

SEGUNDA SECCION

PODER EJECUTIVO

SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

CIRCULAR CONSAR 19-14 Modificaciones 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 (Continúa en la Tercera Sección)

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 19-14

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

El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, con fundamento en lo dispuesto en los artículos 5 fracciones I, II, VII y XVI, 12 fracciones I, VIII y XVI, 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 A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.

PRIMERO.- Se **DEROGA** la fracción III de la regla novena de la Circular CONSAR 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro", modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12 y CONSAR 19-13 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012 y 16 de octubre de 2012 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

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

- I. a II. ...
- III. Se deroga;
- IV. a XVIII. ..."

SEGUNDO.- Se **MODIFICAN** los Anexos 30, 43, 65, 72, 74, 75, 77, 78, 79, 92, 97, 107, 109, 111, 112, 114 y 115 y se **DEROGA** el Anexo 76 de la Circular CONSAR 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro", modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12 y CONSAR 19-13, publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012 y 16 de octubre de 2012 respectivamente, para quedar en los términos de los Anexos 30, 43, 65, 72, 74, 75, 77, 78, 79, 92, 97, 107, 109, 111, 112, 114 y 115 de las presentes modificaciones y adiciones.

TRANSITORIA

ÚNICA.- Las presentes reglas entrarán en vigor al día hábil siguiente de su publicación en el Diario Oficial de la Federación, a excepción de los anexos 74, 75, 77, 78, 79, 92, 97, 107, 109, 111 y 112 que entrarán en vigor a los 10 días hábiles siguientes de su publicación en el Diario Oficial de la Federación, así como el anexo 65 el cual entrará en vigor a los 60 días naturales siguientes a la fecha 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 24 de mayo de 2013.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, **Carlos Ramírez Fuentes**.- Rúbrica.

Anexo 30

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	1028	PROCESO: TRASPASOS
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada - Este archivo contiene Información de la dispersión de cuentas solicitadas de Administradora Receptora a Administradora Transferente del proceso de Traspasos Administradora – Administradora y Registro de Prestadora de Servicios.	
PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERIODO DE RECEPCIÓN:
Por Proceso	El segundo día hábil de haber remitido el resultado de la certificación de las solicitudes de traspaso.

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" . ¹
2	Número de Registros		N	5	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
3	Tamaño del Registro		N	3	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "59" . ¹
4	Tipo de Archivo		N	4	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "1028" . ¹
5	Tipo de Entidad		N	3	16 18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. Constante = "007" . ¹
6	Entidad		N	3	19 21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Empresas Operadoras) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
7	Fecha de envío		F	8	22 29	Fecha en que se envía la información a CONSAR. ³
8	Espacios en blanco		AN	30	30 59	Vacios. ⁶

SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante = "101" . ¹
2	Fecha de inicio del período		F	8	4 11	Es la fecha en que inició el período, fecha en que se enviaron a certificar las solicitudes a la empresa operadora. ³
3	Fecha de fin de período		F	8	12 19	Es la fecha en que finalizó el período, fecha en que se liquidan las cuentas. ³ Conforme a la fecha fin del periodo reportado en el anexo 55. Formato AAAAMDD.
4	Tipo de Entidad Receptora		N	3	20 22	Clave de Tipo de Entidad Receptora del Traspaso de acuerdo al Catálogo de tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
5	Entidad Receptora		N	3	23 25	Clave de Entidad Receptora del Traspaso de acuerdo al Catálogo de Entidades de Administradora de Fondos para el Retiro (AFORES) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
6	Espacios en Blanco		AN	34	26 59	Vacios. ⁶

DETALLE(S)

DETALLE 1: RESUMEN DE CUENTAS POR ORIGEN DE TRASPASO						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante = "301" . ¹
2	Tipo de Entidad Transferente		N	3	4 6	Clave de Tipo de Entidad Transferente del Traspaso de acuerdo al Catálogo de tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹ '01' AFORE, '14' PRESTADORA DE SERVICIOS.
3	Entidad Transferente		N	3	7 9	Clave de Entidad Transferente del Traspaso de acuerdo al Catálogo de Entidades del Catálogo General Apartado Circular

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	1028	PROCESO: TRASPASOS
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 1: RESUMEN DE CUENTAS POR ORIGEN DE TRASPASO							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	A:	Observaciones
							19 vigente. ¹
4	Origen del Traspaso		N	2	10	11	Identificador del origen de traspaso, de acuerdo al Catálogo de Origen de Traspaso (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. (Se reportarán todos los Orígenes de traspasos, hacer la conversión para el envío a CON SAR) ¹
5	Total de Solicitudes Recibidas		N	8	12	19	Número de solicitudes para traspaso enviadas a PROCESAR por la Entidad Receptora del Traspaso.
6	Total de Solicitudes Regeneradas de certificación		N	8	20	27	Número de solicitudes que fueron liberadas del status de pendiente relativas a la certificación de cuentas por Entidades Receptoras. ¹
7	Total de solicitudes Regeneradas de Respuestas de Afores Transferente		N	8	28	35	Número de solicitudes que se Regeneraron por no ser Traspaso exitoso en el periodo inmediato anterior (solicitudes que quedaron pendientes de respuesta de la Entidad Transferente a PROCESAR, que fueron rechazadas o tuvieron algún motivo de devolución) ¹
8	Total de Solicitudes Rechazadas		N	8	36	43	Número de solicitudes para traspaso Rechazadas por PROCESAR a la Entidad Receptora. ¹
9	Total de solicitudes pendientes		N	8	44	51	Número de solicitudes aceptadas y en status de pendiente durante el periodo de gestión. ¹
10	Total de solicitudes Aceptadas para Liquidar		N	8	52	59	Número de solicitudes para Traspaso aceptadas por PROCESAR a la Entidad Receptora. ¹

DETALLE 2: OPERACIONES UBICADAS CON MOTIVO DE RECHAZO POR ERRORES DE INFORMACIÓN							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302" . ¹
2	Identificador de Motivo de Rechazo		N	1	4	4	Constante = "1" Motivo de Rechazo. ¹
3	Motivo de Rechazo		N	4	5	8	Clave asignada por la Empresa Operadora, al motivo de rechazo de solicitudes por errores de información, (considerar el catálogo de rechazos del Manual Transaccional respectivo). ¹
4	Número de Solicitudes Rechazadas		N	8	9	16	Número de solicitudes para Traspaso Rechazadas. ¹
5	Espacios en Blanco		AN	43	17	59	Vacios. ⁶

DETALLE 3: RESUMEN DE RECHAZOS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante = "303" . ¹
2	Total de Rechazos por Agente Promotor		N	8	4	11	Número de solicitudes tramitadas por Agente Promotor que fueron rechazadas (Es la suma de las claves correspondientes a los rechazo por Agente Promotor del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").
3	Total de Rechazos por Captura de Datos		N	8	12	19	Número de solicitudes que fueron rechazadas por captura de datos (Es la suma de las claves correspondientes a los rechazo por datos de captura del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").
4	Total de Rechazos por Estado de Cuenta		N	8	20	27	Número de solicitudes que fueron rechazadas por Estado de cuenta (Es la suma de las claves correspondientes a los rechazo por Estado de cuenta del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").
5	Total de Rechazos por Folios		N	8	28	35	Número de solicitudes que fueron rechazadas por Folios (Es la suma de las claves correspondientes a los rechazo por Folios del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	1028	PROCESO: TRASPASOS
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 3: RESUMEN DE RECHAZOS						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
6	Total de Rechazos por Fechas		N	8	36 43	Número de solicitudes que fueron rechazadas por fecha (Es la suma de las claves correspondientes a los rechazo por Fechas del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").
7	Total de Otros Motivos de Rechazo		N	8	44 51	Número de solicitudes que se encuentren rechazadas por otros motivos de rechazo (considerar las claves diferentes a las reportadas en los Id 14 al Id 18 del catálogo "Motivos de Rechazo a Detalle" reportados en el Detalle 2, Id 3 "Motivo de Rechazo").
8	Espacios en Blanco		AN	8	52 59	Vacios. ⁶

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

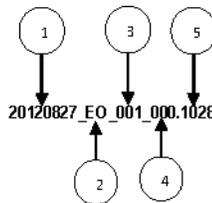
I. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Empresas Operadoras.

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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "EO" .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad EMPRESAS OPERADORAS que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "001" .
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEF ORES, para las demás entidades será Constante = "000")
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "1028" .

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 EMPRESA OPERADORA estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

20120827_EO_001_000.1028.gpg

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	1028	PROCESO:
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	TRASPASOS
			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:

A20120827_EO_001_000.1028

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

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

TIPO DE ACCION	ruta
Envío Normal	export/home/rec/TRASP/RECEPCION
Envío por Retransmisión	export/home/rec/TRASP/RETRANSMISION
Recuperación de Acuse	export/home/rec/TRASP/TRANSMISION

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

⁴ 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.

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

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

Anexo 43

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0702	PROCESO :	RETIROS
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :	

ID DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada - Este archivo contiene la información de la liquidación de las operaciones del proceso de retiros.	
PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERIODO DE RECEPCIÓN:
Mensual	El quinto día hábil posterior al mes de la liquidación de los recursos que se reporta.

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"
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro. Constante= "97" . ¹
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema). Constante = "0702" . ¹
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. Constante = "007" . ¹
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Empresas Operadoras). Constante = "001" . ¹
7	Fecha de Información		F	8	0	22	29	Fecha de envío del archivo a CONSAR. ³
8	Espacios en blanco		AN	75	0	30	104	Vacios. ⁴

SUBENCABEZADO(S)

SUBENCABEZADO 1: Transferencias, Disposiciones y Retiros Parciales								
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"
2	Tipo Entidad		N	3	0	4	6	Clave de Tipo de Entidad de quien se reporta la información de Acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
3	Clave Entidad		N	3	0	7	9	Clave de Entidad de quien se reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Fecha Inicio Periodo		F	8	0	10	17	Fecha de la primera liquidación reportada.
5	Fecha Fin Periodo		F	8	0	18	25	Fecha de la última liquidación reportada.
6	Espacios en blanco		AN	80	0	26	105	Vacios. ⁶

DETALLE(S)

DETALLE 1: Transferencias por fecha de liquidación								
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" .
2	Tipo de Retiro		N	3	0	4	6	De acuerdo al Catálogo Tipo de Retiro (Información agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente
3	Siefore		N	2	0	7	8	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00)
4	Retiro 97		N	11	2	9	21	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 97
5	Cesantía y Vejez		N	11	2	22	34	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
6	Cuota Social		N	11	2	35	47	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cuota Social
7	Vivienda 97		N	11	2	48	60	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 97
8	Número de Registros		N	10	0	61	70	Número de Registros con estas características
9	Resultado del diagnóstico		N	1	0	71	71	1 - Procedentes 2 - No procedentes
10	Fecha de liquidación		F	8	0	72	79	Fecha de liquidación
11	Espacios en blanco		AN	26	0	80	105	Vacios. ⁹



DETALLE 2: Disposición por fecha de liquidación

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 = "302".
2	Tipo de Retiro		N	3	0	4	6	De acuerdo al Catálogo Tipo de Retiro (Información agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
3	Siefore		N	2	0	7	8	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00)
4	Retiro 97		N	11	2	9	21	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 97
5	Cesantía y Vejez		N	11	2	22	34	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
6	Cuota Social		N	11	2	35	47	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cuota Social
7	Retiro 92		N	11	2	48	60	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 92
8	Vivienda 92		N	11	2	61	73	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 92
9	Vivienda 97		N	11	2	74	86	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 97
10	Número de Registros		N	10	0	87	96	Número de Registros con estas características
11	Resultado del diagnóstico		N	1	0	97	97	1 - Procedentes 2 - No procedentes
12	Fecha de liquidación		F	8	0	98	105	Fecha de liquidación

DETALLE 3: Parciales por fecha de liquidación

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".
2	Prestación		N	2	0	4	5	De acuerdo al Catálogo Tipo de Prestación del Catálogo General vigente.
3	Tipo de Proceso de Retiro		N	1	0	6	6	De acuerdo al Catálogo de Tipo de Proceso de Retiros por Desempleo del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Clasificación de Pago		N	1	0	7	7	De acuerdo al Catálogo de Clasificación de Pago del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
5	Monto pagado RCV		N	11	2	8	20	Monto Pagado al Trabajador
6	Número de Registros		N	10	0	21	30	Número de Registros con estas características
7	Resultado del diagnóstico		N	1	0	31	31	1 - Procedentes 2 - No procedentes
8	Fecha de liquidación		F	8	0	32	39	Fecha de liquidación
9	Espacios en blanco		AN	86	0	40	105	Vacios.*

DETALLE 4: Cuentas por Subcuenta (SAR 92)

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 = "304".
2	Tipo de Retiro		N	3	0	4	6	De acuerdo al Catálogo Tipo de Retiro (Información agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
3	Subcuenta		N	3	0	7	9	CONSTANTE "17", Clave de la Subcuenta de acuerdo al Catálogo de Clave de Subcuentas (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19.
4	Número de Registros		N	10	0	10	19	Número de Registros con estas características
5	Espacios en blanco		AN	86	0	20	105	Vacios.*

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Empresas Operadoras.

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0702	PROCESO :
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :
			RETIROS

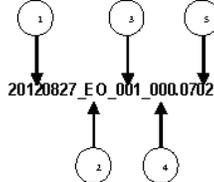
II. Sólo será transmitida la información de las operaciones de Liquidación 101, 104 y 016 del proceso que se realicen durante el procedimiento operativo diario (los procesos y operaciones que no tengan operación no serán transmitidos)

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 que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General del Apartado de la Circular 19 vigente, Constante = "EO" .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad EMPRESAS OPERADORAS que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General del Apartado de la Circular 19 vigente, Constante = "001" .
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será Constante = "000" ").
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0702" .

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 EMPRESA OPERADORA estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

20120827_EO_001_000.0702.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:

A20120827_EO_001_000.0702

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

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

TIPO DE ACCION	RUTA
Envío Normal	export/home/rec/RETIR/RECEPCION
Envío por Retransmisión	export/home/rec/RETIR/RET RANSMISION
Recuperación de Acuse	export/home/rec/RETIR/TRANSMISION

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

TIPO DE ACCION	RUTA
Envío Pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/RECEPCION

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0702	PROCESO :	RETIROS
	FUENTE :	EMPRESA OPERADORA	ACTUALIZACIÓN :	

Recuperación de Acuse de pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/TRANSMISION
----------------------------------	---

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

³ Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:
DD = día
MM = mes
AAAA = año

⁴ Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:
DD = día
MM = mes
AAAA = año

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

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

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

Anexo 65

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO		
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0402 FUENTE : AFORES	PROCESO : SUCURSALES ACTUALIZACIÓN :

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada - Actualización de datos generales de establecimientos de atención a clientes.	
PERIODICIDAD DE ENVÍO: Mensual	PERIODO DE RECEPCIÓN: Quinto día hábil posterior al mes que se reporta.

