

SEGUNDA SECCION PODER EJECUTIVO

SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

CIRCULAR CONSAR 19-15, 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.

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 19-15

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, 88, 89, 90 fracción II, 91, 108 bis y 113 de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 106 de la Ley del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado, 140 del Reglamento de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 1, 2 fracción III y 8 primer párrafo del Reglamento Interior de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, así como en las disposiciones Décima Octava, Décima Novena y Vigésima Primera de la "Resolución por la que se expiden las Disposiciones de carácter general a que se refieren los artículos 108 bis de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro y 91 de las Sociedades de Inversión", publicada en el Diario Oficial de la Federación el 14 de mayo de 2004, así como en la "Resolución por la que se reforma la diversa que expide el formato oficial para el reporte de operaciones relevantes, inusuales y preocupantes contemplado en las disposiciones de carácter general que se indican, así como en el instructivo para su llenado, publicada el 14 de diciembre de 2004 y reformada por última ocasión mediante resolución publicada el 8 de junio de 2012", publicada en el Diario Oficial de la Federación el 1 de agosto de 2013, 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.

ÚNICA.- Se modifican los anexos 69, 75, 77 y 78 de la Circular CONSAR 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro", modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012 y 7 de junio de 2013 respectivamente.

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 75, 77 y 78 que entrarán en vigor a los 10 días hábiles siguientes de su 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 septiembre de 2013.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, **Carlos Ramírez Fuentes**.- Rúbrica.

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Información de Tipo Agregada. Este archivo contiene Información del proceso de lavado de dinero de las operaciones relevantes, inusuales y preocupantes de los sujetos obligados (Administradoras).

ARCHIVO SEPARADO POR

: (Punto y coma)

PERIODICIDAD DE ENVÍO:	PERÍODO DE RECEPCIÓN:	HORARIO DE TRANSMISIÓN:
Operaciones Relevantes: Trimestral Operaciones Inusuales y Preocupantes: Recurrentemente en base a su respectiva detección.	Operaciones Relevantes: A más tardar 10 días hábiles después del cierre de operaciones del último mes del trimestre correspondiente. Operaciones Inusuales y Preocupantes: Dentro de los 30 días naturales contados a partir de su detección.	15:00 a 18:00 Hrs.

COLUMNAS QUE INTEGRAN EL ARCHIVO DE REPORTES DE OPERACIONES RELEVANTES, INUSUALES Y PREOCUPANTES (RIP)

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
1	TIPO DE REPORTE	N	Si	1	Se deberá capturar la clave del Tipo de Reporte que esta reportando, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Reporte, anexo. Cada envío deberá contener únicamente operaciones de un mismo tipo.
2	PERIODO DEL REPORTE	N	Si	8	Se reportará el periodo en formato AAAAMM(6) para operaciones Relevantes y AAAAMMDD (8) para operaciones inusuales y preocupantes, donde AAAA= año, MM= Mes, DD= Día. El Periodo debe ser igual a la fecha de entrega e igual al nombre del archivo.
3	FOLIO	N	Si	6	El consecutivo deberá iniciar en 000001 y se incrementará en 1 por cada operación que se reporte dentro de un mismo envío. Para operaciones Inusuales y Preocupantes, podrá repetirse el folio siempre y cuando se reporten personas o cuentas relacionadas de una misma operación. En este caso se tendrá que repetir el folio en tantos renglones como personas o cuentas relacionadas se reporten de una misma operación. Adicionalmente, la operación principal (col. 34 cuando no sea persona o cuenta relacionada) siempre contendrá el doble cero (00). Para archivos correspondientes a fechas anteriores donde se pretenda corregir, eliminar o complementar operaciones, el folio deberá ser el mismo que la operación original, por lo que no iniciará en 01, y el folio de la siguiente operación será simplemente mayor que el anterior.
4	ÓRGANO SUPERVISOR	N	Si	6	Se capturará la clave del órgano supervisor (CON SAR), Constante = "001004".
5	CLAVE DEL SUJETO OBLIGADO	N	Si	6	Se captura la clave de los sujetos obligados (AFORES), de acuerdo al catálogo del sistema financiero mexicano CASFIN o la clave asignada por el SAT, se anexa catálogo de sujetos obligados (AFORES).
6	LOCALIDAD	AN	Si	8	Se registrará la clave de la localidad en la que se encuentra la sucursal del Sujeto Obligado en donde se generó la operación. En el caso de reportes, en los que se hace referencia a múltiples transacciones efectuadas en distintas oficinas, se deberá capturar la clave correspondiente a la sucursal promotora del cliente cuando el Sujeto Obligado cuente con esta

