio Siefiore		AN	3	0	6	8	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
4	Cuenta Siefiore		AN	4	0	9	12	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
5	Número de Cuenta del Cliente		AN	20	0	13	32	Se deberá anotar el número de cliente de la Afore o Siefiore según el Catálogo de Números de Cuenta del Cliente conforme al Archivo 0308, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>
6	Espacios en blanco		AN	119	0	33	151	Vacios. <sup>6</sup>

## Anexo 106

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0303	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

## DETALLE(S)

## DETALLE 1: MOVIMIENTOS DE VALORES DEL DÍA

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Entradas/Salidas		AN	1 0	4 4	Es la clave de la operación realizada (valores recibidos "E" o entregados "S" por la Siefore). <sup>5</sup>
3	Tipo de Movimiento		AN	1 0	5 5	Es la clave que indica el tipo de movimiento realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7 0	6 12	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
5	Serie		AN	7 0	13 19	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
6	Tipo de Valor		AN	4 0	20 23	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
7	Cupón		N	4 0	24 27	Número del cupón vigente de la Emisora. <sup>1, 10</sup>
8	Monto de Liquidación		N	11 6	28 44	Total de liquidación de la operación en su caso. <sup>2</sup>
9	Tasa		N	3 6	45 53	Tasa pactada en la operación. <sup>2</sup>
10	Plazo		N	4 0	54 57	El número de días entre la fecha de la información y la fecha de vencimiento del instrumento o la operación de Reporto o Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
11	Id Contraparte		AN	2 0	58 59	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
12	Folio Contraparte		AN	3 0	60 62	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
13	Cuenta Contraparte		AN	4 0	63 66	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
14	Títulos operados		N	15 0	67 81	Total de títulos entregados o recibidos por la Siefore en la operación. <sup>1</sup>
15	Divisa		N	2 0	82 83	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisas anexo. <sup>1</sup>
16	Código ISIN		AN	12 0	84 95	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
17	CUSIP O CINS		AN	9 0	96 104	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
18	SEDOL		AN	7 0	105 111	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
19	Número de Cuenta de la Contraparte		AN	20 0	112 131	Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>
20	Número de Cuenta del Beneficiario		AN	20 0	132 151	Se deberá anotar el número de Cuenta del Beneficiario que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>

## DETALLE 2: POSICIÓN DE VALORES EN CARTERA

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7 0	4 10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7 0	11 17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4 0	18 21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Cupón		N	4 0	22 25	Número del cupón vigente de la Emisora. <sup>1, 10</sup>
6	Posición Inicial		N	20 0	26 45	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
7	Posición Actual		N	20 0	46 65	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
8	Código ISIN		AN	12 0	66 77	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
9	CUSIP O CINS		AN	9 0	78 86	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
10	SEDOL		AN	7 0	87 93	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>

## Anexo 106

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

DETALLE 2: POSICIÓN DE VALORES EN CARTERA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
11	Espacios en Blanco		AN	58	0	94   151	Vacios <sup>6</sup>

DETALLE 3: POSICIÓN DE VALORES OTORGADOS EN PRESTAMO							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1   3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7	0	4   10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7	0	11   17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4	0	18   21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Posición Inicial		N	20	0	22   41	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
6	Posición Actual		N	20	0	42   61	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
7	Código ISIN		AN	12	0	62   73	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>7</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	74   82	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	83   89	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
10	Espacios en Blanco		AN	62	0	90   151	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 4: POSICIÓN DE VALORES OTORGADOS EN GARANTIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1   3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7	0	4   10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7	0	11   17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4	0	18   21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Posición Inicial		N	20	0	22   41	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
6	Posición Actual		N	20	0	42   61	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
7	Código ISIN		AN	12	0	62   73	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>7</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	74   82	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	83   89	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
10	Espacios en Blanco		AN	62	0	90   151	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 5: MOVIMIENTOS DE EFECTIVO DEL DÍA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1   3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	Entradas/Salidas		AN	1	0	4   4	Es la clave de la operación realizada "E" para Depósitos recibidos y "S" para Retiros de la Siefore. <sup>5</sup>
3	Tipo de Movimiento de Efectivo		AN	1	0	5   5	Es la clave que indica el tipo de movimiento de efectivo realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento de Efectivo. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7	0	6   12	Es la clave de la Emisora del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
5	Serie		AN	7	0	13   19	Es la clave de la Serie del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
6	Tipo de Valor		AN	4	0	20   23	Es la clave de Tipo de Valor del instrumento que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
7	Monto		N	11	6	24   40	Monto del movimiento en efectivo. <sup>2</sup>

## Anexo 106

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

DETALLE DE MOVIMIENTOS DE EFECTIVO DEL DÍA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
8	Divisa		N	2	0	41 42 Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisas anexo. <sup>1</sup>
9	Código ISIN		AN	12	0	43 54 Se deberá anotar el código ISIN del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>1</sup>
10	CUSIP O CINS		AN	9	0	55 63 Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>8</sup>
11	SEDOL		AN	7	0	64 70 Se deberá anotar el código SEDOL del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>9</sup>
12	Número de Cuenta de la Contraparte		AN	20	0	71 90 Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309. <sup>5</sup>
13	Número de Cuenta del Beneficiario		AN	20	0	91 110 Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309. <sup>5</sup>
14	Espacios en Blanco		AN	41	0	111 151 Vacíos. <sup>5</sup>

## CATALOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (Custodios)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
140002	BANAMEX CUSTODIA
146300	STATE STREET BANK
140012	BANCOMER CUSTODIO
140014	SANTANDER CUSTODIO
146310	BANK OF NEW YORK

\* La CONSAR otorgará la clave de custodio respectiva

## Anexo 106

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

Catálogo de Tipo de Movimiento de Efectivo	
Identificador	Descripción
R	Operación de Reporto
D	Operación de Compra o Venta
C	Pago de cupón
A	Amortización
V	Pago de dividendos
H	Pago de derechos
P	Préstamo de Valores

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

## Anexo 106

 <b>CONSAR</b> Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0303	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
<b>FUENTE :</b>	Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>	

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

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

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

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

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMDDAAAAMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

<sup>9</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official List" es la clave asignada por la International Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

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

**Anexo 106**

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

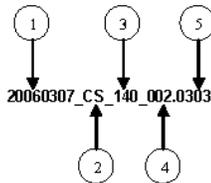
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/> o en su caso mediante FTP.
- II. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios de las Siefors.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 08:30 a las 10:00 hrs.
- IV. En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:
  - 1° ISIN, de no existir éste,
  - 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,
  - 3° SEDOL
 Será obligatorio contar con por lo menos uno de ellos.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Custodios a CONSAR se compone de lo siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígito Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígito Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. Constante = "CS"
3	3 Dígito Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígito Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta
5	4 Dígito Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0303.

**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 Banamex Custodia estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

**A20060307\_CS\_140\_002.0303**

- VI. Las rutas de envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por medio del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>

## Anexo 107

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0308	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene la información del Catálogo de Números de Cuenta del Cliente según los Custodios Internacionales de las Siefiores			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERIODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	092	08:30 a 10:00 Hrs

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Es el número de caracteres por registro = constante "092". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Es el identificador de archivo (para control del sistema)= Constante "0308". <sup>1</sup>
5	Fecha de Proceso		F	8 0	16 23	Es la fecha de envío de la información a CONSAR. <sup>3</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3 0	24 26	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información = Constante "019". <sup>1</sup>
7	Entidad		N	6 0	27 32	Clave de la Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades que establezca la CONSAR. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	60 0	33 92	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CATÁLOGO DE NÚMEROS DE CUENTA DEL CLIENTE						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Número de cuenta del cliente		AN	20 0	4 23	Será el número de cuenta de cliente que la Afore o Siefiore tenga con el Custodio. <sup>5</sup>
3	Clave de Siefiore		AN	9 0	24 32	Se deberá anotar la clave de la Afore o Siefiore según el Catálogo de Claves de Afores y Siefiores. <sup>5</sup>
4	Nombre del cliente		AN	60 0	33 92	Se deberá anotar la razón social del Cliente. <sup>6</sup>

## CATÁLOGO(S)

Catálogo de Entidades (Custodios)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
140002	BANAMEX CUSTODIA
146300	STATE STREET BANK
140012	BANCOMER CUSTODIO
140014	SANTANDER CUSTODIO
146310	BANK OF NEW YORK

\* La CONSAR otorgará la clave de custodio respectiva

## Anexo 107

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0308	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Claves de Afores y Siefores)

Clave de Siefore	Descripción	Clave de Siefore	Descripción
002566001	AFIRME, Siefore Básica 1	002550001	INBURSA, Siefore Básica 1
002566002	AFIRME, Siefore Básica 2	002550002	INBURSA, Siefore Básica 2
002566003	AFIRME, Siefore Básica 3	002550003	INBURSA, Siefore Básica 3
002566004	AFIRME, Siefore Básica 4	002550004	INBURSA, Siefore Básica 4
002566005	AFIRME, Siefore Básica 5	002550005	INBURSA, Siefore Básica 5
002556001	AZTECA, Siefore Básica 1	002544001	SURA, Siefore Básica 1
002556002	AZTECA, Siefore Básica 2	002544002	SURA, Siefore Básica 2
002556003	AZTECA, Siefore Básica 3	002544003	SURA, Siefore Básica 3
002556004	AZTECA, Siefore Básica 4	002544004	SURA, Siefore Básica 4
002556005	AZTECA, Siefore Básica 5	002544005	SURA, Siefore Básica 5
002552001	BANAMEX, Siefore Básica 1	017644001	SURA, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002552002	BANAMEX, Siefore Básica 2	002562001	INVERCAP, Siefore Básica 1
002552003	BANAMEX, Siefore Básica 3	002562002	INVERCAP, Siefore Básica 2
002552004	BANAMEX, Siefore Básica 4	002562003	INVERCAP, Siefore Básica 3
002552005	BANAMEX, Siefore Básica 5	002562004	INVERCAP, Siefore Básica 4
017652001	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1	002562005	INVERCAP, Siefore Básica 5
017652002	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 2	003364001	METLIFE, Siefore de Aportaciones Complementarias 1
002554001	BANCOMER, Siefore Básica 1	002564001	METLIFE, Siefore Básica 1
002554002	BANCOMER, Siefore Básica 2	002564002	METLIFE, Siefore Básica 2
002554003	BANCOMER, Siefore Básica 3	002564003	METLIFE, Siefore Básica 3
002554004	BANCOMER, Siefore Básica 4	002564004	METLIFE, Siefore Básica 4
002554005	BANCOMER, Siefore Básica 5	002564005	METLIFE, Siefore Básica 5
017654001	BANCOMER, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 1
017454001	BANCOMER, Siefore de Previsión Social 1	002578002	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 2
004454002	BANCOMER, Siefore de Previsión Social 2	002578003	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 3
004454003	BANCOMER, Siefore de Previsión Social 3	002578004	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 4
004454004	BANCOMER, Siefore de Previsión Social 4	002578005	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 5
004454005	BANCOMER, Siefore de Previsión Social 5	002538001	PRINCIPAL, Siefore Básica 1
002530001	XXI, Siefore Básica 1	002538002	PRINCIPAL, Siefore Básica 2
002530002	XXI, Siefore Básica 2	002538003	PRINCIPAL, Siefore Básica 3
002530003	XXI, Siefore Básica 3	002538004	PRINCIPAL, Siefore Básica 4
002530004	XXI, Siefore Básica 4	002538005	PRINCIPAL, Siefore Básica 5
002530005	XXI, Siefore Básica 5	003334001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Complementarias 1
004430001	XXI, Siefore de Previsión Social 1	002534001	PROFUTURO, Siefore Básica 1
004430002	XXI, Siefore de Previsión Social 2	002534002	PROFUTURO, Siefore Básica 2
004430003	XXI, Siefore de Previsión Social 3	002534003	PROFUTURO, Siefore Básica 3
004430004	XXI, Siefore de Previsión Social 4	002534004	PROFUTURO, Siefore Básica 4
004430005	XXI, Siefore de Previsión Social 5	002534005	PROFUTURO, Siefore Básica 5
002568001	COPPEL, Siefore Básica 1	017634001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002568002	COPPEL, Siefore Básica 2		
002568003	COPPEL, Siefore Básica 3		
002568004	COPPEL, Siefore Básica 4		
002568005	COPPEL, Siefore Básica 5		