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante= "000" ¹
2	Tipo de Archivo		N	4	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema). Constante= "0402" ¹
3	Tipo de Entidad		N	3	8	10	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "001" ¹
4	Entidad		N	3	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (AFORES), del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
5	Fecha de envío		F	8	14	21	Fecha de la operación que se reporta. ³
6	Tamaño del Registro		N	3	22	24	Número de caracteres por registro. Constante= "199" ¹
7	Número de Registros		N	5	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
8	Espacios en blanco		AN	170	30	199	Vacios. ⁶

DETALLE(S)

DETALLE 1: INFORMACIÓN DE LOS ESTABLECIMIENTOS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante= "301" ¹
2	Clave de Establecimiento		N	5	4	8	Es el identificador que la Administradora de al establecimiento que reporta. ¹
3	Servicios que ofrece el establecimiento		N	2	9	10	Es el identificador del tipo de servicio que se está reportando, según Catálogo de Tipo de Servicios del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
4	Tipo de establecimiento		N	2	11	12	Es el identificador del Tipo de establecimiento que se esta reportando, según catálogo de Tipo de Establecimiento del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. ¹
5	Calle		AN	50	13	62	Es la calle del establecimiento. ⁵
6	Número		AN	20	63	82	Es el número de la establecimiento (en algunos casos hay número interior o exterior) ⁵
7	Colonia		AN	30	83	112	Es la colonia del establecimiento. ⁵
8	Código Postal		AN	5	113	117	Es el código postal del establecimiento. ⁵
9	Ciudad		AN	30	118	147	Es la ciudad donde se encuentra el establecimiento. ⁵
10	Estado		N	2	148	149	Es el identificador de la Entidad Federativa en donde se encuentra el establecimiento, de acuerdo al Catálogo de Entidades Federativas del Catálogo General Vigente. ¹
11	Teléfono		AN	50	150	199	Es el(los) teléfono(s) del establecimiento. ⁵

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0402	PROCESO :	SUCURSALES
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :	

³ Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:
 DD = día
 MM = mes
 AAAA = año

⁴ Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:
 DD = día
 MM = mes
 AAAA = año

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

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

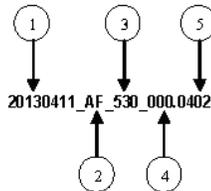
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán las (AFORES)
- II. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "AF" .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Afores que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será Constante = "000")
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0402" .

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 Afore XXI BANOORTE estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

20130411_AF_530_000.0402.gpg

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0402	PROCESO :
	FUENTE :	AFORES	SUCURSALES
			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:

A20130411_AF_530_000.0402

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

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

TIPO DE ACCION	ruta
Envío Normal	export/home/rec/SUCUR/RECEPCION
Envío Retransmisión	export/home/rec/SUCUR/RETRANSMISION
Recuperación de Acuse	export/home/rec/SUCUR/TRANSMISION

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 72

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0503 FUENTE : ENTIDAD RECEPTORA
	PROCESO : RECAUDACION ACTUALIZACIÓN:

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada.- Este archivo contiene la Información de la recaudación diaria realizada por las Entidades Receptoras	
PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERIODO DE RECEPCIÓN:
Diario	Diario

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (control del sistema). Constante = "000"
2	Tipo de Archivo		N	4	4	7	Identificador de archivo (control del sistema). Constante = "0503" . ¹
3	Tipo de Entidad que reporta		N	3	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19. Constante = "012" . ¹
4	Entidad que reporta		N	3	11	13	Clave de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades Receptoras del Catálogo General Apartado Circular 19. ¹
5	Fecha de envío de la información		F	8	14	21	Fecha de la operación que se reporta. ³
6	Tamaño del Registro		N	3	22	24	Número de caracteres por registro. Constante = "073" . ¹
7	Número de Registros		N	5	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
8	Espacios en blanco		AN	44	30	73	Vacios. ⁶

DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LOS IMPORTES DEPOSITADOS EN BANXICO							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1	3	Identificador de registro (control del sistema). Constante = "301" .
2	Fecha de pago		F	8	4	11	Fecha de la operación que se reporta. La operación que se reporta es la de 3 días hábiles anteriores a la fecha del envío del archivo. ³
3	Fecha valor		F	8	12	19	Fecha en que los recursos fueron depositados en Banco de México. ³
4	Tipo de Determinación		N	2	20	21	Ver catálogo Tipo de Determinación del Catálogo General Apartado Circular 19. ¹
5	Concepto de Recaudación		N	2	22	23	Ver Catálogo de Conceptos de Recaudación del Catálogo General Vigente. ¹
6	Importe		N	14,2	24	39	Monto Recaudado. ²
7	Espacios en blanco		AN	34	40	73	Vacios. ⁶

CON SAR		FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0503	PROCESO :	RECAUDACION
FUENTE :	ENTIDAD RECEPTORA	ACTUALIZACIÓN:	

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE IMPORTES DEPOSITADOS EN SUA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Identificador de registro (control del sistema). Constante = "302" .
2	Fecha de pago		F	8	4 11	Fecha de la operación que se reporta. La operación que se reporta es la de 3 días hábiles anteriores a la fecha del envío del archivo. ³
3	Fecha valor		F	8	12 19	Fecha en que los recursos fueron depositados en Banco de México. ³
4	Tipo de Determinación		N	2	20 21	Tipo de Determinación SUA. Constante = "02" . ¹
5	Tipo de Pago		N	2	22 23	Ver catálogo de Tipo de Pago Recaudación IMSS del Catálogo General Apartado Circular 19. ¹
6	Concepto de Recaudación		N	2	24 25	Ver catálogo de Catálogo de Conceptos de Recaudación del Catálogo General Vigente. ¹
7	Importe		N	14,2	26 41	Monto recaudado por Tipo de Pago. ²
8	Espacios en blanco		AN	32	42 73	Vacios. ⁶

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL NÚMERO DE TRANSACCIONES EN SUA Y LÍNEAS DE CAPTURA (SIPARE)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	1 3	Identificador de registro (control del sistema). Constante = "303" .
2	Fecha de pago		F	8	4 11	Fecha de la operación que se reporta. La operación que se reporta es la de 3 días hábiles anteriores a la fecha del envío del archivo. ³
3	Pagos patronales		N	10	12 21	Número Total de pagos patronales recibidos. ¹
4	Pagos con SUA		N	10	22 31	Número de pagos patronales recibidos con SUA. ¹
5	Pagos con Líneas de Captura		N	10	32 41	Número de pagos patronales recibidos con Líneas de Captura a través de SIPARE. ¹
6	Importe de pagos con SUA		N	14,2	42 57	Monto liquidado por pagos con SUA. ²
7	Importe de pagos con Líneas de Captura		N	14,2	58 73	Monto liquidado por pagos con Líneas de Captura (SIPARE). ²

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

³ Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:
DD = día
MM = mes
AAAA = año

⁴ Periodo. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:
DD = día
MM = mes
AAAA = año

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0503	PROCESO : RECAUDACION	
	FUENTE :	ENTIDAD RECEPTORA	ACTUALIZACIÓN:

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

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

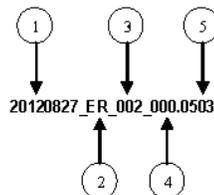
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato se sujetará a las siguientes políticas:

- I. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Entidades Recaudadoras.
- II. Para la unificación de criterios en el envío de información de cantidades monetarias, en este layout se tendrá que observar lo siguiente:
Se deberán reportar **sin signo (+/-)** todos los importes notificados por la Entidad Receptora.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión es el siguiente:

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, conforme al Catálogo de Tipos de Entidad. Constante = "ER" .
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Recaudadora que se reporta conforme al catálogo de entidades.
4	3 DÍgitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será la Constante = "000")
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número. Para este caso será la Constante = "0503" .

NOTA: La separación entre el paso 1, 2, 3 y 4 será 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 Recaudadora Banamex envía su información a través del archivo 0503:



Cabe mencionar que una vez teniendo el archivo con este nombre, deberá encryptarse con el programa GnuPG, el cual lo renombrará de la siguiente manera:

20120827_ER_002_000.0503.gpg

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

A20120827_ER_002_000.0503

NOTA: No se tomará en cuenta la extensión .gpg en la recuperación del acuse y éste no estará encryptado, tal y como lo muestra el ejemplo.

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0503	PROCESO : RECAUDACION	
	FUENTE :	ENTIDAD RECEPTORA	ACTUALIZACIÓN:

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

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

Las rutas de envío a CONSAR para pruebas serán:

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

Anexo 74

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

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

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" . ¹
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ³
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "077" . ¹
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "1101" . ¹
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. ¹
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexas. ¹
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. ¹
8	Fecha de Operación		F	8 0	25 32	Fecha de la operación que se reporta a CONSAR. ³
9	Espacios en blanco		AN	45 0	33 77	Vacios. ⁶

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) = Constante "301" . ¹
2	Clave de Cuenta		N	4 0	4 7	Es la clave de la Cuenta Mayor de acuerdo al Catálogo de Cuentas Contables Vigente. ¹
3	Clave de Subcuenta		N	6 0	8 13	Clave de la Subcuenta de acuerdo al Catálogo de Subcuentas Vigente. ¹
4	Saldo Inicial		N	14 2	14 29	Saldo de la Cuenta o Subcuenta (debe ser el saldo final del día anterior). ²
5	Cargos		N	14 2	30 45	Cargos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante el día. ²
6	Abonos		N	14 2	46 61	Abonos realizados a la Cuenta o Subcuenta durante el día. ²
7	Saldo Final		N	14 2	62 77	Saldo de cierre de Cuenta o Subcuenta al final del día. ²

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
002	SIEFORES BASICA	SB
003	SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS	AC
004	SIEFORES PREVISION SOCIAL	PS
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
011	ICEFAS	IC
013	BANXICO	BX
014	PRESTADORAS DE SERVICIO	PT
016	COMISIONES	CM
017	SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS	AV
018	S. D. INDEVAL	ID
019	CUSTODIOS DE LAS SIEFORES	CS
020	INSTITUTOS	IN
030	PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS	VP

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
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
630	XXI BANORTE

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 BANORTE

Anexo 74

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

Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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 BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SUPA (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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	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.

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

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

Anexo 74

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con éste.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. 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. 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.

Anexo 74

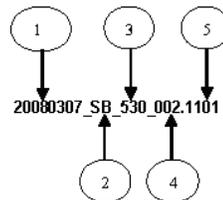
Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 1101 FUENTE : SIEFORES
	PROCESO : CONTABLE ACTUALIZACIÓN :

- VIII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
 IX. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "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 Constante = "1101" .

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

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



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

20080307_SB_530_002.1101.gpg

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

A20080307_SB_530_002.1101

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

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

TIPO DE ACCION	RUTA
Envío Normal	export/home/rec/CONTA/RECEPCION

Anexo 74

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

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

Información de Tipo Agregada - Este archivo contiene Información del desglose de operaciones de compraventa durante el día.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	203	16:00 a 20:00 Hrs.

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". ¹
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado.
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante "203". ¹
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0316". ¹
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. ¹
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. ¹
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. ¹
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de la Operación que se reporta. ³
9	Espacios en blanco		AN	171	0	33	203	Vacios. ⁸

DETALLE(S)

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
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". ¹
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. ¹
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 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. ¹

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 ¹ .
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento ¹ .
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹²
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹³
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹⁴
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. ⁵
10	Emisora		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. ⁵
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. ¹⁵
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. ¹⁵
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación ³ .
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77	88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. ¹
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²

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
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104 118 Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que los valores reportados no cuenten con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo 15 del presente formato "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Monto total a liquidar/ 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. ²
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135 140 Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141 146 Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
20	Divisa		N	2	0	147 148 Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. ¹
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149 163 Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ^{2,9}
22	País de adquisición		N	2	0	164 165 Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países ¹ .
23	Contraparte		N	6	0	166 171 Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13 se deberá llenar con ceros. ¹
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172 175 Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros ¹⁰ .
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176 176 Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si=1 y No=0 ¹ .

Anexo 75

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

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
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 ¹ .
27	Sistema de concertación		N	2	0	178 179 En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – Accipresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO ¹ .
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 ¹ .
29	Clase de Activo de la Inversión tercerizada		N	3	0	181 183 En caso de ser inversión tercerizada se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de Activos de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros ¹ .
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 ⁶ .

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

Anexo 75

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

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
630	XXI BANORTE

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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 BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres

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
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV 1)	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	630	001	XXI BANORTE (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.

Catálogo de Divisa

Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano

Catálogo de Tipo de Instrumento

Id	Abreviación	Descripción
1	BCC	Bono Cupón Cero
2	BTF	Bono Tasa Fija

Anexo 75

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
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
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

Catálogo de Clase de Activos de Inversión Tercerizada

Anexo 75

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

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
16	Japón	36	Otro
17	Luxemburgo	37	Rumanía

Anexo 75

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

Catálogo de Países

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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	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	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 Agenda en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082009	Banamex Agenda 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.

Anexo 75

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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	Intercom Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	Bull Tick 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	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	Eurofimes, 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	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)

Anexo 75

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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 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

Anexo 75

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			Options E xchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapur Stock E xchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelarte	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity E xchange 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	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040145	Banco Base	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
046048	Citibank (Banamex USA)	801153	Pershing Inc.
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801154	Calyon Financial Inc.
076000	Otros Operadores	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076001	Derfin	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076008	Stock & Price	801157	Segregación de Instrumentos
076010	Scotia Inverlat Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados	801159	Reclasificaciones
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801160	Acciones Propias
076022	Darka	801161	Cortes Transversales
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801162	Bank West
076043	Timber Hill LLC.	801163	Bcpbank Canada
076044	Enlace Derivados	801164	Bridgewater Bank
076048	Intercan Derivados	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801166	Canadian Tire Bank
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc.-Delaware, E.U.A.	801168	Citizens Bank Of Canada
079005	Intermex Holding, S.A.-Luxemburgo	801169	Cs Alterna Bank
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán	801170	Dundee Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801172	General Bank Of Canada

Anexo 75

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801174	Manulife Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust – Islas Caimán	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079018	B.I. Remittances Company.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801180	Suntrust Bank
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801182	Fia Card Svc N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801183	Regions Bank
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801184	National City Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801185	Branch Bkg & TC
079028	BBVA Bancomer USA	801186	State Street B&TC
079029	Dinero Express	801187	Countrywide Bank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801188	Pnc Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801189	Keybank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801191	North Fork Bank
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801192	Manufacturers & Traders Tc
080001	Acci Securities Incorporated	801193	Bank Of The West
080004	Afin Securities International Limited	801194	Fifth Third Bank
080005	Arka Securities Incorporated	801195	Northern TC
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801196	Goldman Sachs Paris
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	900000	Otros mandatarios
080013	Vectormex Incorporated	900001	Schroders Plc.
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080015	Vectormex International Incorporated	910000	Otras Bolsas de Derivados
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

Anexo 75

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAA = año

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

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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.

POLITICAS GENERALES DEL PROCESO

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

1º ISIN, de no existir éste,

Anexo 75

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

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.

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

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;

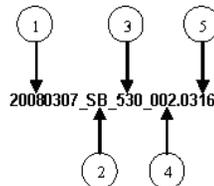
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles 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 Constante = "0316" .