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
					información. De manera complementaria, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se detallará(n) la(s) localidad(es) en donde se registró la operativa a reportar. NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF.
7	SUCURSAL	AN	Si	8	Utilizar la clave de la sucursal del Sujeto Obligado (Afore) donde se originó la operación. Para tal efecto, las (Afores) deberán proporcionar a la Secretaría de Hacienda y Crédito Público a través de la Consar, los catálogos correspondientes a dichas sucursales y éstos se deberán actualizar cada vez que sea necesario. Si la operación no se origina en una sucursal (v. gr.: casa matriz), el reporte no proviene de una sucursal, la clave será constante = 0 (cero). En el caso de reportes, en el que se hace referencia a múltiples transacciones efectuadas en distintas oficinas, se deberá establecer la sucursal más frecuente o, en su caso, aquella en donde se realizó la operación. De manera complementaria, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se detallarán las sucursales en donde se registró la operativa a reportar. La clave 0 (cero) para cada Afore deberá corresponder a su oficina matriz en el catálogo de sucursales.
8	TIPO DE OPERACIÓN	N	Si	2	Se registrará la clave del tipo de operación de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. En caso de alertas compuestas por transacciones de diferentes tipos, se deberá establecer el tipo de operación más frecuente. De manera complementaria, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se detallarán los tipos de operaciones que componen la operativa a reportar. NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF.
9	INSTRUMENTO MONETARIO	N	Si	2	Se registrará la clave del instrumento monetario de acuerdo al catálogo de Instrumentos monetarios. En el supuesto de alertas compuestas de transacciones realizadas en diferentes instrumentos monetarios, se deberá establecer el más frecuente. De manera complementaria en el campo 40 "Descripción de la Operación" se detallarán los instrumentos monetarios utilizados dentro de la operativa a reportar. NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF. Tener en cuenta que las claves válidas para Operaciones relevantes son: (01, 04, 05, 06, 07)
10	NUMERO DE CUENTA, CONTRATO, OPERACION, PÓLIZA O NUMERO DE SEGURIDAD SOCIAL	AN	Si	16	Indica el número de cuenta, contrato, operación, póliza o número de seguridad social, según el utilizado por cada (Afore) que realiza el reporte. En los reportes por operativa, se deberá capturar el número de cuenta más representativo de la operativa a reportar. De manera complementaria, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se detallarán, en su caso, las diferentes cuentas o contratos involucrados. En caso de que por naturaleza de la operación no intervenga un número de cuenta, se deberá reportar el número de referencia que identifica la operación
11	MONTO	N	Si	17	Especificar el monto de la operación en números reales, en