## Anexo 107

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0308 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMDD" donde:  
 DD = día  
 MM = mes  
 AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMDDAAAAMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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 del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>
- II. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 08:30 a las 10:00 hrs.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Custodios a CONSAR se compone de lo siguiente;

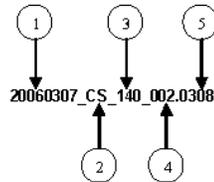
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo Tipo de Entidad anexo al documento, Constante = "CS"
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0308.

**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.

## Anexo 107

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0308	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Banamex Custodio (140002) 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\_CS\_140\_002.0308**

- V. Las rutas de envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por medio del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>

## Anexo 108

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0309	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE :	Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada</b> - Este archivo contiene la información del Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios según los Custodios Internacionales de las Siefiores			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERIODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	083	08:30 a 10:00

## ENCABEZADO

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 "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Es el número de caracteres por registro = constante "083". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Es el identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0309". <sup>1</sup>
5	Fecha de Proceso		F	8	0	16	23	Es la fecha de envío de la información a CONSAR. <sup>2</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información = Constante "019". <sup>4</sup>
7	Entidad		N	6	0	27	32	Clave de la Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades que establezca la CONSAR. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	51	0	33	83	Vacios. <sup>5</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CATALOGO DE NUMEROS DE CUENTA DE CONTRAPARTES Y BENEFICIARIOS								
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". <sup>1</sup>
2	Número de cuenta del cliente		AN	20	0	4	23	Será el número de cuenta de cliente que la Afore o Siefiore tenga con el Custodio. <sup>5</sup>
3	Nombre del cliente		AN	60	0	24	83	Se deberá anotar la razón social de la contraparte o Beneficiario. <sup>5</sup>

## CATALOGO(S)

Catálogo de Entidades (Custodios)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
140002	BANAMEX CUSTODIA
146300	STATE STREET BANK
140012	BANCOMER CUSTODIO
140014	SANTANDER CUSTODIO
146310	BANK OF NEW YORK

\* La CONSAR otorgará la clave de custodio respectiva

## Anexo 108

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0309 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

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

DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

<sup>4</sup> Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMDDAAAAMDD" 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

**POLITICAS ESPECIFICAS 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 del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>
- II. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 08:30 a las 10:00 hrs.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Custodios a CONSAR se compone de lo siguiente;

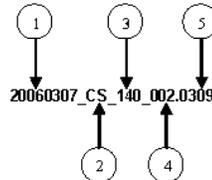
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento, Constante = "CS"
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0309.

**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.

## Anexo 108

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0309 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES
	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Banamex Custodio (140002) 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\_CS\_140\_002.0309**

- V. Las rutas de envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por medio del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>

## Anexo 109

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0322 FUENTE : Proveedor de precios	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Información de los escenarios de las matrices de cambios de los instrumentos			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	NO APLICA	16:00 a 20:00 Hrs.

## DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS MATRICES DE DIFERENCIAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Proveedor		AN	10	0	N/A	N/A	Identificador del proveedor de precios según el catálogo de proveedores. <sup>4</sup>
2	Fecha de Información		F	8	0	N/A	N/A	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
3	Tipo de Valor		AN	4	0	N/A	N/A	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al Instrumento. <sup>4</sup>
4	Emisora		AN	7	0	N/A	N/A	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al Instrumento. <sup>4</sup>
5	Serie		AN	7	0	N/A	N/A	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al Instrumento. <sup>4</sup>
6	ISIN		AN	12	0	N/A	N/A	Se deberá anotar el ISIN que le otorgue el proveedor de precios al Instrumento, un cero en otro caso. <sup>12</sup>
7	Precio1		N	14	6	N/A	N/A	Precio limpio del instrumento. <sup>18</sup>
8	Precio2		N	14	6	N/A	N/A	Precio sucio del instrumento. <sup>18</sup>
9	Fecha del escenario		F	8	0	N/A	N/A	Fecha del escenario correspondiente al número del escenario <sup>3</sup>
10	Número del escenario		N	3	0	N/A	N/A	Número del escenario correspondiente al instrumento. <sup>17</sup>
11	Diferencia		N	12	10	N/A	N/A	Diferencia en el precio del escenario correspondiente al instrumento <sup>18</sup> .
12	Consecutivo		AN	10	0	N/A	N/A	Consecutivo del Instrumento. <sup>4</sup>

## CATALOGO(S)

Catálogo de Proveedores		
Clave del Proveedor	Descripción	Abreviación
025009	Proveedor Integral de Precios, S.A. de C.V.	PIP
025012	Valuación Operativa y Referencias de Mercado S.A. de C.V	VALMER

## Anexo 109

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0322 <b>FUENTE :</b> Proveedor de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos= "AAAAMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos. En el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

<sup>12</sup> 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

<sup>17</sup> Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas sin ceros a la izquierda).

<sup>18</sup> Dato numérico con decimal (cantidades definidas con decimales sin ceros a la izquierda). Deberá llevar el signo de puntuación, sin comas de separación.

**POLITICAS GENERALES DEL PROCESO**

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos con el valor asignado por el proveedor de precios; de lo contrario se llenarán con un CERO.

**POLITICAS ESPECIFICAS 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 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 CON SAR será de las 16:00 a las 20:00 hrs.

**Anexo 109**

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0322 <b>FUENTE :</b> Proveedor de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

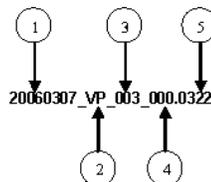
IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte del proveedor a CONSAR se compone de lo siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo y deberá indicar el número correspondiente a la clave del catálogo de matrices.

Catálogo de Matrices	
Clave	Descripción
0322	Deuda
0323	Índices
0324	Derivados
0325	Reportos
0326	Acciones
0327	CKDs
0328	Divisas

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



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:

## Anexo 109

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

VI. Se utilizará el tabulador como separador de campos.

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada</b> - 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 Ent. Dec.	Posición De A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" <sup>1</sup> .
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado <sup>1</sup> .
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "419" <sup>1</sup> .
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0330" <sup>1</sup> .
5	Tipo de Entidad		N	3 0	16 18	Se deberá anotar la "Clave del Tipo de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo <sup>1</sup> .
6	Entidad		N	3 0	19 21	Se deberá anotar la "Clave de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Entidades" anexo <sup>1</sup> .
7	Subtipo de Entidad		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", anexos <sup>1</sup> .
8	Fecha de Información		F	8 0	25 32	Fecha de operación que se reporta <sup>3</sup> .
9	Espacios en blanco		AN	387 0	33 419	Vacios <sup>5</sup> .

## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101" <sup>1</sup> .
2	Identificador Mandatario		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" <sup>4</sup> .
3	Consecutivo Mandato		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" <sup>4</sup> .

## Anexo 111

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 PROCESO : FINANCIERO FUENTE : CUSTODIOS ACTUALIZACIÓN :

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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" <sup>4</sup> .
5	País del Mandatario		N	2	0	28 29	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países <sup>5</sup> .
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) <sup>3</sup> .
7	Espacios en blanco		AN	382	0	38 419	Vacios <sup>6</sup> .