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

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

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



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

20080307_SB_530_002.0316.gpg

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

A20080307_SB_530_002.0316

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 77

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada. - Este archivo contiene información del desglose de operaciones con instrumentos financieros derivados (Forwards, Futuros, Opciones y Swaps).			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	653	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". ¹
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ³
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "653". ¹
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0314". ¹
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. ¹
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. ¹
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. ¹
8	Fecha de Información		F	8 0	25 32	Fecha de la Información que se reporta. ³
9	Espacios en blanco		AN	621 0	33 653	Vacios. ⁸

DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN 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". ¹
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	Sedol		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4 0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7 0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10 0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
9	Estatus de operación		N	3 0	59 61	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. ¹
10	Tipo de Operación		N	3 0	62 64	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. ¹

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 65 82	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
12	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 83 85	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. ¹
13	Divisa de Liquidación		N	2	0 86 87	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la Administradora, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹
14	Plazo de referencia		N	4	0 88 91	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
15	Fecha de operación		F	8	0 92 99	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ⁴
16	Fecha de inicio		F	8	0 100 107	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor o no. ³
17	Fecha de liquidación		F	8	0 108 115	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. ³
18	Fecha de Vencimiento		F	8	0 116 123	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es la fecha en que desaparece la operación en el layout. ³
19	Tamaño del contrato		N	14	2 124 139	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
20	Número de contratos		N	14	0 140 153	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 154 156	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
22	Precio o Tasa pactada		N	14	7 157 177	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²
23	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0 178 183	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. ⁵
24	Entrega física o diferenciales		AN	1	0 184 184	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵

Anexo 77

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

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
25	Tipo de Valor del Cheapest to Deliver		AN	4	0	185	188	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
26	Emisora del Cheapest to Deliver		AN	7	0	189	195	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
27	Serie del Cheapest to Deliver		AN	6	0	196	201	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
28	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	202	210	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. ²
29	Medio de Concertación		N	1	0	211	211	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
30	Contraparte		N	8	0	212	219	Identificador de la Contraparte en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
31	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	220	239	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista identificador para la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
32	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	240	242	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
33	Calificación contraparte primera		N	4	0	243	246	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso contrario reportar ceros. ¹
34	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	247	249	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
35	Calificación contraparte segunda		N	4	0	250	253	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En caso contrario reportar ceros. ¹
36	Observaciones y características especiales		AN	150	0	254	403	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
37	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	404	423	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵

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	
38	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	424 437	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
39	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	438 445	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
40	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	446 465	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
41	Socio Operador		N	8	0	466 473	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
42	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	474 493	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Socio Liquidador		N	8	0	494 501	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
44	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	502 521	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
45	Cámara de Compensación		N	8	0	522 529	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
46	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	530 549	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵

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	
47	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	550 563	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrán agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
48	Espacios en blanco		AN	90	0	564 653	Vacios. ²

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
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 "302". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
9	Estatus de operación		N	3	0	59 61	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. ¹
10	Tipo de Operación		N	3	0	62 64	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. ¹
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	65 72	Se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. ¹
12	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	73 92	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
13	Subyacente		AN	18	0	93 110	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵

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	
14	Divisa de Liquidación		N	2	0	111 112	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas ¹ .
15	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	113 115	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato ¹ .
16	Plazo de referencia		N	4	0	116 119	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
17	Fecha de operación		F	8	0	120 127	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
18	Fecha de inicio		F	8	0	128 135	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. ³
19	Fecha de liquidación		F	8	0	136 143	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. ³
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0	144 151	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. ³
21	Tamaño del contrato		N	14	2	152 167	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto ² en la divisa pactada. ²
22	Número de contratos		N	14	0	168 181	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	182 184	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas ¹ .
24	Precio o Tasa pactada		N	14	7	185 205	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	206 211	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas ⁵ .
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	212 212	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵
27	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	213 216	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
28	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	217 223	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
29	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	224 229	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	230 238	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. ²
31	Observaciones y características especiales		AN	150	0	239 388	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
32	Medio de Concertación		N	1	0	389 389	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹

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	
33	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	390 409	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
34	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	410 423	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
35	Socio Operador		N	8	0	424 431	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
36	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	432 451	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". ⁵
37	Socio Liquidador		N	8	0	452 459	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. ¹
38	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	460 479	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
39	Cámara de Compensación		N	8	0	480 487	Se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. ¹
40	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	488 507	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
41	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	508 521	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
42	Espacios en blanco		AN	132	0	522 653	Vacíos. ⁶

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. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". ¹
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	Sedol		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4 0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7 0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10 0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
9	Estatus de operación		N	3 0	59 61	Se registrará el Identificador 1 o 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo 1
10	Clave de Bolsa de Derivados		N	8 0	62 69	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
11	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20 0	70 89	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
12	Tipo de opción		N	3 0	90 92	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. ¹
13	Subclase de opción		N	3 0	93 95	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. ¹
14	Entrega física o diferenciales		AN	1 0	96 96	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵
15	Subyacente		AN	18 0	97 114	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
16	Divisa de Liquidación		N	2 0	115 116	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la Administradora, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹

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	Posición	Observaciones	
17	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	117 119	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato ¹
18	Plazo de referencia		N	4	0	120 123	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
19	Fecha de la operación		F	8	0	124 131	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
20	Fecha de inicio		F	8	0	132 139	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. ³
21	Fecha de Liquidación		F	8	0	140 147	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. ³
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	148 155	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. ³
23	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	156 163	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. ³
24	Tipo de operación		N	3	0	164 166	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. ¹
25	Tamaño del contrato		N	14	2	167 182	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
26	Número de contratos		N	14	0	183 196	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
27	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	3	0	197 199	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	200 214	Se deberá anotar el strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
29	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	215 229	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
30	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	230 244	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
31	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	245 250	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. ⁵
32	Prima Pactada		N	14	6	251 270	Se deberá anotar el monto de la prima en pesos, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. ²
33	Contraparte		N	8	0	271 278	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 según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
34	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	279 298	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. ⁵
35	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	299 301	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ⁵

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	Posición	Observaciones	
36	Calificación primera contraparte		N	4	0	302 305	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 crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
37	Calificadora segunda Contraparte		N	3	0	306 308	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
38	Calificación segunda contraparte		N	4	0	309 312	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 otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
39	Observaciones características especiales Y		AN	150	0	313 462	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
40	Medio de Concertación		N	1	0	463 463	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
41	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	464 483	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
42	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	484 491	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura. ²
43	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	492 505	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
44	Socio Operador		N	8	0	506 513	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
45	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	514 533	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
46	Socio Liquidador		N	8	0	534 541	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. ¹ En caso contrario reportar con ceros. ¹

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	Posición	Observaciones	
47	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	542 561	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
48	Cámara de Compensación		N	8	0	562 569	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existiera el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
49	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	570 589	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
50	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	590 603	Se deberá reportar ceros de manera constante. ¹
51	Espacios en blanco		AN	50	0	604 653	Vacios. ⁵

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
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 "304". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
9	Estatus de operación		N	3	0	59 61	Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. ¹
10	Fecha de operación		F	8	0	62 69	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
11	Tipo de Posición		N	1	0	70 70	En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una Bolsa de Derivados, y en la cual, la posición en relación al precio publicado en vector por el Proveedor de Precios sea corta, se deberá reportar 2. Se deberá reportar 1 en otro caso. ¹
12	Fecha de inicio		F	8	0	71 78	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. ³
13	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	79 81	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. ¹
14	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	82 84	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. ¹
15	Fecha de próxima liquidación a entregar		F	8	0	85 92	Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo. ³
16	Fecha de próxima liquidación a recibir		F	8	0	93 100	Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo. ³
17	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	101 104	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. ¹
18	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	105 108	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. ¹

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 entregar		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. ¹
20	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	112 114	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. ¹
21	Número de cupones a entregar		N	3	0	115 117	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. ¹
22	Número de cupones a recibir		N	3	0	118 120	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. ¹
23	Valor notional		N	14	6	121 140	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). ²
24	Valor notional 2		N	14	6	141 160	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). ²
25	Tipo de cambio pactado		N	12	6	161 178	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. ²
26	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	179 184	En caso de que las divisas asociadas a los notacionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al notional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al notional a recibir, según el catálogo de divisas. En caso contrario, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones la divisa asociada a ambos notacionales. ⁵
27	Divisa del notional a entregar		N	3	0	185 187	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Divisa del notional a recibir		N	3	0	188 190	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. ¹
29	Divisa de Liquidación		N	2	0	191 192	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que entregará la Siefore. ¹
30	Subyacente a entregar		AN	18	0	193 210	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
31	Subyacente a recibir		AN	18	0	211 228	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
32	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	229 234	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas. ⁵
33	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	235 240	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas. ⁵
34	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	241 256	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. ²

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	
35	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	257 272	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. ²
36	Sobretasa a entregar		N	3	2	273 277	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. ²
37	Sobretasa a recibir		N	3	2	278 282	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. ²
38	Tipo tasa a entregar		N	3	0	283 285	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. ¹
39	Tipo tasa a recibir		N	3	0	286 288	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. ¹
40	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	289 298	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. ⁵
41	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	299 308	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. ⁵
42	Amortiza Capital		N	1	0	309 309	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. ¹
43	Tipo de intercambios		N	3	0	310 312	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. ¹
44	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	313 320	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
45	Nombre Corto de Bolsa de Derivados		AN	20	0	321 340	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
46	Contraparte		N	8	0	341 348	Identificador de la Contraparte en caso de que el swap se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
47	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	349 368	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
48	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	369 371	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
49	Calificación contraparte primera		N	4	0	372 375	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
50	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	376 378	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹

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	
51	Calificación contraparte segunda		N	4	0	379 382	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
52	Medio de Concertación		N	1	0	383 383	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
53	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	384 403	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
54	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	404 417	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
55	Observaciones y características especiales		AN	117	0	418 534	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
56	Socio Operador		N	8	0	535 542	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
57	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	543 562	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
58	Socio Liquidador		N	8	0	563 570	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
59	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	571 590	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
60	Cámara de Compensación		N	8	0	591 598	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹

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	
61	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	599 618	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
62	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	619 632	Se deberá reportar ceros de manera constante. ¹
63	Espacios en blanco		AN	21	0	633 653	Vacios. ⁵

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 Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
9	Tipo de Cupón		N	1	0	59	59	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. ¹
10	Numero de Cupón		N	3	0	60	62	Comenzando con el cupón vigente. ¹
11	Fecha Inicio		F	8	0	63	70	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. ³
12	Fecha Final		F	8	0	71	78	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. ³
13	Días de cupón		N	3	0	79	81	Días de cupón. ¹
14	Monto de referencia para amortizar		N	14	6	82	101	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor nocional. ²
15	Nocional		N	14	6	102	121	Se deberá anotar el monto del valor nocional del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. ²
16	Subyacente		AN	18	0	122	139	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
17	Sobretasa		N	3	2	140	144	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. ²
18	Observaciones Características Especiales	⁰	AN	50	0	145	194	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵

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	
19	Fecha Inicial de Vigencia del cupón		F	8	0	195 202	Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. ³
20	Fecha Final de Vigencia del cupón		F	8	0	203 210	Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap. ³
21	Espacios en blanco		AN	443	0	211 653	Vacios. ⁶

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MINIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS. A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados. La cifra de aportaciones iniciales mínimas reportada en este detalle deberá ser igual a la reportada en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)", los excedentes de aportaciones iniciales mínimas deberán ser reportados en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)".

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306". ¹
2	Tipo Garantía		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el identificador del tipo de la garantía conforme al catálogo Tipo de Garantía. ¹
3	ISIN de la Garantía		AN	12	0	5	16	En caso de reportarse valores, se deberá anotar el ISIN proporcionado por el proveedor de precios. En caso contrario se llenará con ceros. ⁵
4	Cusip o Cins de la Garantía		AN	9	0	17	25	En caso de reportarse valores, se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. En caso contrario se llenará con ceros. ⁵
5	Sedol de la Garantía		AN	7	0	26	32	En caso de reportarse valores, se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionado por el proveedor de precios. En caso contrario se llenará con ceros. ⁵
6	Tipo de Valor de la Garantía		AN	4	0	33	36	Se deberá reportar la clave del tipo de valor otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar el tipo de valor asignado por el proveedor de precios al tipo de cambio correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EF". ¹⁵
7	Emisora de la Garantía		AN	7	0	37	43	Se deberá reportar la clave de la emisora otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la emisora asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EFECTIV". ¹⁵
8	Serie de la Garantía		AN	7	0	44	50	Se deberá reportar la serie otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la serie asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. ¹⁵
9	Consecutivo de la Garantía		AN	10	0	51	60	Se deberá reportar en cero justificado a la izquierda. ¹⁵

Anexo 77

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

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MÍNIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS.

A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados. La cifra de aportaciones iniciales mínimas reportada en este detalle deberá ser igual a la reportada en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)", los excedentes de aportaciones iniciales mínimas deberán ser reportados en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)".

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
10	Contraparte de la Garantía		N	8	0	61 68	Identificador de la Contraparte en caso de que la garantía se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
11	Nombre corto de la contraparte de la garantía		AN	20	0	69 88	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. ⁵
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	89 96	En el caso que las posiciones de derivados asociadas a la garantía se encuentren listadas en una Bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
13	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	97 116	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
14	Socio Liquidador		N	8	0	117 124	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
15	Nombre Corto Socio liquidador		AN	20	0	125 144	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
16	Cámara de Compensación		N	8	0	145 152	En caso de que las posiciones de derivados asociadas a las garantías utilicen una Cámara de Compensación para su liquidación, se deberá reportar su identificador de acuerdo al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
17	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	153 172	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
18	Número de títulos		N	14	0	173 186	Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá anotar el número de títulos respecto de la garantía recibida o entregada. Para el caso de efectivo en divisas se deberá reportar el monto nominal de divisas entregadas o recibidas. Para el caso de garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos. ¹

Anexo 77

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

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MÍNIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS.
A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados. La cifra de aportaciones iniciales mínimas reportada en este detalle deberá ser igual a la reportada en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)", los excedentes de aportaciones iniciales mínimas deberán ser reportados en el "Detalle 8: Depósitos bancarios de dinero a la vista realizados en instituciones de crédito" del FTIP 0300 bajo el concepto "Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)".

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
19	Valor Unitario a Mercado		N	9	6	187 201	Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá reportar el valor a mercado unitario en pesos de acuerdo al proveedor de precios. Para el caso de las garantías entregadas o recibidas en divisas, se deberá anotar el tipo de cambio de la divisa contra el peso de acuerdo al proveedor de precios. Para el caso de las garantías en pesos se deberá reportar 1. ²
20	Valor de mercado en pesos de la garantía		N	14	6	202 221	Para el caso de valores entregados o recibidos en garantía se deberá anotar el valor total a mercado de las garantías con respecto a los precios del proveedor de precios a la fecha de envío. Para el caso de las garantías en efectivo en divisas, se deberá reportar el monto entregado o recibido en pesos actualizado con el tipo de cambio a la fecha de envío. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos entregado o recibido. ¹
21	Valor de mercado en divisa		N	14	6	222 241	Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado en la divisa origen. ¹
22	Intereses Devengados		N	14	2	242 257	Importe de los Intereses devengados en pesos de las garantías a la fecha del reporte. ²
23	Divisa de la Garantía		N	2	0	258 259	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. ¹
24	Espacios en blanco		AN	394	0	260 653	Vacios. ⁵

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACIÓN 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". ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
8	Serie		AN	6	0	44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aamddd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹

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
11	Tipo de Operación		N	3	0	63 65	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1 - Largo 2 - Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. ¹
12	Subyacente		AN	18	0	66 83	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
13	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	84 86	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. ¹
14	Divisa de Liquidación		N	2	0	87 88	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la Administradora, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹
15	Plazo de referencia		N	4	0	89 92	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
16	Fecha de operación		F	8	0	93 100	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ⁴
17	Fecha de inicio		F	8	0	101 108	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. ³
18	Fecha de Vencimiento		F	8	0	109 116	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. ³
19	Tamaño del contrato		N	14	2	117 132	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
20	Número de contratos		N	14	0	133 146	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	147 149	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
22	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	150 170	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²
23	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	171 191	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. ²
24	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	192 207	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). ²

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
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	208 213	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. ⁵
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	214 214	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega.
27	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	215 218	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
28	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	219 225	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
29	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	226 231	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	232 240	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. ⁵
31	Medio de Concertación		N	1	0	241 241	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
32	Contraparte		N	8	0	242 249	Identificador de la Contraparte en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	250 269	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
34	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	270 272	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
35	Calificación primera	contraparte	N	4	0	273 276	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso contrario reportar ceros. ¹
36	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	277 279	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
37	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	280 283	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En caso contrario reportar ceros. ¹
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	284 433	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵

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
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	434 453 Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	454 467 En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
41	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	468 475 En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
42	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	476 495 Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Socio Operador		N	8	0	496 503 En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
44	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	504 523 Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
45	Socio Liquidador		N	8	0	524 531 En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
46	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	532 551 Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
47	Cámara de Compensación		N	8	0	552 559 En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
48	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	560 579 Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵

Anexo 77

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

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
49	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	580 593	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
50	Espacios en blanco		AN	60	0	594 653	Vacios. ⁶

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).