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
					<p>donde las primeras 14 posiciones se utilizarán para enteros y las últimas dos posiciones se utilizarán para los decimales, separando las fracciones por un punto decimal.</p> <p>Cuando la operación que se reporte sea realizada mediante Oro, Plata o Platino Amonedados, se deberá establecer el número de unidades del metal que corresponda (cantidades enteras).</p> <p>Para el caso de reportes por operativa, se deberá indicar el monto acumulado de la operativa a reportar.</p> <p>De manera complementaria, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se describirán los criterios y periodo de acumulación.</p> <p>En los casos en que no esté involucrada una operación sino un acto, conducta o comportamiento que requiera ser reportado, esta casilla se deberá capturar con ceros.</p>
12	MONEDA	AN	Si	3	<p>Este campo será utilizado para especificar la clave de la moneda con la que se realizó la operación, según Catálogo de Moneda. En el caso de reportes por operativa realizadas en diferentes divisas, se deberá establecer la más frecuente, en lugar de la clave "Combinación". De manera complementaria en el campo 40 "Descripción de la Operación" se detallarán las diversas monedas utilizadas dentro de la operativa a reportar.</p> <p>NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF.</p>
13	FECHA DE LA OPERACIÓN	N	Si	8	<p>Será utilizado para especificar la fecha en que se realizó la operación. Se especificará la fecha de la operación en formato: AAAAMMDD, en donde; AAAA=Año, MM= Mes y DD= Día Debe ser menor o igual a la fecha del reporte ya sea Inusual o Preocupante. En el supuesto de reportes por operativa, se indicará la fecha de generación de la alerta. Adicionalmente, en el campo 40 "DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN" se detallará el periodo (fecha inicio y fecha fin) en el cual se acumularon las transacciones a reportar.</p>
14	FECHA DE DETECCIÓN DE LA OPERACIÓN	N	Si (op. Inusuales y preocupantes)	8	<p>Se registrará la fecha de detección de la operación por el sistema, modelo, proceso o por el empleado de la (Afore). La fecha de detección de la operación debe ser menor o igual al periodo del reporte.</p> <p>Columna Nula para operaciones Relevantes.</p> <p>NOTA: En el caso de operaciones relevantes este campo se dejará vacío.</p>
15	PAÍS DE NACIONALIDAD	N	Si	2	<p>Se deberá de registrar la clave del país de la nacionalidad del cuentahabiente o de quien realiza la operación, de acuerdo al Catálogo de País de Nacionalidad.</p> <p>NOTA: Únicamente para el caso de Operaciones Relevantes en las que se desconozca la nacionalidad, se deberá asentar el campo como 0.</p>
16	TIPO DE PERSONA	N	Si	1	<p>Se registra el tipo de persona del cuentahabiente o de quien realiza la operación. Las claves son: 1= Persona física y 2 = Persona Moral</p>
17	RAZÓN SOCIAL O	AN	Si	60	<p>Se registra la razón social o denominación del cuentahabiente o</p>

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO:	0900	PROCESO: LAVADO DE DINERO
	FUENTE:	AFORES	ACTUALIZACIÓN:

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
	DENOMINACION		Solo para Persona Moral		de quien realiza la operación. Persona moral o física con actividad empresarial Si la persona moral tiene un nombre comercial diferente a la razón social, se deberá utilizar también la columna 18 para describir el nombre. Si no es persona moral deberá de ir nulo.
18	NOMBRE	AN	Si	60	Nombre del cuenta habiente o de quien realiza la operación. Se utilizará para poner el nombre del titular de la cuenta, contrato, póliza o del No. de seguridad social o de la persona que efectuó la operación según sea el caso. Para los reportes de operaciones Preocupantes esta información deberá ser del empleado, agentes, factores, apoderados, consejeros, etc. que se está reportando. Si el tipo de persona se reporto como Física entonces deberá haber dato en las columnas 18,19 y 20. NOTA: Obligatorio solo para persona física o bien para persona moral, cuando esta última tiene un nombre comercial distinto al de la razón social.
19	APELLIDO PATERNO	AN	Si Para persona Física	60	Se registrará el apellido paterno del titular de la cuenta, contrato, póliza o del No. de seguridad social o de la persona que efectuó la operación, según sea el caso. Si la persona reportada no tiene apellido paterno se deberán capturar cuatro equis (xxxx). En estos casos el apellido materno será obligatorio Para los reportes de operaciones Preocupantes esta información deberá ser del empleado que se está reportando.. Si se reporto persona moral debe ser nulo el campo.
20	APELLIDO MATERNO	AN	Si Para persona Física	30	Se utilizará para poner el apellido materno del titular de la cuenta, contrato, póliza o del No. de seguridad social o de la persona que efectuó la operación, según sea el caso. Para los reportes de operaciones preocupantes esta información deberá ser del empleado que se está reportando. En el caso de que alguna entidad financiera o institución no pueda separar el apellido materno del paterno, podrá reportar el apellido materno en la columna 19 (apellido paterno) a efecto de que en dicha columna queden ambos apellidos. Si la columna 19 fue XXXX, esta columna debe ser diferente de XXXX, por el contrario si la columna 19 es diferente de XXXX, esta columna puede ser = XXXX en caso de que la persona reportada no tenga apellido materno Si se reporto persona moral debe ser nulo el campo.
21	RFC	AN	Si (en caso de omitir columna 22 o 23)	13	Este campo describirá el RFC del titular de la cuenta, contrato, póliza o del No. de seguridad social o de la persona que realizó la operación, según sea el caso. Para los reportes de operaciones preocupantes esta información deberá ser del empleado que se está reportando. Aplica para personas físicas (columna 16 = 1); 4 letras 6 número y 3 caracteres (no obligatorios), donde el formato de los 6 números debe ser una fecha válida AAMMDD Aplica para personas morales (columna 16 = 2); 3 letras 6 números y 3 caracteres (no obligatorios), donde el formato de los 6 números debe ser una fecha válida AAMMDD. Se debe reportar al menos una de las siguientes columnas 21, 22 y/o 23, si se reportan dos o tres columnas de estas mencionadas las fechas contenidas en dichos campos