## 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" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4 5	Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión conforme al "Catálogo de Tipo de Inversión" <sup>1</sup> .
3	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	6 15	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>4</sup> .
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 reportada <sup>7</sup> .
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 reportada <sup>8</sup> .
6	SEDOL		AN	7	0	37 43	Se deberá anotar la clave del SEDOL del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>9</sup> .
7	Ticker Bloomberg		AN	20	0	44 63	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista <sup>10</sup> .
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 exista <sup>11</sup> .
9	Clase de Activo		N	2	0	84 85	Se deberá anotar el identificador de la clase de activo reportado según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" <sup>1</sup> .
10	País de origen		N	2	0	86 87	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al "Catálogo de Países" <sup>1</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.							
ID	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
11	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	88 97	Los identificadores reportados en este campo se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo denominado "ID Emisor/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 el identificador 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 <sup>4</sup> .
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 caso <sup>1</sup> .
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 caso <sup>1</sup> .
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 caso <sup>1</sup> .
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 caso <sup>1</sup> .
16	Fecha de Emisión		F	8	0	110 117	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se deberá indicar la fecha de emisión. En caso de que se reporten operaciones de reporto o préstamo de valores se deberá indicar la fecha de concertación de la operación. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
17	Fecha de Vencimiento		F	8	0	118 125	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes indicar la fecha de vencimiento. En caso de que reporten operaciones de reporto y préstamo de valores indicar la fecha de vencimiento de las operaciones. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
18	Plazo Cupón		N	4	0	126 129	En caso de tratarse de instrumentos de deuda con cupones, indicar el plazo del cupón en días. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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 la sobretasa del cupón. En caso de estar reportando operaciones de reporto, indicar la tasa pactada. Finalmente, en caso de estar reportando valores en préstamo, se deberá indicar la tasa premio pactada en la operación. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
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" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
22	Cantidad de Títulos		N	12	0	142 153	Se deberá reportar el número de títulos o acciones que conforman la posición del Mandato <sup>1</sup> .
23	Valor a Mercado		N	12	2	154 167	En este campo se deberá reportar el valor total a mercado de la posición en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
24	Valor Nominal		N	8	2	168 177	Para activos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se indicará el Valor Nominal en la divisa de cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
25	Títulos en Circulación		N	8	0	178 185	En el caso de instrumentos de deuda y estructuras vinculadas a subyacentes, se deberá reportar el número de títulos que se encuentran en circulación en la fecha en que se reporta la información <sup>1</sup> .
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 tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar 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, se deberá anotar el identificador del Índice que replica el vehículo. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .
27	Protección Inflacionaria		N	1	0	196 196	Se deberá anotar 1 si el o los flujos del instrumento están denominados en Unidades de Inversión (UDIs) o en moneda nacional cuyos intereses garanticen un rendimiento 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 caso <sup>1</sup> .
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 las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>

## Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
29	Aviso de Recomposición		N	1	0	198	198	Este campo se utilizará para indicar el tipo de recomposición 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 de recomposición, si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición 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 identificador correspondiente al estatus vigente de la posición reportada y que se define en el "Catálogo Aviso de Recomposición".
30	Descriptivo		AN	100	0	199	298	Se deberá anotar una breve descripción del activo <sup>4</sup> .
31	Espacios vacíos		AN	121	0	299	419	Vacíos <sup>5</sup> .

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" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento reportado <sup>1</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento reportado <sup>2</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento reportado <sup>2</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento reportado en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento reportado en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de operación		F	8	0	82	89	Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90	97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del forward <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98	113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y denominado en la divisa en que se pactó <sup>6</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114	127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128	147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .
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 cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152	152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
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" <sup>4</sup> .
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 subyacente <sup>1</sup> .

## Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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 deliver <sup>10</sup> .
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 deliver <sup>11</sup> .
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 deberá anotar 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 llenar con ceros <sup>4</sup> .
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 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	214 223	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
22	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	224 233	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera llenar con ceros. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
23	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	234 235	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>4</sup> .
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" <sup>4</sup> .
25	Divisa de Liquidación		N	2	0	238 239	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, 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" <sup>4</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
27	Valor a Mercado		N	12	2	246 259	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
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 mexicanos <sup>5</sup> .
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 las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
30	Descriptivo		AN	100	0	275 374	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
31	Espacios en blanco		AN	45	0	375 419	Vacios <sup>5</sup> .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición Dec. A:	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4 13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>1</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26 34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>2</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>2</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42 61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>3</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62 81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>3</sup> .
8	Fecha de Operación		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el futuro <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del futuro <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98 113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y en la divisa en que se pacte <sup>2</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128 147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
ID	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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 cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152 152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
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" <sup>4</sup> .
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 subyacente <sup>1</sup> .
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 deliver <sup>10</sup> .
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 deliver <sup>11</sup> .
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 deberá anotar 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 llenar con ceros <sup>4</sup> .
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 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Bolsa de Derivados		AN	8	0	214 221	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa 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" <sup>4</sup> .
22	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	222 223	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
24	Divisa de Liquidación		N	2	0	226 227	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación diaria del contrato según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .

## Anexo 111

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0330	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>1</sup> .
26	Valor a Mercado		N	12	2	234 247	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
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 mexicanos <sup>2</sup> .
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 las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
29	Descriptivo		AN	100	0	263 362	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
30	Espacios en blanco		AN	57	0	363 419	Vacios <sup>5</sup> .

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent. Dec.	Posición	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4 13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>1</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26 34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>2</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42 61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62 81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
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 operación <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la opción <sup>1</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98 113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto en la divisa en que se pacte <sup>2</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	9	6	128 142	Se deberá anotar el precio o tasa strike que se pactó en la operación <sup>2</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición	Observaciones
13	Prima Pactada		N	14	6	143 162	Se deberá anotar el importe de la prima que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato, denominada en la divisa de liquidación de la misma <sup>2</sup> .
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" <sup>1</sup> .
15	Opción CALL/PUT		N	1	0	166 166	Se deberá anotar con 1 las opciones CALL y con 2 las opciones PUT <sup>1</sup> .
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 cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
17	Tipo de Operación		N	1	0	171 171	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
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" <sup>4</sup> .
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 subyacente <sup>1</sup> .
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 deliver <sup>10</sup> .
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 deliver <sup>11</sup> .
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 deberá anotar 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 llenar con ceros <sup>4</sup> .
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 19000101 <sup>3</sup> .
24	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	233 242	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
25	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	243 252	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera llenar con ceros. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
26	Divisa de Cotización del Subyacente		N	2	0	253	254	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	257	258	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, 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" <sup>1</sup> .
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 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
30	Valor a Mercado		N	12	2	265	278	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
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 mexicanos <sup>2</sup> .
32	Delta		N	3	8	293	303	Se deberá reportar la delta de la opción y con la cuál se lleva a cabo el cálculo de la Exposición Delta <sup>2</sup> .
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 las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
34	Descriptivo		AN	100	0	305	404	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
35	Espacios vacíos		AN	15	0	405	419	Vacios <sup>5</sup> .