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 "308". ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; ⁵ cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁶
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Tipo de Operación		N	3	0	63 65	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. ¹
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	66 73	Se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. ¹
13	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	74 93	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵

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
14	Subyacente		AN	18	0 94 111	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
15	Divisa de Liquidación		N	2	0 112 113	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. ¹
16	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 114 116	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. ¹
17	Plazo de referencia		N	4	0 117 120	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
18	Fecha de operación		F	8	0 121 128	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
19	Fecha de inicio		F	8	0 129 136	Se deberá anotar la fecha en que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. ³
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0 137 144	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. ³
21	Tamaño del contrato		N	14	2 145 160	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
22	Número de contratos		N	14	0 161 174	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 175 177	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
24	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7 178 198	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²
25	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7 199 219	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. ²
26	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2 220 235	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). ²
27	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0 236 241	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. ⁵
28	Entrega física o diferenciales		AN	1	0 242 242	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵

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	
29	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	243 246	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
30	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	247 253	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
31	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	254 259	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
32	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	260 268	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. ²
33	Observaciones y características especiales		AN	150	0	269 418	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
34	Medio de Concertación		N	1	0	419 419	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
35	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	420 439	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
36	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	440 453	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
37	Socio Operador		N	8	0	454 461	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
38	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	462 481	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". ⁵
39	Socio Liquidador		N	8	0	482 489	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. ¹
40	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	490 509	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
41	Cámara de Compensación		N	8	0	510 517	Se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. ¹

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 Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones
42	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	518 537	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	538 551	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
44	Espacios en blanco		AN	102	0	552 653	Vacios. [*]

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
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 "309". ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ¹⁵
8	Serie		AN	6	0	44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aamddd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el identificador 1 de manera constante. ¹
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	63 70	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
12	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	71 90	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En caso contrario reportar vacío. ⁵
13	Tipo de opción		N	3	0	91 93	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. ¹

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
14	Subclase de opción		N	3	0	94 96 Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. ¹
15	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	97 97 "F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵
16	Subyacente		AN	18	0	98 115 Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
17	Divisa de Liquidación		N	2	0	116 117 Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la Administradora, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹
18	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	118 120 Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. ¹
19	Plazo de referencia		N	4	0	121 124 En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. ¹
20	Fecha de la operación		F	8	0	125 132 Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
21	Fecha de inicio		F	8	0	133 140 Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. ³
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	141 148 Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. ³
23	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	149 156 Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. ³
24	Tipo de operación		N	3	0	157 159 Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. ¹
25	Tamaño del contrato		N	14	2	160 175 Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
26	Número de contratos		N	14	0	176 189 Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ¹
27	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0	190 191 Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	192 212 Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²

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
29	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	213 233	En caso de cierre se deberá anotar el strike al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. ²
30	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	234 249	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). ²
31	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	250 264	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
32	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	265 279	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
33	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	280 294	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. ²
34	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	295 300	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. ⁵
35	Prima Pactada		N	14	6	301 320	Se deberá anotar el monto en pesos de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. ²
36	Contraparte		N	8	0	321 328	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 según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
37	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	329 348	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. ⁵
38	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	349 351	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
39	Calificación contraparte primera		N	4	0	352 355	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 crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
40	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	356 358	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
41	Calificación contraparte segunda		N	4	0	359 362	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 otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
42	Observaciones y características especiales		AN	150	0	363 512	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
43	Medio de Concertación		N	1	0	513 513	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹

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	
44	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	514 533	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
45	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	534 541	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura. ²
46	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	542 555	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
47	Socio Operador		N	8	0	556 563	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
48	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	564 583	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
49	Socio Liquidador		N	8	0	584 591	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
50	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	592 611	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
51	Cámara de Compensación		N	8	0	612 619	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
52	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	620 639	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
53	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	640 653	Se deberá reportar ceros de manera constante. ¹

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". ¹

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	
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
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. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Fecha de operación		F	8	0	63 70	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ⁴
12	Fecha de inicio		F	8	0	71 78	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. ³
13	Tipo de Posición		N	1	0	79 79	En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una Bolsa de Derivados, y en la cual, la posición en relación al precio publicado en vector por el Proveedor de Precios sea corta, se deberá reportar 2. Se deberá reportar 1 en otro caso. ¹
14	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	80 82	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. ¹
15	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	83 85	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. ¹
16	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	86 89	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. ¹
17	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	90 93	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. ¹
18	Días para fijar tasa a entregar		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. ¹
19	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	97 99	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. ¹
20	Número de cupones a entregar		N	3	0	100 102	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. ¹
21	Número de cupones a recibir		N	3	0	103 105	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. ¹
22	Valor notional		N	14	6	106 125	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). ²
23	Valor notional 2		N	14	6	126 145	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). ²
24	Tipo de cambio pactado		N	12	6	146 163	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. ²
25	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	164 169	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. ⁵
26	Divisa del notional a entregar		N	2	0	170 171	Se registrará el identificador de la divisa del notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. ¹
27	Divisa del notional a recibir		N	2	0	172 173	Se registrará el identificador de la divisa del notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	174 175	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que recibirá la Siefore. ¹

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
29	Subyacente a entregar		AN	18	0	176 193 Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
30	Subyacente a recibir		AN	18	0	194 211 Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
31	Divisa del subyacente a entregar		AN	3	0	212 214 Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. ⁵
32	Divisa del subyacente a recibir		AN	3	0	215 217 Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. ⁵
33	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	218 233 Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. ²
34	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	234 249 Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. ²
35	Sobretasa a entregar		N	3	2	250 254 Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. ²
36	Sobretasa a recibir		N	3	2	255 259 Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. ²
37	Tipo tasa a entregar		N	3	0	260 262 Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. ¹
38	Tipo tasa a recibir		N	3	0	263 265 Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. ¹
39	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	266 275 Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. ⁵
40	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	276 285 Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. ⁵
41	Amortiza Capital		N	1	0	286 286 Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. ¹
42	Tipo de intercambios		N	3	0	287 289 Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. ¹
43	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	290 297 En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹

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		
44	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	298	317	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
45	Contraparte		N	8	0	318	325	Identificador de la Contraparte en caso de que el swap se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. ¹
46	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	326	345	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
47	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	346	348	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
48	Calificación contraparte primera		N	4	0	349	352	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 crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
49	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	353	355	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
50	Calificación contraparte segunda		N	4	0	356	359	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 otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
51	Medio de Concertación		N	1	0	360	360	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
52	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	361	380	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
53	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	381	394	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
54	Observaciones características especiales	Y	AN	117	0	395	511	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵

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	
55	Socio Operador		N	8	0	512 519	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
56	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	520 539	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
57	Socio Liquidador		N	8	0	540 547	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
58	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	548 567	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
59	Cámara de Compensación		N	8	0	568 575	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
60	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	576 595	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
61	Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición		N	14	7	596 616	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. ²
62	Monto Neto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	617 632	Se deberá anotar el monto neto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). ²
63	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	633 646	Se deberá reportar ceros de manera constante. ¹
64	Espacios en blanco		AN	7	0	647 653	Vacios. ⁶

DETALLE 11: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS LINEAS OPERATIVAS (THRESHOLDS) Y CARACTERISTICAS DE OPERACION DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION) Y LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX).
A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "311". ¹
2	Contraparte		N	8	0	4 11	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. ¹

Anexo 77

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

DETALLE 11: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS LINEAS OPERATIVAS (THRESHOLDS) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACION DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION) Y LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX).

A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
3	Nombre Corto contraparte		AN	20	0	12 31	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte del contrato limitado a 20 caracteres en caso de no existir identificador para la misma en el catálogo de contrapartes y que, en su caso, deberá coincidir con el nombre reportado en los detalles 1 a 4. ⁵
4	Id Contrato		N	2	0	32 33	Se deberá registrar un número consecutivo definido por la Administradora para cada contrato ISDA reportado para cada contraparte, en el presente detalle. No se podrán reutilizar los identificadores para la misma contraparte en ningún caso. ¹
5	Tipo de Neteo		N	1	0	34 34	Se deberá anotar el tipo de neteo de derivados establecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para el cómputo de consumo de las líneas operativas (threshold) según el catálogo de "Tipo de Neteo"
6	Threshold establecido por la Contraparte		N	9	0	35 43	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como línea de crédito o margen operativo para la Siefore. ¹
7	Divisa del Threshold establecido por la Contraparte		N	2	0	44 45	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. ¹
8	Threshold establecido por la Siefore		N	9	0	46 54	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la Siefore como línea de crédito o margen operativo para la contraparte. ¹
9	Divisa del Threshold establecido por la Siefore		N	2	0	55 56	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la Siefore" conforme al catálogo de Divisas. ¹
10	Manejo de Garantías		N	1	0	57 57	Se deberá registrar 1 si el contrato ISDA prevé manejo de garantías con instrumentos financieros. De lo contrario se deberá reportar cero. ¹
11	Liquidación en Pesos		N	1	0	58 58	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en pesos. En otro caso reportar 0.
12	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas		N	1	0	59 59	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo I de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
13	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo II de divisas		N	1	0	60 60	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo II de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
14	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo III de divisas		N	1	0	61 61	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo III de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
15	Observaciones		AN	592	0	62 653	En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo "Tipo de Neteo", se deberán reportar características especiales relacionadas con la forma en la que se netean las posiciones para el cómputo de consumos de las líneas operativas establecidas en los contratos de derivados. ⁶

Anexo 77

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	SIEFORES	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 BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
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
630	XXI BANORTE

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 BANORTE

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
.
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
.

Anexo 77

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314	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	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
.
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
.
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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 BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV 1)	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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	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

Anexo 77

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
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	Florin 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

Anexo 77

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

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

Catálogo de Tipo de Operación		
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				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local				
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

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 (mex)	A2.mx	mx:A	HR A	1005
A- (mex)	A3.mx	mx:A-	HR A-	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mx:BBB+	HR BBB+	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mx:BBB	HR BBB	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mx:BBB-	HR BBB-	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mx:BB+	HR BB+	1010
BB (mex)	Ba2.mx	mx:BB	HR BB	1011
BB- (mex)	Ba3.mx	mx:BB-	HR BB-	1012
B+ (mex)	B1.mx	mx:B+	HR B+	1013
B (mex)	B2.mx	mx:B	HR B	1014
B- (mex)	B3.mx	mx:B-	HR B-	1015
CCC+ (mex)	Caa1.mx	mx:CCC+	HR C+	1016
CCC (mex)	Caa2.mx	mx:CCC		1017
CCC- (mex)	Caa3.mx	mx:CCC-		1018
CC (mex)	Ca.mx	mx:CC	HR C	1019
C (mex)	C.mx	mx:C	HR C-	1020
D (mex)		mx:D	HR D	1021
Calificaciones Corto Plazo en Escala Local				
F1+ (mex)	MX-1	mx:A-1+	HR+1	1022
F1 (mex)	MX-2	mx:A-1	HR1	1023
F2 (mex)	MX-3	mx:A-2	HR2	1024
F3 (mex)		mx:A-3	HR3	1025
B (mex)	MX-4	mx:B	HR4	1026
C (mex)		mx:C	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

Anexo 77

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
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	Garantía otorgada por la SIEFORE en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados
2	Garantía recibida por la SIEFORE en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	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	Sootia 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

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finam ex 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	Iribursa International, Inc.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	080042	Iribursa 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, 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	Intercan Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	Bull Tick 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.

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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	Eurofimes, 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	Money Tron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016712	Intercan 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)
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)

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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)
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	701275	Asigna, Compensación y Liquidación

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040145	Banco Base	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
046048	Citibank (Banamex USA)	801153	Pershing Inc.
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801154	Calyon Financial Inc.
076000	Otros Operadores	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076001	Derfin	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076008	Stock & Price	801157	Segregación de Instrumentos
076010	Scotia Inverlat Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMA A Derivados	801159	Reclasificaciones
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801160	Acciones Propias
076022	Darka	801161	Cortes Transversales
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801162	Bank West
076043	Timber Hill L.L.C.	801163	Bojbank Canada
076044	Enlace Derivados	801164	Bridgewater Bank
076048	Intercan Derivados	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801166	Canadian Tire Bank
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801168	Citizens Bank Of Canada
079005	Intemex Holding, S.A.- Luxemburgo	801169	Cs Alterna Bank
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801170	Dundee Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801172	General Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801174	Manulife Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079018	B.I. Remittances Company.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801180	Surtrust Bank
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801182	Fia Card Svc N.A.

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801183	Regions Bank
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801184	National City Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801185	Branch Bkg & TC
079028	BBVA Bancomer USA	801186	State Street B&TC
079029	Dinero Express	801187	Countrywide Bank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801188	Pnc Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801189	Keybank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801191	North Fork Bank
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801192	Manufacturers & Traders Tc
080001	Acci Securities Incorporated	801193	Bank Of The West
080004	Afin Securities International Limited	801194	Fifth Third Bank
080005	Arka Securities Incorporated	801195	Northern TC
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801196	Goldman Sachs Paris
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	900000	Otros mandatarios
080013	Vectormex Incorporated	900001	Schroders Plc.
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080015	Vectormex International Incorporated	910000	Otras Bolsas de Derivados
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

Anexo 77

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

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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.

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

POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO

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

1° ISIN, de no existir éste,

2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

3° SEDOL

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

Anexo 77

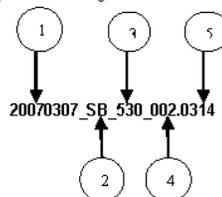
		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0314	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :	

- 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 cuáles 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 Constante = "0314" .

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

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefiore XXI BANORTE 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_530_002.0314.gpg

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

A20070307_SB_530_002.0314

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

- VI. Las rutas de envío a CON SAR para producción serán:

Anexo 77

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

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

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

ENCABEZADO

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

DETALLE(S)

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

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. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵
9	Plazo Total de la Operación de Reporto		N	6	0	60 65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Reporto. ¹
10	Plazo Actual del Reporto		N	6	0	66 71	El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. ¹
11	Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto		N	12	0	72 83	Número de títulos de los valores recibidos como colateral de la operación en Reporto (unidades). ¹
12	Costo total de adquisición del Reporto		N	14	2	84 99	Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. ²
13	Tasa Premio		N	3	3	100 105	Tasa Premio pactada del Reporto. ²
14	Precio Pactado		N	9	6	106 120	Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. ²
15	Importe pactado de cada operación		N	14	2	121 136	El valor total de la operación en Reporto al vencimiento, equivalente al costo total de adquisición más el premio pactado. ²
16	Premio devengado		N	14	2	137 152	Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. ²
17	Valor razonable		N	14	2	153 168	Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte. ²
18	Tipo de garantía pactada		N	2	0	169 170	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores ¹
19	Tasa de mercado		N	3	3	171 176	Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. ²
20	Divisa		N	2	0	177 178	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas. ¹
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	179 180	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. ¹
22	Tipo de cambio pactado		N	9	6	181 195	Tipo de cambio pactado, en el reporte para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. ⁹
23	Contraparte		N	6	0	196 201	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. ¹
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	202 221	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵

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		
25	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	222	224	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera		N	4	0	225	228	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de 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. ¹
27	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	229	231	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
28	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda		N	4	0	232	235	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de 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. ¹
29	Folio de operación		N	12	0	236	247	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 sobrecolateral llenar con ceros. ¹
30	Espacios en blanco		AN	96	0	248	343	Vacíos. ⁶

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". ¹
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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. ¹
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9 10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. ¹
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11 12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. ¹
6	ISIN		AN	12	0	13 24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹²
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25 33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹³
8	SEDOL		AN	7	0	34 40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹⁴
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41 44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. ⁵
10	Emisora		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. ⁵
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. ¹⁵