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO:	0900	PROCESO: LAVADO DE DINERO
	FUENTE:	AFORES	ACTUALIZACIÓN:

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
					deben ser iguales. NOTA: Capturar este campo sin utilizar guión, espacio, u otro tipo de carácter que no forme parte del RFC.
22	CURP	AN	Si (en caso de omitir columna 21 o 23)	18	En el caso de personas físicas poner el CURP del titular de la cuenta, contrato, póliza o del No. de seguridad social o de la persona que efectuó la operación, según sea el caso. Para los reportes de operaciones preocupantes esta información deberá ser del empleado que se está reportando. Aplica para personas físicas (columna 16 = 1); 4 letras 6 número y 3 caracteres (no obligatorios), donde el formato de los 6 números debe ser una fecha válida AAMMDD de lo contrario poner nulo. Se debe reportar al menos una de las siguientes columnas 21, 22 y/o 23, si se reportan dos o tres columnas de estas mencionadas las fechas contenidas en dichos campos deben ser iguales. NOTA: Capturar este campo sin utilizar guión, espacio, u otro tipo de carácter que no forme parte del CURP.
23	FECHA DE NACIMIENTO O CONSTITUCIÓN	N	Si en caso de omitir columna 21 o 22	8	Será utilizado para especificar la fecha de nacimiento en el caso de personas físicas y el de constitución en el caso de personas morales. Formato: AAAAMMDD, en donde: AAAA=Año, MM=Mes y DD=Día. Se debe reportar al menos una de las siguientes columnas 21, 22 y/o 23, si se reportan dos o tres columnas de estas mencionadas las fechas contenidas en dichos campos deben ser iguales.
24	DOMICILIO	AN	Si	60	Especificar el domicilio de la persona que se reporta de la siguiente manera: indicar la Calle, número exterior e interior (si aplica), código postal.
25	COLONIA	AN	Si	30	Especificar la colonia del domicilio de la persona que se reporta. En el caso de un usuario ocasional, no cuenta habitante, no se incluye la exigencia para requerir la información sobre la colonia, por lo que se podrá capturar con un cero.
26	CIUDAD O POBLACIÓN	AN	Si	8	Especificar la clave de la localidad en la cual se encuentra el domicilio de la persona que se reporta conforme al catálogo de localidad. NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF.
27	TELÉFONO OFICINA/PARTICULAR	AN	Si	40	Especificar el teléfono de oficina/particular o celular de la persona que se reporta. Cuando se reporte más de un teléfono, estos deberán de ir separados por una diagonal (/), en el caso de que alguna entidad financiera no pueda separar los teléfonos, capturarlos tal y como los tengan registrados. NOTA: Campo obligatorio si el sujeto obligado cuenta con la información.
28	ACTIVIDAD ECONÓMICA	AN	Si	7	Especificar la clave de la actividad económica de la persona que se reporta de acuerdo al catálogo correspondiente. NOTA: Este catálogo es actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la UIF.
29	AGENTE APODERADO DE SEGUROS Y/O FIANZAS NOMBRE **	AN	No	60	Se utilizará para especificar el nombre del agente o apoderado de seguros y/o fianzas. Únicamente aplica para las instituciones que supervisa la Comisión Nacional de Seguros y Fianzas, por lo que respecta a las instituciones que supervisa la CONSAR y la CNBV, deberán dejar vacías estas columnas utilizando los