## Anexo 111

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0330	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :	

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" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
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 que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .
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 que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
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 que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .
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 que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
12	Fecha de Operación		F	8	0	162	169	En caso de reportar derivados estandarizados, se deberá 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 operación <sup>3</sup> .
13	Fecha de Vencimiento Flujos a Entregar		F	8	0	170	177	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a entregar en el swap <sup>3</sup> .
14	Fecha de Vencimiento Flujos a Recibir		F	8	0	178	185	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a recibir en el swap <sup>3</sup> .
15	Valor Ncional Flujos a Entregar		N	12	2	186	199	Anotar el valor ncional en valor absoluto de los flujos a entregar en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
16	Valor Ncional Flujos a Recibir		N	12	2	200	213	Anotar el valor ncional en valor absoluto de los flujos a recibir en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
17	Plazo de flujos a entregar		N	3	0	214	216	Anotar el plazo en días de los flujos a entregar <sup>1</sup> .
18	Plazo de flujos a recibir		N	3	0	217	219	Anotar el plazo en días de los flujos a recibir <sup>1</sup> .
19	Intercambio de Nacionales a Vencimiento		N	1	0	220	220	Anotar 1 si se pacta entrega de nacionales al vencimiento de la operación. Anotar cero en otro caso <sup>1</sup> .
20	Tipo de flujos a Entregar		N	1	0	221	221	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 1 <sup>1</sup> .
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 1 <sup>1</sup> .
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 nacionales en distinta divisa. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
23	Tasa de Flujos a Entregar		N	3	4	241	247	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
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 ceros <sup>2</sup> .
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 a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente. En otro caso llenar con ceros <sup>4</sup> .
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 llenar con ceros <sup>4</sup> .
27	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	275	284	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
28	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	285	294	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera llenar con ceros. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
29	Divisa flujos a entregar		N	2	0	295	296	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
30	Divisa flujos a recibir		N	2	0	297	298	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisa" <sup>1</sup> .
31	Divisa nomenclal a entregar		N	2	0	299	300	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nomenclal de los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
32	Divisa nomenclal a recibir		N	2	0	301	302	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nomenclal de los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
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 mexicanos <sup>6</sup> .
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 las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
36	Descriptivo		AN	100	0	320	419	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>

## Anexo 111

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTEO, PRESTAMO DE VALORES E INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Operación asociada a la Garantía.		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el tipo de operación que origino la recepción de las Garantías según el catálogo de "Tipo de Operación asociada a la Garantía" <sup>1</sup> .
3	Identificador de posición de Garantía Recibida		AN	10	0	5	14	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para 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 <sup>4</sup> .
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 reporte, se deberá anotar el "Identificador del Instrumento del Mandato" que se reporta en el "Detalle 1" del presente formato correspondiente a la operación a la que se asocia la garantía <sup>4</sup> .
5	ISIN		AN	12	0	25	36	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se recibe como garantía <sup>2</sup> .
6	CUSIP O CINS		AN	9	0	37	45	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se recibe como garantía <sup>2</sup> .
7	SEDOL		AN	7	0	46	52	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se recibe como garantía <sup>2</sup> .
8	Ticker Bloomberg		AN	20	0	53	72	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento que se recibe en garantía <sup>2</sup> .
9	Ticker Reuters		AN	20	0	73	92	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento que se recibe en garantía <sup>1</sup> .
10	Clase de Activo		N	2	0	93	94	Se deberá anotar el identificador de la clase del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Clase de Activo de la inversión tercerizada" <sup>1</sup> .
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	95	106	Se deberá reportar el número de títulos recibidos en garantía <sup>1</sup> .
12	Precio limpio		N	12	2	107	120	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de las garantías reportadas a precio y en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
13	Intereses devengados		N	12	2	121	134	En este campo se deberán anotar los intereses devengados de las garantías reportadas en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
14	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	135	144	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la cual se reciben las garantías. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
15	Divisa de Cotización		N	2	0	145	146	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
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 ceros <sup>2</sup> .
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 19000101 <sup>3</sup> .
18	Fecha de Emisión		F	8	0	165	172	En caso de estar reportando instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de emisión del instrumento que se reporta. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
19	Descriptivo		AN	100	0	173	272	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
20	Espacios vacíos		AN	147	0	273	419	Vacíos <sup>5</sup> .

## Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
		FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 7: DEPOSITOS 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307" <sup>1</sup> .
2	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	4	13	En caso de reportar depósitos en instituciones financieras se deberá anotar el identificador correspondiente a la Institución Financiera con la cual se realiza el depósito. En caso de reportar aportaciones iniciales mínimas y excedentes 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" <sup>4</sup> .
3	Divisa		AN	2	0	14	15	Se reportará el identificador de la divisa en la cual está denominado el depósito o la aportación según el "Catálogo de Divisas" <sup>5</sup> .
4	Monto en divisa		N	12	2	16	29	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de conciliación <sup>7</sup> .
5	Monto		N	12	2	30	43	Se deberá anotar el valor en pesos mexicanos del depósito o aportación <sup>6</sup> .
6	Espacios vacíos		AN	376	0	44	419	Vacíos <sup>8</sup> .