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
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. ¹⁵
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69 76 Fecha de Liquidación de la operación. ³
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77 88 Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. ¹
15	Costo unitario		N	9	6	89 103 Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104 118 Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que la posición no cuente con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Monto total a liquidar/ 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 de la inversión tercerizada. -En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" y la Clase de Activos de la Inversión tercerizada sea "3, 4 o 9" se deberá reportar el monto expuesto en pesos conforme a la fecha de integración en el capital contable de la administradora Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". ²
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135 140 Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141 146 Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
20	Divisa		N	2	0	147 148 Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149 163	Tipo de cambio ⁹ promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
22	País de adquisición		N	2	0	164 165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. ¹
23	Contraparte		N	6	0	166 171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13 se deberá llenar con ceros. ¹
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	172 191	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵
25	Hora de concertación de la operación		N	4	0	192 195	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros. ¹⁰
26	Banco de Trabajo		N	1	0	196 196	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. ¹
27	Medio de concertación		N	1	0	197 197	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación. ¹
28	Sistema de concertación		N	2	0	198 199	En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – Accipresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO. ¹
29	Tipo de postura		N	1	0	200 200	Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 1 – Agresor 2 – Agredido. ¹

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
30	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	201 203	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros. ¹
31	Observaciones		AN	20	0	204 223	Se deberán reportar características especiales que no se incorporen en la información del presente detalle para las operaciones de compra y venta que se realicen en el día ⁵ .
32	Compra en mercado primario		N	1	0	224 224	En caso de reportar compras realizadas en mercado primario anotar 1. En otro caso se deberá anotar 0. ¹
33	Espacios en blanco		AN	119	0	225 343	Vacios. ⁶

DETALLE 3: 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 "303" ¹ .
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. ¹
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6 7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento ¹ .
4	ISIN		AN	12	0	8 19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹²
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20 28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹³
6	SEDOL		AN	7	0	29 35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹⁴

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
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. ⁶
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. ⁶
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. ¹⁵
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. ¹⁵
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64 75 Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. ¹
12	Costo promedio unitario en pesos de Adquisición		N	9	6	76 90 En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
13	Costo Total de Adquisición / Monto Expuesto		N	14	2	91 106	<p>De acuerdo al Catálogo de Tipos de inversión:</p> <p>-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.</p> <p>-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.</p> <p>-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 de la inversión tercerizada.</p> <p>-En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" y la Clase de Activos de la Inversión tercerizada sea "3, 4 o 9" se deberá reportar el monto expuesto en pesos conforme a la fecha de integración en el capital contable de la administradora</p> <p>Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro".²</p>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107 121	<p>En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte</p> <p>En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.²</p>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122 137	<p>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.</p> <p>En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro".²</p>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138 153	<p>Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.²</p>
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154 159	<p>Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros.¹</p>
18	País de origen		N	2	0	160 161	<p>Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario.¹</p>

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
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. ¹
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172	175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
27	Tipo de derecho o modificación 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 o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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 o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. ³
29	Proporción de la modificación accionaria		N	6	6	200 211	Indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones o vehículos 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. ²
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". ¹
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 o por título del vehículo. ²
32	Valor Nominal Actualizado		N	14	6	229 248	Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos). Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen). En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
33	Títulos en circulación		N	14	0	249 262	Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
34	Valor Nominal Inicial		N	14	6	263 282	Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0 (Denominado en moneda de origen). En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
35	Títulos en Circulación Inicial		N	14	0	283 296	Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
36	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	297 310	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. ¹
37	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	311 313	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. ¹

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	Posición		Observaciones
38	Aviso de Reconposición		N	1	0	314 314	Se deberá anotar el identificador con fome al catálogo de Aviso de Reconposición. ¹
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. ²
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. ⁵

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

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							
--	--	--	--	--	--	--	--

Anexo 078

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". ¹
2	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. ¹
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. ¹
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. ⁵
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. ⁵
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. ¹⁵
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). ¹
12	Costo unitario original en pesos		N	9	6	76	90	En este campo se debe poner el costo unitario original al que se recibió. ²
13	Costo Total Original		N	14	2	91	106	Se debe poner el costo total original al que se recibió la posición en garantía. Este valor debe ser igual al costo unitario original por el número de títulos. ²
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. ²
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. ²
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. ²
17	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión. ¹
18	País de origen		N	2	0	160	161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. ¹

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. ¹
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169 171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172 175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176 178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179 182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183 185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186 189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
27	Contraparte		N	6	0	190 195	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes ¹ .
28	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	196 215	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. ²
29	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	216 218	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹

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
				Ent.	Dec.	De:	A:	
30	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	219	222	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
31	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	223	225	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
32	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	226	229	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
33	Folio de operación		N	12	0	230	241	Se deberá anotar el folio asociado a la operación de 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. ¹
34	Espacios en blanco		AN	102	0	242	343	Vacios ⁶ .

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". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵
9	Plazo Total de la Operación de Préstamo de Valores		N	6	0	60	65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. ¹

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		
10	Plazo Actual de la Operación de Préstamo de Valores		N	6	0	66	71	Número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. ¹
11	Cantidad de Títulos en préstamo		N	12	0	72	83	Número de títulos en préstamo (en unidades). ¹
12	Valor inicial de mercado del Préstamo de Valores		N	9	6	84	98	Precio unitario pactado para la operación de Préstamo de Valores en pesos. ²
13	Valor inicial total de mercado del Préstamo de Valores		N	14	2	99	114	Valor inicial total de la operación de Préstamo de Valores sin incluir el premio en pesos. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por valor inicial de mercado. ²
14	Importe pactado de cada operación		N	14	2	115	130	El valor total de la operación de Préstamo de Valores al vencimiento, equivalente al valor inicial total de mercado más el premio pactado. ²
15	Tasa Premio		N	3	3	131	136	Tasa Premio pactada para el Préstamo de Valores. ²
16	Premio devengado		N	14	2	137	152	Premio devengado del Préstamo de Valores a la fecha del reporte. ²
17	Tipo de garantía pactada		N	2	0	153	154	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores. ¹
18	Divisa		N	2	0	155	156	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas. ¹
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. ¹
20	Tipo de cambio pactado		N	9	6	159	173	Tipo de cambio ³ pactado, en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. ²
21	Contraparte		N	6	0	174	179	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. ¹
22	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	180	199	Se deberá anotar el nombre de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵
23	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	200	202	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
24	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	203	206	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen en el régimen de inversión. ¹
25	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	207	209	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	210	213	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen en el régimen de inversión. ¹

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	Folio de operación		N	12	0	214 225	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). ¹
28	Espacios en blanco		AN	118	0	226 343	Vacíos ⁶ .

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO DIA Y FECHA VALOR							
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 "307". ¹
2	Número consecutivo		N	4	0	4 7	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Subtipo de movimiento ¹ .
3	ISIN		AN	12	0	8 19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
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. ¹³
5	SEDOL		AN	7	0	29 35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
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). Para el caso de ingresos o egresos no relacionados a un activo se deberá reportar EF si el ingreso o egreso es en pesos o el tipo valor asignado por el proveedor a la divisa del ingreso o egreso. ⁵
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). Para el caso de ingresos o egresos no relacionados a un activo se deberá reportar EFECTIV si el ingreso o egreso es en pesos o el tipo valor asignado por el proveedor a la divisa del ingreso o egreso. ⁵
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). Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101 Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	54 63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵

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	
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). ¹
11	Tipo de Liquidación		N	2	0	67 68	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. ¹
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). ¹
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	71 78	Fecha de Liquidación de la operación. ³
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). ¹
15	Valor unitario		N	9	6	91 105	Valor unitario en pesos de los títulos operados. ²
16	Monto total a liquidar		N	14	2	106 121	Monto total a liquidar en la operación en pesos. ²
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. ¹
18	Tipo de cambio aplicado		N	9	6	124 138	Tipo de cambio aplicado ⁹ para liquidar operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. ²
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. ¹
20	Contraparte		N	6	0	142 147	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. ¹
21	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	148 167	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵
22	Hora de liquidación de la operación mismo día		N	4	0	168 171	Hora de concertación de la operación en caso de ser liquidada el mismo día. ¹⁰
23	Observaciones		AN	16	0	172 187	Se deberá anotar una descripción corta en caso de haber utilizado el Identificador 9 del Catálogo de Subtipo de movimiento. ⁵
24	Espacios en blanco		AN	156	0	188 343	Vacíos. ⁶

DETALLE 8: DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO							
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 "308". ¹
2	Contraparte		N	6	0	4 9	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMS excedentes) se deberá reportar el identificador del Socio Liquidador. En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) se deberá reportar el identificador de la Cámara de compensación. ¹

Anexo 078

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

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

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". ¹
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". ¹
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. ¹
4	Monto por liquidar		N	12	2	7 20	Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, en pesos mexicanos, para la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar. ²
5	Monto en divisa		N	12	2	21 34	Se deberán reportar los flujos netos totales que estén pendientes por liquidar en la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle. ²

Anexo 078

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : SIEFORES		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	Posición	Observaciones	
6	Espacios vacíos		AN	309	0	35 343	Vacíos. °

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS

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". ¹
2	Identificador Mandato		AN	4	0	4 7	Se indicará el valor constante MDT. ⁵
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. ⁵
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. ⁵
5	Límite establecido 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. ¹
6	Consumo del límite para valores extranjeros		N	14	2	38 53	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en valores extranjeros. ¹
7	Límite establecido para Renta Variable		N	14	2	54 69	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en renta variable en el mandato. ¹
8	Consumo del límite para Renta Variable		N	14	2	70 85	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en renta variable. ¹
9	Límite establecido para Mercancías		N	14	2	86 101	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en mercancías. ¹
10	Consumo del límite para Mercancías		N	14	2	102 117	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en mercancías. ¹
11	Límite establecido para Divisas		N	14	2	118 133	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Administradora para inversiones en divisas. ¹
12	Consumo del límite para divisas		N	14	2	134 149	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en divisas. ¹
13	Límite establecido para Medida de Control de Riesgo		N	3	8	150 160	Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecido por la Administradora correspondiente al límite de medida de control de riesgo. ¹
14	Consumo del límite 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. ¹
15	Espacios vacíos		AN	172	0	172 343	Vacíos. ⁶

CATALOGO(S)

Anexo 078



COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FORMATO DEL ARCHIVO : 0300

FUENTE : SIEFORES

PROCESO : FINANCIERO

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Tipos de Entidades		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
002	SIEFORES BASICA	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 BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
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
630	XXI BANORTE

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 BANORTE

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

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
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	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.

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

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

Anexo 078

			Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 FUENTE : SIEFORES			PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :		
Catálogo de Divisa			Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Clave	Descripción	Id	Abreviación	Descripción
					Protegido a Vencimiento
11	GBP	Libra Esterlina	9	TRK	Instrumentos conocidos como Trackers
12	HKD	Dólar Hong Kong	10	EFF	Efectivo
13	DKK	Corona Danesa	11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
14	SEK	Corona Sueca	12	MDT	Inversión Tercerizada
15	NOK	Corona Noruega	13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente
16	BRL	Real Brasileño			
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 Sistema de Concertación			Catálogo de Intermediación		
Identificador	Descripción		Identificador	Descripción	
0	No aplica		0	Por cuenta propia	
1	MEI		1	Banco de trabajo	
2	SIPO		9	Otro	
3	VAR				
4	Accipresval				
5	Corros Monex				
99	OTRO				
Catálogo de Tipo de Derechos			Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores		
Identificador	Descripción		Identificador	Descripción	
1	Dividendos en efectivo		0	Ninguna, el reporto o préstamo de valores no se encuentra garantizado	
2	Dividendos en acciones		1	Caución bursátil	
3	Escisión		2	Prenda	
4	Fusión		3	Fideicomiso de garantía	
Archivo: 0300			Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
			Página 23 de 36		

Anexo 078

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

Catálogo de Tipo de Derechos	
Identificador	Descripción
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
12	Suscripción de Acciones
13	Otro

Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores	
Identificador	Descripción
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	LUOP	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.

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P

Anexo 078

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

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
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local				
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
Calificaciones Corto Plazo en Escala Local				
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

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
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 : 0300 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO 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	PROCESO :	FINANCIERO
FUENTE :	SIEFORES	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	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, 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.

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
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013124	Intercan 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	Bancreer 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	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	Finam ex 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	Intercan 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)

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
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 Inveex	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)
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

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
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	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040145	Banco Base	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
046048	Citibank (Banamex USA)	801153	Pershing Inc.
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801154	Calyon Financial Inc.
076000	Otros Operadores	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076001	Derfin	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076008	Stock & Price	801157	Segregación de Instrumentos
076010	Scotia Inverlat Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMA Derivados	801159	Reclasificaciones
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Seraf)	801160	Acciones Propias
076022	Darka	801161	Cortes Transversales
076029	Grupo E especializado en Futuros y Otros Derivados	801162	Bank West
076043	Timber Hill LLC.	801163	Bcpbank Canada
076044	Enlace Derivados	801164	Bridgewater Bank
076048	Intercan Derivados	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801166	Canadian Tire Bank
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801168	Citizens Bank Of Canada
079005	Internex Holding, S.A.-Luxemburgo	801169	Cs Alterna Bank
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801170	Dundee Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.-California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801172	General Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801174	Manulife Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust – Islas Caimán	801175	National Bank Of Greece (Canada)

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
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079016	B.I. Financial Holdings Ltd. - Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079018	B.I. Remittances Company.- Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc. - Delaware, E.U.A.	801180	Surtrust Bank
079023	Bancomer Financial Services, Inc. - Delaware, E.U.A.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079024	CMX International Bank and Trust. - Islas Caimán.	801182	Fia Card Svc N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Natinsa Holdings Corp.	801183	Regions Bank
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801184	National City Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801185	Branch Bkg & TC
079028	BBVA Bancomer USA	801186	State Street B&TC
079029	Dinero Express	801187	Countrywide Bank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801188	Pnc Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801189	Keybank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801191	North Fork Bank
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801192	Manufacturers & Traders Tc
080001	Accl Securities Incorporated	801193	Bank Of The West
080004	Atin Securities International Limited	801194	Fifth Third Bank
080005	Arka Securities Incorporated	801195	Northern TC
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801196	Goldman Sachs Paris
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	900000	Otros mandatarios
080013	Vectormex Incorporated	900001	Schroders Plc.
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080015	Vectormex International Incorporated	910000	Otras Bolsas de Derivados
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

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 (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)
4	Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de

Anexo 078

Catálogo de Aviso de Reconposición		Catálogo de Tipo de Depósito	
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Clave Tipo de Entidad	Descripción
			derivados listados).

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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.

Anexo 078

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

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

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

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

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

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

HH = hora

MM = min

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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.

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

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

Anexo 078

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

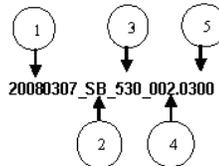
RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío 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. 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 GNUpg.
- IX. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "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 Constante = "0300" .

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

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



Anexo 078

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

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

20080307_SB_530_002.0300.gpg

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

A20080307_SB_530_002.0300

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

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

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada - 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". ¹
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0317". ¹
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. ¹
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. ¹
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. ¹
6	Fecha de Información		F	8	0	17	24	Fecha de la Operación que se reporta. ³
7	Tamaño del Registro		N	3	0	25	27	Número de caracteres por registro = Constante "212". ¹
8	Número de Registros		N	5	0	28	32	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
9	Espacios en blanco		AN	180	0	33	212	Vacios. ⁵

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 "101". ¹
2	ID		AN	8	0	4	11	Consecutivo Interno de la Nota que será determinado por la Administradora para cada Nota en cada Siefore. ¹⁰
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. ¹

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. ³
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. ¹
6	Tipo de Estructuración		N	1	0	23 23	Se anotará el identificador según el catálogo de Tipo de Estructura, donde se anotará 1 si la 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. ⁶
7	Espacios en blanco		AN	189	0	24 212	Vacios. ⁵

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.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la Nota Estructurada. ¹²
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de la Nota Estructurada. ¹³
4	SEDOL		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL la Nota Estructurada. ¹⁴
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. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora de la Nota Estructurada. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo de la Nota Estructurada. ¹⁵
9	Fecha de colocación de la Nota Estructurada.		F	8	0	60 67	Se deberá anotar la fecha de colocación de la Nota Estructurada. ³
10	Fecha de vencimiento		F	8	0	68 75	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la Nota Estructurada. ³
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). ²

Anexo 79

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

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. ¹
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. ¹
14	Observaciones		AN	107	0	106	212	Observaciones del Instrumento Estructurado. ⁵

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.	De: A:			
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. ¹²
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. ¹³
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. ¹⁴
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. ⁵
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. ⁵
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. ¹⁵
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. ¹⁵
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. ¹
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. ³
11	Tasa de Rendimiento		N	2	4	80	85	Se deberá anotar la tasa de rendimiento ligada al cupón que garantiza la protección del principal al vencimiento, correspondiente al día en que se inició la estructuración de la Nota. ²

Anexo 79

		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
				Ent.	Dec.	De:	A:	
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. ¹
13	Espacios en blanco		AN	125	0	88	212	Vacíos. ⁵

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
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". ¹
2	ISIN Acción		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la acción utilizada para conformar la Nota. ¹²
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. ¹³
4	SEDOL Acción		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL de la acción utilizada para conformar la Nota. ¹⁴
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. ⁵
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. ⁵
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. ¹⁵
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. ¹⁶
9	Número de Acciones		N	12	0	60	71	Número de Acciones que componen la Nota a la fecha del reporte. ¹
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. ²
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. ⁵
12	Espacios en blanco		AN	121	0	92	212	Vacíos. ⁵

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.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". ¹
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. ¹²
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. ¹³
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. ¹⁴
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. ⁵
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. ⁵
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. ¹⁵
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. ¹⁵
9	Fecha de vencimiento		F	8	0	60	67	Se deberá anotar la fecha en que teóricamente vence el Instrumento Derivado. ³
10	Fecha de liquidación		F	8	0	68	75	Se deberá anotar la fecha en la que se liquida o se intercambia el flujo del contrato derivado. ³
11	Tamaño del contrato		N	14	2	76	91	Se deberá anotar el tamaño del contrato o Monto Nominal pactado en valor absoluto en la Divisa pactada. En caso de ser un Swap, se deberá anotar el Monto Nominal de los flujos a entregar en la divisa pactada. ²
12	Tamaño del contrato 2		N	14	2	92	107	En caso de ser un Swap, se deberá anotar el tamaño del contrato o Monto Nominal pactado para los flujos a recibir en valor absoluto en la Divisa pactada. Se dejará en cero en otro caso. ²
13	Número de contratos		N	14	0	108	121	Se deberá anotar el número de contratos del Derivado que componen la Nota en la fecha del reporte. ¹
14	Tipo de Operación		N	1	0	122	122	Se deberá anotar el tipo de operación que se pactó, únicamente "1" para Largo y "2" para Corto. ¹
15	Delta		N	3	6	123	131	Se deberá anotar la delta del Instrumento Derivado proporcionada por el proveedor de precios, sólo aplica para opciones, en otro caso será igual a 1. ²

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		
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 Nacional, según el catálogo de Divisas. En caso de tratarse de un Swap se deberá de anotar el identificador de la divisa correspondiente al Monto Nacional de los flujos a entregar ²
17	Divisa Tamaño Contrato 2		N	2	0	134	135	En caso de tratarse de un Swap, se anotará el identificador de la Divisa en la cual se pacta el Monto Nacional a recibir, según el catálogo de Divisas. Se dejará vacío en otro caso ²
18	Subyacente		AN	18	0	136	153	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie 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. ⁵
19	Espacios en blanco		AN	59	0	154	212	Vacios. ⁶

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

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". ¹
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. ¹²
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. ¹³
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. ¹⁴
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. ⁵
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. ⁵

Anexo 79

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

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHÍCULOS 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. ¹⁵
8	Consecutivo Vehículo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Vehículo que conforma la Nota. ¹⁵
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. ¹
10	Espacios en blanco		AN	141	0	72 212	Vacios. ⁵

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

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". ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Estructurado, proporcionada por el proveedor de precios. ⁷
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. ⁸
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento Estructurado, proporcionada por el proveedor de precios. ⁹
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento Estructurado. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento Estructurado. ⁵
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. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento Estructurado. ¹⁵
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. ³
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. ³
11	Número de Títulos		N	12	0	76	87	Se deberá anotar el número de títulos del Instrumento Estructurado Adquirido. ¹
12	Observaciones		AN	125	0	88	212	Observaciones del Instrumento Estructurado. ⁵

TERCERA SECCION

SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

CIRCULAR CONSAR 19-14 Modificaciones 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 (Continúa de la Segunda Sección)

(Viene de la Segunda Sección)

Anexo 79

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	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 Siefors.

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 BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
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
630	XXI BANORTE

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 BANORTE

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 BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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	METIFFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	630	001	XXI BANORTE (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo de Estatus del Registro

Identificador	Descripción
1	Acta
4	Constante

Catálogo de Divisa

Id	Clave	Descripción
----	-------	-------------

Anexo 79

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0317 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	Florin 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

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

² Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CER0 para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

Anexo 79

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

⁴ Período. El formato para período (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMDDAAAAIMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily Official List" es la clave asignada por la International 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.

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

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

POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO

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

1° ISIN, de no existir éste,

2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

3° SEDOL.

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

Anexo 79

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

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

20080307_SB_530_002.0317.gpg

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

A20080307_SB_530_002.0317

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

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

TIPO DE ACCIÓN	RUTA
Envío Normal	export/fo ma/tec/FINAN/RECEPCION
*Envío por Retransmisión	export/fo ma/tec/FINAN/RETRANSMISION
Recuperación de Acuse	export/fo ma/tec/FINAN/TRANSMISION

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

TIPO DE ACCIÓN	RUTA
Envío Pruebas	export/fo ma/tec/FINAN/PRUEBAS/RECEPCION
Recuperación de Acuse de pruebas	export/fo ma/tec/FINAN/PRUEBAS/TRANSMISION

Anexo 92

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada.-Este archivo contiene información de los porcentajes de participación por Serie, los movimientos de las acciones en circulación por Serie y el precio de la Acción por Serie

PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	136	07:00 a 10:00 Hrs

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" ¹
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante "136" ¹
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0321" ¹
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. ¹
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad Siefore que reporta la información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefore, anexo. ¹
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 Siefore, anexo. ¹
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de la operación que se reporta. ³
9	Espacios en blanco		AN	104	0	33	136	Yaños. ⁶

DETALLE(S)

DETALLE 1: DETERMINACIÓN DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACIÓN DE LA ACCIÓN 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) = Constante "301" ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios ² .
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 ² .
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios ⁴ .
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	36	Clave que le otorgue al tipo de valor al proveedor de precios al activo ⁵ .
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo ⁵ .
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo ⁵ .

Anexo 92

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

DETALLE 1: DETERMINACIÓN DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACIÓN DE LA ACCIÓN 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 ⁶ .
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 ² .
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 ² .
11	Acciones en circulación iniciales		N	12	0	74 85	Es la cantidad de acciones en circulación finales por Serie del día anterior ¹ .
12	Acciones vendidas		N	12	0	86 97	Es la cantidad de acciones por Serie vendidas del día que se está reportando ¹ .
13	Acciones compradas		N	12	0	98 109	Es la cantidad de acciones por Serie compradas del día que se está reportando ¹ .
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 ¹ .
15	Precio de la acción		N	9	6	122 136	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales ² .

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
004	SIEFORES PREVISION SOCIAL	PS
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
011	ICEFAS	IC
013	BANXICO	BX
014	PRESTADORAS DE SERVICIO	PT
016	COMISIONES	CM
017	SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS	AV
018	S. D. INCEYAL	ID
019	CUSTODIOS DE LAS SIEFORES	CS
020	INSTITUTOS	IN
030	PROVEEDORES DE VECTORES DE PRECIOS	YP

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 BANORTE

Anexo 92

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
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
630	XXI BANORTE

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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 BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez

Anexo 92

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SUPRA (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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	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.

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

² Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anclará un CER0 para cantidades positivas y se anclará el signo "-" para cantidades negativas.

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

⁴ 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 6 caracteres numéricos representa la fecha inicial del periodo.

El segundo bloque de 6 caracteres numéricos representa la fecha final del periodo.

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

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

...

¹¹ El Activo Neto será el definido por la Circular CON SAR serie 15 vigente.

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anclará un CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

Anexo 92

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

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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, 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:

- 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.
- 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.
- Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son Solo aquellas Siefiores de Previsión Social que tengan en su estructura diferentes series accionarias derivadas del cobro de comisiones sobre saldo diferenciables.
- La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- 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 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.
- El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- 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 cuáles 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 Constante = "0321".

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

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefiore XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de Siefiore de Previsión Social Dos, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:

Anexo 92

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



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 97

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
Información de Tipo Agregada. - Este archivo contiene información del despacho de instrumentos subyacentes ligados a notas estructuradas.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	164	16:00 a 20:00 Hrs.

DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE INSTRUMENTOS SUBYACENTES LIGADOS A NOTAS ESTRUCTURADAS							
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". ¹
2	Fecha de Información		F	8	0	4 11	Fecha de la operación que se reporta. ³
3	Tipo de Valor		AN	4	0	12 15	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios a la Nota. ⁴
4	Emisora		AN	7	0	16 22	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios a la Nota. ⁴
5	Serie		AN	7	0	23 29	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios a la Nota. ⁴
6	Consecutivo		AN	10	0	30 39	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios a la Nota. ¹⁵
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. ¹²
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. ¹³
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. ¹⁴
10	Serial Subyacente		AN	8	0	68 75	Tres posiciones para el # de subyacente de # de subyacentes, ejemplos: 001de001, 009de012. ⁴
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. ⁴
12	Emisora instrumento subyacente		AN	7	0	80 86	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al instrumento subyacente. ⁴
13	Serie instrumento subyacente		AN	7	0	87 93	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al instrumento subyacente. ⁴
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. ¹²
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. ¹³
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. ¹⁴
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. ¹⁵

Anexo 97

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0320		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : Proveedores de precios		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 ² .
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 ² .
20	Nacional		N	14	6	145	164	Se deberá anotar el valor nacional implícito del instrumento derivado que cubre el índice asociado subyacente de la Nota estructurada ² .

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	LYL	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**

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAA = año

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 8: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

¹⁴ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

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

Anexo 97

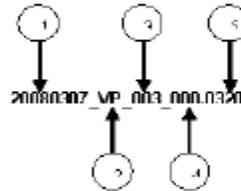
COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0320 FUENTE : Proveedores de precios
	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

N. 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, Constante = "VP"
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, Constante = "000" .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0320 .

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_000.0320

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 107

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada. - Este archivo contiene la información del Catálogo de Números de Cuenta del Cliente según los Custodios Internacionales de las Siefiores			
PERIODICIDAD DE ENVÍO DIARIO	PERIODO DE RECEPCION DIARIO	LONGITUD DEL REGISTRO 092	HORARIO DE TRANSMISION 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" ¹
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Es el número de caracteres por registro = constante "092". ¹
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Es el identificador de archivo (para control del sistema)= Constante "0308" ¹
5	Fecha de Proceso		F	8 0	16 23	Es la fecha de envío de la información a CON SAR. ¹
6	Tipo de Entidad		N	3 0	24 26	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información = Constante "019" ¹
7	Entidad		N	6 0	27 32	Clave de la Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades que establezca la CON SAR. ¹
8	Espacios en blanco		AN	60 0	33 92	Vacios. ⁶

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" ¹
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. ⁶
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. ⁵
4	Nombre del cliente		AN	60 0	33 92	Se deberá anotar la razón social del Cliente. ⁶

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 CON SAR otorgará la clave de custodio respectiva

Anexo 107



FORMATO DEL ARCHIVO : 0308

FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES

PROCESO : FINANCIERO

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Claves de Afores y Siefores			
Clave de Siefore	Descripción	Clave de Siefore	Descripción
002566001	AFIRME, Siefore Básica 1	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 1
002566002	AFIRME, Siefore Básica 2	002578002	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 2
002566003	AFIRME, Siefore Básica 3	002578003	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 3
002566004	AFIRME, Siefore Básica 4	002578004	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 4
002566005	AFIRME, Siefore Básica 5	002578005	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 5
002556001	AZTECA, Siefore Básica 1	002538001	PRINCIPAL, Siefore Básica 1
002556002	AZTECA, Siefore Básica 2	002538002	PRINCIPAL, Siefore Básica 2
002556003	AZTECA, Siefore Básica 3	002538003	PRINCIPAL, Siefore Básica 3
002556004	AZTECA, Siefore Básica 4	002538004	PRINCIPAL, Siefore Básica 4
002556005	AZTECA, Siefore Básica 5	002538005	PRINCIPAL, Siefore Básica 5
002552001	BANAMEX, Siefore Básica 1	003534001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Complementarias 1
002552002	BANAMEX, Siefore Básica 2	002534001	PROFUTURO, Siefore Básica 1
002552003	BANAMEX, Siefore Básica 3	002534002	PROFUTURO, Siefore Básica 2
002552004	BANAMEX, Siefore Básica 4	002534003	PROFUTURO, Siefore Básica 3
002552005	BANAMEX, Siefore Básica 5	002534004	PROFUTURO, Siefore Básica 4
017652001	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1	002534005	PROFUTURO, Siefore Básica 5
017652002	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 2	017634001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002568001	COPPEL, Siefore Básica 1	002530001	XXI BANORTE, Siefore Básica 1
002568002	COPPEL, Siefore Básica 2	002530002	XXI BANORTE, Siefore Básica 2
002568003	COPPEL, Siefore Básica 3	002530003	XXI BANORTE, Siefore Básica 3
002568004	COPPEL, Siefore Básica 4	002530004	XXI BANORTE, Siefore Básica 4
002568005	COPPEL, Siefore Básica 5	002530005	XXI BANORTE, Siefore Básica 5
002550001	INBURSA, Siefore Básica 1	017630001	XXI BANORTE, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002550002	INBURSA, Siefore Básica 2	004430001	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 1
002550003	INBURSA, Siefore Básica 3	004430002	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 2
002550004	INBURSA, Siefore Básica 4	004430003	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 3
002550005	INBURSA, Siefore Básica 5	004430004	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 4
002544001	SURA, Siefore Básica 1	004430005	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 5
002544002	SURA, Siefore Básica 2	004430006	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 6
002544003	SURA, Siefore Básica 3	004430007	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 7
002544004	SURA, Siefore Básica 4	004430008	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 8
002544005	SURA, Siefore Básica 5	004430009	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 9
017644001	SURA, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1	004430010	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 10
002562001	INVERCAP, Siefore Básica 1	004430011	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 11
002562002	INVERCAP, Siefore Básica 2	004430012	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 12
002562003	INVERCAP, Siefore Básica 3	004430013	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 13
002562004	INVERCAP, Siefore Básica 4		
002562005	INVERCAP, Siefore Básica 5		
003364001	METUFE, Siefore de Aportaciones Complementarias 1		
002564001	METUFE, Siefore Básica 1		
002564002	METUFE, Siefore Básica 2		
002564003	METUFE, Siefore Básica 3		
002564004	METUFE, Siefore Básica 4		
002564005	METUFE, Siefore Básica 5		

Anexo 107

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

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día
MM = mes
AAA = año

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

DD = día
MM = mes
AAA = año

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

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/uploader/>
- 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;

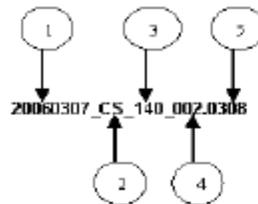
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	El donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento, Constante = "CS"
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
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 guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

Anexo 107

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

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 109

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

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada.- 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 INFORMACIÓN DE LAS MATRICES DE DIFERENCIAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De: A:	Observaciones	
1	Proveedor		AN	10	0	N/A	N/A	Identificador del proveedor de precios según el catálogo de proveedores. ⁴
2	Fecha de Información		F	8	0	N/A	N/A	Fecha de la operación que se reporta. ³
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. ⁴
4	Emisora		AN	7	0	N/A	N/A	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al instrumento. ⁴
5	Serie		AN	7	0	N/A	N/A	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al instrumento. ⁴
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. ¹²
7	Precio1		N	14	6	N/A	N/A	Precio limpio del instrumento. ¹⁰
8	Precio2		N	14	6	N/A	N/A	Precio sucio del instrumento. ¹⁰
9	Fecha del escenario		F	8	0	N/A	N/A	Fecha del escenario correspondiente al número del escenario ³
10	Número del escenario		N	3	0	N/A	N/A	Número del escenario correspondiente al instrumento. ¹¹
11	Diferencia		N	12	10	N/A	N/A	Diferencia en el precio del escenario correspondiente al instrumento. ¹⁰
12	Consecutivo		AN	10	0	N/A	N/A	Consecutivo del Instrumento. ¹⁰

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	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0322 FUENTE : Proveedor de precios	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

⁹ Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MM DD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

¹⁰ 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.