## Anexo 111

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 FUENTE : CUSTODIOS
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE B: FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRANSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC).

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 "308"¹.
2	Divisa del Flujo		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que se liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas"¹.
3	Tipo de Operación		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 netos totales, para la divisa reportada en el campo 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar y en pesos mexicanos².
5	Espacios vacíos		AN	399	0	21	419	Vacíos².

## CATALOGO(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)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

## Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro

## Anexo 111

	COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo Aviso de Reconposición	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
0	Sin reconposición.
1	Se conserva el instrumento.
2	Se venderá el instrumento.

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 Clase de Activo de la Inversión Tercerizada	
Identificador	Descripción
0	Otro.
1	Mercancías.
2	Renta Variable.
3	Deuda Extranjera.
4	Tipos de Cambio.
5	Con exposición a mas de una clase de inversión.

Catálogo de Tipo de Entrega	
Identificador	Descripción
F	Físico.
D	Diferenciales.

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

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

## Anexo 111

 <b>CONSAR</b> Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0330	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :	

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
99	OTR

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

## Anexo 111

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

Identificador	Descripción
1	Reportos
2	Préstamo de Valores
3	Instrumentos Financieros Derivados

Identificador	Descripción	Abreviación
1	Americana	AM
2	Europea	EU
100	Otros	OT

Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>				
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
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Global</b>				
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

## Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

## Validaciones para formato de los datos

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

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMDD" donde:

DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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 reporte se deberá calcular conforme a lo siguiente:

$$\text{Valor de mercado del reporte} = \text{Monto} \times \frac{\left[ 1 + \frac{\text{Tasa Premio} \times \text{Plazo}}{360} \right]}{\left[ 1 + \frac{\text{Tasa Valuación} \times \text{Días por Vencer}}{360} \right]}$$

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

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

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

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

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

<sup>7</sup> 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.

<sup>8</sup> 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.

**Anexo 111**

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

<sup>9</sup> 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.

<sup>10</sup> 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.

<sup>11</sup> 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.

**POLITICAS ESPECIFICAS DEL PROCESO**

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

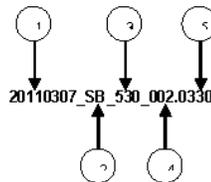
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/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	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAA MMDD".
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 cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social a nombre de quien se transmite la información 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 la información (*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 <b>Constante = "0330"</b> .

**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 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**

## Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0330	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :	

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/custodios/upload/>

## Anexo 112

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0331	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> <sup>1</sup> .
2	Número de Registros		N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado <sup>1</sup> .
3	Tamaño del Registro		N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = <b>Constante "103"</b> <sup>1</sup> .
4	Tipo de Archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0331"</b> <sup>1</sup> .
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad Siefore de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo <sup>1</sup> .
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad Siefore a nombre de quien se reporta la Información de acuerdo al "Catálogo de Entidades Siefores", anexos <sup>1</sup> .
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	27	29	Clave del Subtipo de Entidad de quien se reporta la Información de acuerdo al "Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores", anexos <sup>1</sup> .
8	Fecha de Información		F	8	0	30	37	Fecha de operación que se reporta <sup>3</sup> .
9	Espacios en blanco		AN	66	0	38	103	Vacios <sup>5</sup> .

## SUBENCABEZADO

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) = <b>Constante "101"</b> <sup>1</sup> .
2	Identificador Mandatario		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" <sup>4</sup> .
3	Consecutivo Mandato		AN	7	0	11	17	Deberá ser un consecutivo definido por la Administradora el cual se incrementará para cada mandato 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" <sup>4</sup> .

## Anexo 112

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0331 PROCESO : FINANCIERO FUENTE : CUSTODIOS ACTUALIZACIÓN :

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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" <sup>1</sup> .
5	País del Mandatario		N	2	0	28 29	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países <sup>1</sup> .
6	Fecha de Concertación del Mandato		F	8	0	30 37	Se deberá reportar la fecha en que se pactó el mandato <sup>3</sup> .
7	Espacios en blanco		AN	66	0	38 103	Vacíos <sup>5</sup> .

## DETALLE(S)

En las Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión de las Siefors 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 cual se tiene exposición de manera individual. Derivado de esto, la exposición delta de todas aquellas posiciones de derivados sobre índices o sobre vehículos que replican índices, 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 CATALOGO CORRESPONDIENTE A TODOS LOS ELEMENTOS DE RENTA VARIABLE O MERCANCIAS (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 Ent.	Dec.	Posición Dec.	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301" <sup>1</sup> .

## Anexo 112

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0331		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : CUSTODIOS		ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATALOGO CORRESPONDIENTE A TODOS LOS ELEMENTOS DE RENTA VARIABLE O MERCANCIAS (ACCIONES, MERCANCIAS E INDICES) QUE SERAN 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:	
2	ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único para cada nuevo elemento de Renta Variable o Mercancías, este identificador deberá ser generado para cada nuevo elemento que se integre a este catálogo debido a: -Que alguna posición del mandato esté tomando exposición al elemento y se requiera del identificador para incluirse en los Detalles 1 a 5 del formato de información 0330 en el campo "ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías". -Que alguna posición del mandato esté tomando exposición 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 permanentemente <sup>4</sup> .
3	Nombre Descriptivo		AN	50		14	63	Indicar el nombre descriptivo del elemento de Renta Variable o Mercancía que se esté reportando dentro del catálogo <sup>4</sup> .
4	Ticker de Bloomberg del Componente de Renta Variable o Mercancía.		AN	20	0	64	83	Se deberá reportar el ticker que Bloomberg asigna al elemento de Renta Variable o Mercancía de que se trate <sup>6</sup> .
5	Ticker de Reuters del Componente de Renta Variable o Mercancía.		AN	20	0	84	103	Se deberá reportar el ticker que Reuters asigna al elemento de Renta Variable o Mercancía de que se trate <sup>7</sup> .

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LA DESCOMPOSICIÓN 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302" <sup>1</sup> .
2	ID índice		AN	10	0	4	13	Se deberá anotar el identificador "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" para cada índice contenido en el "Detalle 1" del presente formato de transmisión <sup>4</sup> .
3	ID acciones o mercancías.		AN	10	0	14	23	Se deberá anotar el identificador "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" reportado en el "Detalle 1" del presente formato, correspondiente a cada una de las acciones que componen al índice reportado en el campo anterior <sup>4</sup> .
4	Peso del componente en el índice.		N	3	6	24	32	En este campo se deberá anotar el ponderador 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 información <sup>2</sup> .
5	Espacios vacíos		AN	71	0	33	103	Vacíos <sup>5</sup> .

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 Siefors son la concentración de inversiones por Emisor/Contraparte y la concentración de inversiones correspondientes a Entidades Relacionadas entre Sí.

## Anexo 112

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
FORMATO DEL ARCHIVO :	0331	PROCESO :	FINANCIERO		
FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :			

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 el formato 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 INFORMACION DEL CATALOGO DE RELACION 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		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" <sup>1</sup> .
2	ID Relación de Entidades		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único para cada Entidad agrupadora reportada en el presente detalle y que no podrá ser reutilizado <sup>4</sup> .
3	Nombre		AN	50	0	14	63	Indicar el nombre descriptivo de la entidad grupo que relacionará a los emisores de instrumentos en posición de los mandatarios, contrapartes con los que los mandatarios tengan concertadas operaciones de reporto, de valores en préstamo y derivados, patrocinadores de vehículos y bolsas de derivados previstas en el Detalle 4 del presente formato <sup>4</sup> .
4	Espacios vacíos		AN	40	0	64	103	Vacíos <sup>5</sup> .

**DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DEL CATALOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHICULOS Y BOLSAS DE DERIVADOS.**

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 "304" <sup>1</sup> .
2	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único el cual se incrementará para cada emisor, bolsa de derivados o contraparte, de los valores y operaciones reportados en el formato de transmisión 0330 y que no podrá ser reutilizado <sup>4</sup> .
3	Nombre		AN	20	0	14	33	Indicar el nombre descriptivo del emisor, bolsa de derivados o contraparte reportado <sup>4</sup> .

## Anexo 112

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0331 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DEL CATALOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHICULOS Y BOLSAS DE DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
4	ID Relación de Entidades		AN	10	0	34	43	Se deberá reportar el identificador de relación de entidades reportado en el "Detalle 3" en caso de que aplique, con el cual se relaciona a la entidad reportada en 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 blanco.
5	Primera Calificación CP		N	4	0	44	47	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la calificación 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 inversión <sup>1</sup> .
6	Segunda Calificación CP		N	4	0	48	51	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la segunda calificación 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 inversión <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
9	Primera Calificación LP		N	4	0	56	59	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la calificación 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 inversión <sup>1</sup> .
10	Segunda Calificación LP		N	4	0	60	63	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la segunda calificación 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 inversión <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
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" <sup>1</sup> .
13	Espacios vacíos		AN	36	0	68	103	Vacíos <sup>5</sup> .

## Anexo 112

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0331 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## CATALOGO(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)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
554	BANCOMER
556	AZTECA
562	INVERCAP
564	METLIFE
566	AFIRME
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
654	BANCOMER

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI
454	BANCOMER

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.

## Anexo 112

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0331 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
:	:	:	:	:
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
:	:	:	:	:
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
:	:	:	:	:
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
:	:	:	:	:
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
:	:	:	:	:
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	454	001	BANCOMER (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	454	002	BANCOMER (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	454	003	BANCOMER (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	454	004	BANCOMER (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	454	005	BANCOMER (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	654	001	BANCOMER (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

## Anexo 112

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0331	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :	

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

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

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

## Anexo 112

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0331 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>		

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMDD" donde:

DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda.

<sup>7</sup> El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda.

## Anexo 112

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0331 FUENTE : CUSTODIOS
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

## POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

## Políticas a seguir en la transmisión de la información

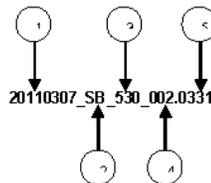
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/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 Dígito Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAA MMDD".
2	2 Dígito 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 Dígito 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 a nombre de quien se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígito Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígito Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0331"</b> .

**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 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/custodios/upload/>