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

¹⁵ Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas, en caso de no existir se anotará un CER0 justificado a la izquierda.

¹¹ Dato numérico entero (cantidades o claves numéricas sin ceros a la izquierda).

¹⁶ 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 CER0.

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.

Anexo 109

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

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

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" ¹ .
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado ¹ .
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante "419" ¹ .
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0330" ¹ .
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Se deberá anotar la "Clave del Tipo de Entidad" de la Siefiore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo ¹ .
6	Entidad		N	3	0	19	21	Se deberá anotar la "Clave de Entidad" de la Siefiore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Entidades" anexo ¹ .
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Se deberá anotar la "Clave del Subtipo de Entidad" de la Siefiore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Subtipo de Entidades", anexo ¹ .
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de operación que se reporta ² .
9	Espacios en blanco		AN	307	0	33	419	Vacíos ³ .

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) = Constante "101" ¹ .
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 Siefiore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3" ⁴ .
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 Siefiore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3" ⁴ .

Anexo 111

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO 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".
5	País del Mandatario		N	2	0	28	29	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países ¹ .
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) ² .
7	Espacios en blanco		AN	382	0	38	419	Vacios ³ .

DETALLE(S)

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301" ¹ .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión conforme al "Catálogo de Tipo de Inversión".
3	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	6	15	Se reportará un identificador al 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 ⁴ .
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 ⁵ .
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 ⁶ .
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 ⁷ .
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 ¹⁰ .
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 ¹¹ .
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" ¹ .
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" ¹ .

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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ² .
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 ² .
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 ¹ .

Anexo 11

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	
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 reporte, 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 ² .
20	Divisa de Cotización		N	2	0	138 139	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del activo según el "Catálogo de Divisas" ¹ .
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	140 141	Se anotará el identificador de la divisa de liquidación del instrumento o de la operación que se reporte, según el "Catálogo de Divisas" ¹ .
22	Cantidad de Títulos		N	12	0	142 153	Se deberá reportar el número de títulos o acciones que conforman la posición del Mandato ¹ .
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 ⁵ .
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 ² .
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. En otro caso llenar con ceros ¹ .
26	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	186 195	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". Para el caso de activos a través de los cuales se 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 ⁴ .
27	Protección Inflacionaria		N	1	0	196 196	Se deberá anotar 1 si 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 ¹ .
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. ¹

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 Re composición		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.
31	Espacios vacíos		AN	121	0	299 419	Vacios.

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	Dec. Ac.		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302".
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.
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento reportado.
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26 34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento reportado.
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento reportado.
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42 61	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento reportado en caso de que exista.
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62 81	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento reportado en caso de que exista.
8	Fecha de operación		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación.
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del forward.
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.
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto.
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128 147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación.
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 al plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros.
14	Tipo de Operación		N	1	0	152 152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta.
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".
16	Clase de Activo		N	2	0	154 155	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Terceizada" correspondiente al subyacente.

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 ¹⁰ .
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 ¹¹ .
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 ⁴ .
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 ⁸ .
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" ⁴ .
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" ⁴ .
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" ¹¹ .
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" ¹¹ .
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" ¹¹ .

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
				Ent.	Dec.		
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 ⁴ .
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 ⁵ .
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 ⁶ .
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 ⁷ .
30	Descriptivo		AN	100	0	275 374	Se deberá anotar una breve descripción del activo. ⁸
31	Espacios en blanco		AN	45	0	375 419	Vacios ⁹ .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN 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 "303" ¹ .
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 ² .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista ³ .
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 ⁴ .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista ⁵ .
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 ⁶ .
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 ⁷ .
8	Fecha de Operación		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el futuro ⁸ .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del futuro ⁹ .
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 ² .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto ¹ .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128 147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación ² .

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 ¹ .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152 152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta ¹ .
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" ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ² .
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" ¹ .
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" ¹ .
23	Divisa del tamaño del contrato		N	2	0	224 225	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas" ¹ .
24	Divisa de Liquidación		N	2	0	226 227	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación diaria del contrato según el "Catálogo de Divisas" ¹ .

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 ¹ .
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 ⁶ .
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 ⁶ .
28	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	262 262	Se deberá anotar: - I en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - II en otro caso. ¹
29	Descriptivo		AN	100	0	263 362	Se deberá anotar una breve descripción del activo. ⁴
30	Espacios en blanco		AN	67	0	363 419	Vacios ⁵ .

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304" ¹ .
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 ¹ .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista ⁷ .
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 ⁸ .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista ⁹ .
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 ¹⁰ .
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 ¹¹ .
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 ³ .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la opción ³ .
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 pactó ² .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto ¹ .
12	Precio o Tasa Pactada		N	9	6	128 142	Se deberá anotar el precio o tasa strike que se pactó en la operación ² .

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 ² .
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".
15	Opción CALL/PUT		N	1	0	166	166	Se deberá anotar con 1 las opciones CALL y con 2 las opciones PUT ¹ .
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 ¹ .
17	Tipo de Operación		N	1	0	171	171	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta ¹ .
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" ¹ .
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 ¹ .
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 ¹⁰ .
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 ¹¹ .
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 ¹ .
23	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	6	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 ³ .
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" ⁴ .
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" ⁴ .

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" ¹ .
27	Divisa del Tamaño del Contrato		N	2	0	255 256	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato conforme al "Catálogo de Divisas" ¹ .
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	257 258	Se deberá anotar el identificador de la divisa 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" ¹ .
29	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	259 264	En caso de que la opción tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones al 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 ¹ .
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 ² .
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 ² .
32	Delta		N	3	8	293 303	Se deberá reportar la delta de la opción y con la cual se lleva a cabo el cálculo de la Exposición Delta ² .
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 ¹ .
34	Descriptivo		AN	100	0	305 404	Se deberá anotar una breve descripción del activo. ¹
35	Espacios vacíos		AN	15	0	405 419	Vacíos ² .

Anexo 111

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0930 FUENTE : CUSTODIOS	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).

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" ¹ .
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 ¹ .
3	ISIN		AN	12	0	14	26	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista ² .
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 ² .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista ² .
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 ² .
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 ² .
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 cual están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables ² .
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 cual están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables ² .
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 cual están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables ² .
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 cual están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables ² .
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 ² .
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 ² .
14	Fecha de Vencimiento Flujos a Recibir		F	8	0	178	186	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a recibir en el swap ² .
15	Valor Nacional Flujos a Entregar		N	12	2	186	199	Anotar el valor nacional en valor absoluto de los flujos a entregar en el swap en la divisa en la que se pactó ² .
16	Valor Nacional Flujos a Recibir		N	12	2	200	213	Anotar el valor nacional en valor absoluto de los flujos a recibir en el swap en la divisa en la que se pactó ² .
17	Plazo de flujos a entregar		N	3	0	214	216	Anotar el plazo en días de los flujos a entregar ² .
18	Plazo de flujos a recibir		N	3	0	217	219	Anotar el plazo en días de los flujos a recibir ² .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ¹ .
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 ² .

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. ²
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. ²
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. ³
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. ³
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". ⁴
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". ⁴
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". ¹
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". ¹
31	Divisa nacional a entregar		N	2	0	299	300	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nacional de los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas". ¹
32	Divisa nacional a recibir		N	2	0	301	302	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nacional de los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisas". ¹
33	Divisa de Liquidación		N	2	0	303	304	Se deberá reportar el identificador de la divisa de con la que se estarán liquidando los flujos, según el "Catálogo de Divisas". ¹
34	Valor a mercado.		N	12	2	305	318	En este campo se debe anotar el valor total a mercado la posición que se reporta en pesos mexicanos. ⁵ 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. ¹
35	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	319	319	
36	Descriptivo		AN	100	0	320	419	Se deberá anotar una breve descripción del activo. ¹

Anexo 111

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

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTE, 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" ¹ .
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" ¹ .
3	Identificador de posición de Garantía Recibida		AN	10 0	5 14	Se reportará un identificador el cual deberá ser unico 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 ¹ .
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 ¹ .
5	ISIN		AN	12 0	25 36	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se recibe como garantía ¹ .
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 ² .
7	SEDOL		AN	7 0	46 52	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se recibe como garantía ² .
8	Ticker Bloomberg		AN	20 0	53 72	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento que se recibe en garantía ¹ .
9	Ticker Reuters		AN	20 0	73 92	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento que se recibe en garantía ¹ .
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" ¹ .
11	Cantidad de Títulos		N	12 0	95 106	Se deberá reportar el número de títulos recibidos en garantía ¹ .
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 ² .
13	Intereses devengados		N	12 2	121 134	En este campo se deberán anotar los intereses devengados de las garantías reportadas en pesos mexicanos ² .
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 (331), en el campo "ID Emisor/Contraparte" ¹ .
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" ¹ .
16	Valor Nominal		N	8 2	147 156	En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar el Valor Nominal en la Divisa de Cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros ² .
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 1900101 ³ .
18	Fecha de Emisión		F	6 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 ³ .
19	Descriptivo		AN	100 0	173 272	Se deberá anotar una breve descripción del activo. ⁴
20	Espacios vacíos		AN	147 0	273 419	Vacíos ⁵ .

Anexo 111



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

DETALLE 7: DEPÓSITOS EN INSTITUCIONES FINANCIERAS Y APORTACIONES INICIALES MÍNIMAS Y EXCEDENTES PARA OPERACIONES CON DERIVADOS LISTADOS

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 "307" ¹ .
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" ⁴ .
3	Divisa		AN	2	0	14	15	Se reportará el identificador de la divisa en la cual está denominada el depósito o la aportación según el "Catálogo de Divisas" ⁵ .
4	Monto en divisa		N	12	2	16	29	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de conciliación ⁶ .
5	Monto		N	12	2	30	43	Se deberá anotar el valor en pesos mexicanos del depósito o aportación ⁶ .
6	Espacios vacíos		AN	376	0	44	414	Vacios ⁷ .

Anexo 111

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0330		PROCESO : FINANCIERO	
		FUENTE : CUSTODIOS		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 Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
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 mexicanos ¹ .
5	Espacios vacíos		AN	399	0	21	419	Vacios ¹ .

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 BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
556	AZTECA
562	IMMERCAP
564	METUFE
566	AFIRME
568	COPPEL
578	PENSIONSSSTE

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
634	PROFUTURO
644	SURA
652	BANAMEX
630	XXI BANORTE

Anexo 111

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (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 BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo Aviso de Recomposición	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
0	Sin recomposición.
1	Se conserva el instrumento.

Anexo 111

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

Catálogo de DMIsas	
Identificador	Descripción
1	MXF
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

Anexo 111

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

Catálogo de Divisas	
Identificador	Descripción
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	Suecia
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

Catálogo de Tipo de Operación asociada a la Garantía	
Identificador	Descripción
1	Reportos
2	Préstamo de Valores
3	Instrumentos Financieros Derivados

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global				
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)	1026
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)	1029

Anexo 111

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
AA	Aa2	AA	HR AA (G)	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)	1032
A	A2	A	HR A (G)	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)	1041
B	B2	B	HR B (G)	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)	1044
CCC	Caa2	CCC		1045
CCC-	Caa3	CCC-		1046
CC	Ca	CC	HR C (G)	1047
C	C	C	HR C- (G)	1048
D		D	HR D (G)	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global				
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)	1050
F1		A-1	HR1 (G)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)	1053
B			HR4 (G)	1054
C			HR5 (G)	1055

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

Anexo 111

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

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CER0 para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

² Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAA MM DD" donde:

DD = día
MM = mes
AAAA = año

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

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

⁶ Datos numéricos 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 CER0 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:

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

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.

¹ 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 CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

⁹ SEDOL o "Stock Exchange Daily 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 CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

¹⁰ El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CER0. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

¹¹ El ticker Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CER0. 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

Anexo 111

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

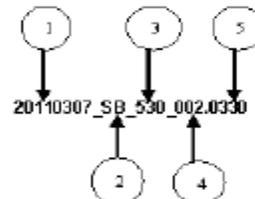
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- 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	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 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 Constante = "0330".

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

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



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

20100302_EO_001_000.0515.gpg

Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONGAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acusa" 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 CONGAR para producción serán por medio del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>

Anexo 112

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

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

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" ¹ .
2	Número de Registros		N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado ¹ .
3	Tamaño del Registro		N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = Constante "103" ¹ .
4	Tipo de Archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0331" ¹ .
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad Siefore de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo ¹ .
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", anexo ¹ .
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", anexo ¹ .
8	Fecha de Información		F	8	0	30	37	Fecha de operación que se reporta ² .
9	Espacios en blanco		AN	66	0	38	103	Vacios ³ .

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) = Constante "101" ¹ .
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" ⁴ .
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" ⁴ .
4	Clase de Inversión tercerizada		AN	10	0	18	27	Se deberá reportar el indicador de clase de activo sobre el que operará el mandato según el catálogo "Clase de Inversión Tercerizada". Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Consecutivo" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3" ⁴ .

Anexo 112

CON SAR		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	
5	País del Mandatario		N	2	0	28 28	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países ¹ .
6	Fecha de Concertación del Mandato		F	8	0	30 37	Se deberá reportar la fecha en que se pactó el mandato ² .
7	Espacios en blanco		AN	66	0	38 103	Vacios ³ .

DETALLE(S)

En las Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión de las Siefres 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 cuales el mandato tiene exposición a través de posiciones en directo sobre vehículos que los replican o a través de derivados sobre los índices o sobre los vehículos que los replican.

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

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

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

- Para posiciones en directo sobre acciones o instrumentos derivados cuyo subyacente sea la acción, se deberá reportar el "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" de la acción contenido en el catálogo del "Detalle 1" del presente formato.
- Para posiciones en directo sobre vehículos que replican índices, en derivados cuyos subyacentes sean índices, o en derivados cuyos subyacentes son vehículos que replican índices, se deberá reportar el "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" del índice contenido en el catálogo del "Detalle 1" del presente formato.

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO CORRESPONDIENTE A TODOS LOS ELEMENTOS DE RENTA VARIABLE O MERCANCÍAS (ACCIONES, MERCANCÍAS E ÍNDICES) QUE SERÁN REQUERIDOS EN LOS DETALLES 1 A 5 DEL FORMATO DE TRANSMISIÓN 0330 ASÍ COMO EN EL DETALLE 2 DEL PRESENTE FORMATO.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301"

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.A.S) COMO EN EL DETALLE 2 DEL PRESENTE FORMATO.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
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 ¹ .
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 ² .
4	Ticker de Bloomberg del Componente de Renta Variable o Mercancía		AN	20	0	64	63	Se deberá reportar el ticker que Bloomberg asigna al elemento de Renta Variable o Mercancía de que se trate ³ .
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 ⁴ .

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		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302" ¹ .
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 ² .
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 ³ .
4	Peso del componente en el índice		N	3	6	24	32	En este campo se deberá anotar el ponderador en puntos porcentuales que el componente reportado en el campo 3 "ID acciones" del presente Detalle, tiene dentro de la composición del índice reportado en el campo 2 "ID índice" al cierre de la fecha de envío de información ⁴ .
5	Espacios vacíos		AN	71	0	33	103	Vacíos ⁵ .

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 SI.

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 funcione 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 funcionen 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 funcionen 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 funcione como emisor, contraparte, bolsa de derivados o patrocinador del vehículo.

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

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL 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 Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" ¹ .
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 ⁴ .
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 ⁴ .
4	Espacios vacíos		AN	40	0	64	103	Vacíos ⁵ .

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATALOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHICULOS Y BOLSAS DE 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 "304" ¹ .
2	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único al 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 ⁴ .
3	Nombre		AN	20	0	14	33	Indicar el nombre descriptivo del emisor, bolsa de derivados o contraparte reportado ⁴ .
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 ⁴ .

Anexo 112

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

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATALOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHICULOS Y BOLSAS DE DERMADOS.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
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 ¹ .
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 ¹ .
7	Primera Calificadora CP		N	2	0 52 53	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" ¹ .
8	Segunda calificadora CP		N	2	0 54 55	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" ¹ .
9	Primera Calificación LP		N	4	0 56 59	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo 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 ¹ .
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 ¹ .
11	Primera Calificadora LP		N	2	0 64 65	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" ¹ .
12	Segunda calificadora LP		N	2	0 66 67	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" ¹ .
13	Espacios vacíos		AN	36	0 68 103	Vacíos ² .

CATALOGO(S)

Anexo 112

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

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 BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	BANAMEX
558	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
630	XXI BANORTE

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 BANORTE

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	578	005	PENSIONISSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	534	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
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	630	001	XXI BANORTE (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

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

Anexo 112

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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

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
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

Anexo 112

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
D	-	D	HR D (G)	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global				
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)	1050
F1		A-1	HR1 (G)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)	1053
B			HR4 (G)	1054
C			HR5 (G)	1055

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

³ Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:
 DD = día
 MM = mes
 AAAA = año

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

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

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

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

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 en nombre de las Señoras.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

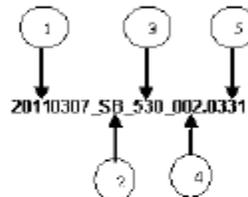
Anexo 112

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

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 a nombre de quien se transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefros Básicas, Siefros de Aportaciones Voluntarias, Siefros de Aportaciones Complementarias y Siefros de Previsión Social a nombre de quien se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento.
4	3 DÍgitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEF DRES")
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0331" .

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

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefro XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de Siefro 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/>

Anexo 114

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0703	PROCESO :	RETIROS
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :	

ID DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada. Este archivo contiene la información de la liquidación de las operaciones del proceso de retiros IMSS	
PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERIODO DE RECEPCIÓN:
Semanal	El primer día hábil posterior a la semana de la liquidación de los recursos que se reporta

ENCABEZADO

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= "000"
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema). Constante = "0703" ¹
3	Tipo de Entidad que reporta		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General del Apartado de la Circular 19 vigente. Constante = "001" ¹
4	Clave de la Entidad que reporta		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Afores) del Catálogo General del Apartado de la Circular 19 vigente. ¹
5	Fecha de Información		F	8	0	14	21	Fecha de envío del archivo a CONSAR. ³
6	Tamaño del Registro		N	3	0	22	24	Número de caracteres por registro. Constante= "106" ¹
7	Número de Registros		N	5	0	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
8	Espacios en blanco		AN	77	00	30	106	Vacios. ⁵

SUBENCABEZADO(S)

SUBENCABEZADO 1: Transferencias, Disposiciones y Retiros Parciales								
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= "101"
2	Fecha Inicio Periodo		F	8	0	4	11	Fecha de la primera liquidación reportada. ³
3	Fecha Fin Periodo		F	8	0	12	19	Fecha de la última liquidación reportada. ³
4	Espacios en blanco		AN	87	00	20	106	Vacios. ⁵

DETALLE(S)

DETALLE 1: Transferencias por fecha de liquidación								
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" .
2	Fecha de Liquidación		F	8	0	4	11	Fecha de liquidación de los recursos. ³
3	Tipo de Retiro		N	3	0	12	14	Según Tipo de Retiro (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Tipo de Prestación		N	2	0	15	16	Según Tipo de Prestación (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
5	Sifore		N	2	0	17	18	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00)
6	Retiro 97		N	11	2	19	31	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 97
7	Cesantía y Vejez		N	11	2	32	44	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
8	Cuota Social		N	11	2	45	57	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cuota Social
9	Vivienda 97		N	11	2	58	70	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 97
10	Número de Registros		N	10	0	71	80	Número de Registros con estas características
11	Espacios en blanco		AN	26	0	81	106	Vacios. ⁵

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO				
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0703	PROCESO :	RETIROS
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :	

DETALLE 2: Disposición por fecha de liquidación

Id	Concepto	Data	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".
2	Fecha de Liquidación		F	8	0	4	11	Fecha de liquidación. ³
3	Tipo de Retiro		N	3	0	12	14	Según Tipo de Retiro (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Tipo de Prestación		N	2	0	15	16	Según Tipo de Prestación (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
5	Sifone		N	2	0	17	18	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00)
6	Retiro 97		N	11	2	19	31	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 97
7	Cesantía y Vejez		N	11	2	32	44	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
8	Cuota Social		N	11	2	45	57	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cuota Social
9	Retiro 92		N	11	2	58	70	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 92
10	Vivienda 92		N	11	2	71	83	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 92
11	Vivienda 97		N	11	2	84	96	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 97
12	Número de Registros		N	10	0	97	106	Número de Registros con estas características

DETALLE 3: Parciales por fecha de liquidación

Id	Concepto	Data	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".
2	Fecha de Liquidación		F	8	0	4	11	Fecha de Liquidación. ³
3	Tipo de Retiro		N	3	0	12	14	Según Tipo de Retiro (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Tipo de Prestación		N	2	0	15	16	Según Tipo de Prestación (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
5	Tipo de Proceso de Retiro		N	1	0	17	17	De acuerdo al Catálogo de Tipo de Proceso de Retiros por Desempleo del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. Solo aplica para Tipo de prestación (d.4) = 6 (Desempleo), en otro caso poner cero.
6	Clasificación de Pago		N	1	0	18	18	De acuerdo al Catálogo de Clasificación de Pago del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. Solo aplica para Tipo de prestación (d.4) = 6 (Desempleo), en otro caso poner cero.
7	Monto pagado RCV		N	11	2	19	31	Monto Pagado al Trabajador
8	Número de Registros		N	10	0	32	41	Número de Registros con estas características
9	Espacios en blanco		AN	65	0	42	106	Vacios "

DETALLE 4: Cuentas por Subcuenta (SAR 92)

Id	Concepto	Data	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".
2	Tipo de Retiro		N	3	0	4	6	Según Tipo de Retiro IMSS del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
3	Subcuenta		N	3	0	7	9	Clave de la Subcuenta de SAR 92 de acuerdo al Catálogo de Clave de Subcuentas (Información Agregada) del Catálogo General Apartado Circular 19. Constante= "17" (SAR 92)
4	Número de Registros		N	10	0	10	19	Número de Registros con estas características
5	Espacios en blanco		AN	87	0	20	106	Vacios "

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0703	PROCESO :
	FUENTE :	AFORES	RETIROS

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

³ **Fechas**. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:
 DD = día
 MM = mes
 AAAA = año

⁴ **Periodo**. El formato para periodo (rango de fechas) deberá ser = "AAAAMMDDAAAAMMDD" donde:
 DD = día
 MM = mes
 AAAA = año

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

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

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

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

I. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Administradoras (Afores).

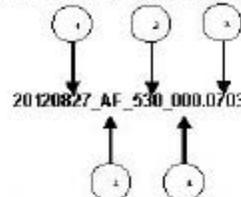
II. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión es el siguiente:

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. Constante = "AF" .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Afores que se reporta conforme al Catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será la Constante = "000" ").
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será la Constante = "0703" .

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

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0703	PROCESO :
	FUENTE :	AFORES	RETIROS
		ACTUALIZACIÓN :	

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Afore XXI - BANORTE envía su información a CONSAR a través del archivo de Tipo 0703.



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

20120827_AF_530_000.0703.gpg

Con este nombre es con el que el archivo deberá transmitirse a CONSAR. 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:

A20120827_AF_530_000.0703

NOTA: No se tomará en cuenta la extensión .gpg en la recuperación del acuse y éste no estará encriptado, tal y como lo muestra el ejemplo.

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

TIPO DE ACCIÓN	RU TA
Envío Normal	export/home/rec/RETIR/RECEPCION
Envío por Retransmisión	export/home/rec/RETIR/RETRANSMISION
Recuperación de Acuse	export/home/rec/RETIR/TRANSMISION

Las rutas de envío a CONSAR para pruebas serán:

TIPO DE ACCIÓN	RU TA
Envío Pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/RECEPCION
Recuperación de Acuse de pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/TRANSMISION

Anexo 115

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO : FUENTE :	0704 AFORES	PROCESO : ACTUALIZACIÓN : RETIROS

ID DESCRIPCIÓN DEL FORMATO	
Información de Tipo Agregada - Esta archivo contiene la información de la liquidación de las operaciones del proceso de retiros ISSSTE.	
PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERIODO DE RECEPCIÓN:
Semanal	El primer día hábil posterior a la semana de la liquidación de los recursos que se reporta).

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" ¹
4	Tipo de Archivo		N	4 0	4 7	Identificador de archivo (para control del sistema). Constante = "0704" ¹
5	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. Constante = "001" ¹
6	Entidad		N	3 0	11 13	Clave de Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Afores) ¹
7	Fecha de Información		F	8 0	14 21	Fecha de envío del archivo a CON SAR. ²
3	Tamaño del Registro		N	3 0	22 24	Número de caracteres por registro. Constante= "119" ¹
2	Número de Registros		N	5 0	25 29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. ¹
8	Espacios en blanco		AN	90 0	30 119	Vacios. ³

SUBENCABEZADO(S)

SUBENCABEZADO 1: Transferencias, Disposiciones y Retiros Parciales ISSSTE						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	01 03	Identificador de registro (para control del sistema). Constante= "101" ¹
2	Fecha Inicio Periodo		F	8 0	04 11	Fecha de la primera liquidación reportada.
3	Fecha Fin Periodo		F	8 0	12 19	Fecha de la última liquidación reportada.
4	Espacios en blanco		AN	100 0	20 119	Vacios. ²

DETALLE(S)

DETALLE 1: Transferencias ISSSTE por fecha de liquidación						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	03 00	1 3	Identificador de registro (para control del sistema). Constante= "301" ¹
2	Fecha de Liquidación		F	08 00	4 11	Fecha de liquidación
3	Tipo de Retiro		N	03 00	12 14	Según Tipo de Retiro ISSSTE del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente
4	Origen de los recursos		N	02 00	15 16	07-Banco 00-Siefore
5	Siefore		N	02 00	17 18	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00) Para Origen de los recursos =07 (Banco) se debe reportar 00.
6	Retiro 2008		N	11 02	19 31	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 2008
7	Cesantía y Vejez		N	11 02	32 44	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
8	SAR ISSSTE 92		N	11 02	45 57	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de SAR ISSSTE 92
9	Ahorro Solidario		N	11 02	58 70	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Ahorro Solidario
10	Complementarios de Retiro		N	11 02	71 83	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiros Complementarios de Retiro
11	Vivienda 92		N	11 02	84 96	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 92
12	Vivienda 2008		N	11 02	97 109	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 2008
13	Número de Registros		N	10 00	110 119	Número de Registros con estas características

**DETALLE 2:** Disposición ISSSTE por fecha de liquidación

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición Dec.	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	03	00	01	03	Identificador de registro (para control del sistema). Constante = "302".
2	Fecha de Liquidación		F	08	00	04	11	Fecha de Liquidación
3	Tipo de Retiro		N	03	00	12	14	Según Tipo de Retiro ISSSTE Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Origen de los recursos		N	02	00	15	16	07-Banco 08-Siefore
5	Siefore		N	02	00	17	18	Sociedad de inversión básica (En caso de que por la naturaleza del proceso no se cuente con este dato, deberá reportarse como 00) Para Origen de los recursos = 07 (Banco) se debe reportar 00.
6	Retiro 2008		N	11	02	19	31	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiro 2008
7	Cesantía y Vejez		N	11	02	32	44	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Cesantía y Vejez
8	SAR ISSSTE 92		N	11	02	45	57	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de SAR ISSSTE 92
9	Ahorro Solidario		N	11	02	58	70	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Ahorro Solidario
10	Complementarios de Retiro		N	11	02	71	83	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Retiros Complementarios de Retiro
11	Vivienda 92		N	11	02	84	96	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 92
12	Vivienda 2008		N	11	02	97	109	Monto en pesos liquidado de la subcuenta de Vivienda 2008
13	Número de Registros		N	10	00	110	119	Número de Registros con estas características.

DETALLE 3: Parciales por fecha de liquidación

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición Dec.	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	03	00	01	03	Identificador de registro (para control del sistema. Constante = "303".
2	Fecha de Liquidación		F	08	00	04	11	Fecha de liquidación
3	Tipo de Retiro		N	03	00	12	14	Según Tipo de Retiro ISSSTE Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	Monto pagado RCV		N	10	02	15	26	Monto Pagado al Trabajador
5	Número de Registros		N	10	00	27	36	Número de Registros con estas características.
6	Espacios en blanco		AN	83	00	37	119	Vacios *

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

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

DD = día
MM = mes
AAAA = año

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

DD = día
MM = mes
AAAA = año

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

FORMATO DE TRANSMISION DE INFORMACION POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0704	PROCESO :
	FUENTE :	AFORES	RETIROS
		ACTUALIZACIÓN :	

⁶ Dato alfabético. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

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

POLITICAS ESPECIFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

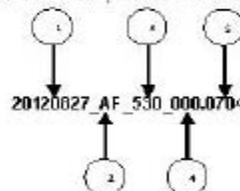
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato se sujetará a las siguientes políticas:

- I. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Administradoras (Afores).
- II. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión es el siguiente:

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. Constante = "AF" .
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Afores que se reporta conforme al Catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente.
4	3 DÍgitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicara para familia de SIEFOPRES, para las demás entidades será la Constante = "000").
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será la Constante = "0704".

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

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Afore XXI - BANORTE envía su información a CONSAR a través del archivo de Tipo XXXX:



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

20120827_AF_530_000.0704.gpg

Con este nombre es con el que el archivo deberá transmitirse a CONSAR. 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:

A20120827_AF_530_000.0704

NOTA: No se tomará en cuenta la extensión .gpg en la recuperación del acuse y éste no estará encriptado, tal y como lo muestra el ejemplo.

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0704	PROCESO :
	FUENTE :	AFORES	RETIROS

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

TIPO DE ACCIÓN	ROUTA
Envío Normal	export/home/rec/RETIR/RECEPCION
Envío por Retransmisión	export/home/rec/RETIR/RETRANSMISION
Recuperación de Acuse	export/home/rec/RETIR/TRANSMISION

Las rutas de envío a CONSAR para pruebas serán:

TIPO DE ACCIÓN	ROUTA
Envío Pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/RECEPCION
Recuperación de Acuse de pruebas	export/home/rec/RETIR/PRUEBAS/TRANSMISION