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
					separadores.
30	APELLIDO PATERNO **	AN	No	60	Se utilizará para especificar el apellido paterno del agente o apoderado de seguros y/o fianzas. Únicamente aplica para las instituciones que supervisa la Comisión Nacional de Seguros y Fianzas, por lo que respecta a las instituciones que supervisa la CONSAR y la CNBV, deberán dejar vacías estas columnas utilizando los separadores.
31	APELLIDO MATERNO **	AN	No	30	Se utilizará para especificar el apellido materno del agente o apoderado de seguros y/o fianzas. Únicamente aplica para las instituciones que supervisa la Comisión Nacional de Seguros y Fianzas, por lo que respecta a las instituciones que supervisa la CONSAR y la CNBV, deberán dejar vacías estas columnas utilizando los separadores.
32	RFC **	AN	No	13	El Registro Federal del Contribuyente es utilizado como Clave de autorización por la CNSF. Únicamente aplica para las instituciones que supervisa la Comisión Nacional de Seguros y Fianzas, por lo que respecta a las instituciones que supervisa la CONSAR y la CNBV, deberán dejar vacías estas columnas utilizando los separadores.
33	CURP **	AN	No	18	La Clave Única de Registro de Población será utilizada en el caso de personas físicas. Únicamente aplica para las instituciones que supervisa la Comisión Nacional de Seguros y Fianzas, por lo que respecta a las instituciones que supervisa la CONSAR y la CNBV, deberán dejar vacías estas columnas utilizando los separadores.
34	CONSECUTIVO DE CUENTAS Y/O PERSONAS RELACIONADAS *	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes)	2	Nos indicará el número correspondiente de persona y/o cuenta relacionada respecto a una operación reportada. Si una operación tiene "n" personas y/o cuentas relacionadas, los consecutivos asignados comenzarán desde el 01 hasta "n". Para la operación principal, el consecutivo de cuentas y/o personas relacionadas (columna 34) contendrá el número doble cero (00). Este Campo aplica únicamente para reportes de operaciones Inusuales y Preocupantes con relacionados. Para operaciones relevantes debe ser nulo. Si (col. 34 = 00), entonces (col. 35, 36, 37, 38 y 39) Nulas. Si (col. 34 >= 01), entonces (col. 35, 36, 37 y 38 No nulas), ó (37 y 38 No nulas). Si el folio (col. 3) es <> (diferente) al folio (col. 3 del registro inmediato anterior), entonces el consecutivo de cuentas relacionadas (col. 34) es igual a "00". Si el folio (col. 3) es = (igual) al folio (col. 3) del registro inmediato anterior, entonces el consecutivo de cuentas relacionadas (col. 34) comenzará en "01" y se incrementará en 1 sucesivamente por cada operación (repetición de folio col.3) y/o cuenta relacionada que se reporte. NOTA.- En el supuesto de cuentas relacionadas solo deberán llenarse las columnas 34 a 39 sin que sea necesario que se repita la información de la cuenta principal, con excepción de la información contenida en las columnas 1 a 5 que corresponden a los datos de referencia del reporte.
35	NUMERO DE CUENTA, CONTRATO,	AN	Si (op. Inusuales)	16	Especificar el número de la cuenta, contrato, póliza o número de seguridad social que estén relacionados con la operación que

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
	OPERACIONES, PÓLIZA O NUMERO DE SEGURIDAD SOCIAL *		y preocupantes)		se reporta. Este Campo aplica únicamente para reportes de operaciones Inusuales y Preocupantes con relacionados. En caso de que por naturaleza de la operación no intervenga un número de cuenta, se deberá reportar el número de referencia que identifica la operación. Si columna 34 es = 00 entonces no debe haber dato. (nulo). Si columna 34 es > 00 entonces debe haber dato. (no nulo).
36	CLAVE DEL SUJETO OBLIGADO*	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes)	6	Especificar la clave de la entidad financiera o institución en donde se encuentra la cuenta o se realizó la operación relacionada. Según catálogo de sujetos obligados (AFORES) anexo. Si columna 34 es = 00 entonces no debe haber dato en esta columna. (nulo). Si columna 34 es > 00 entonces debe haber dato. (no nulo).
37	NOMBRE DEL TITULAR DE LA CUENTA O DE LA PERSONA RELACIONADA. *	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes)	60	Para persona física cuando exista. Si la columna 35 contiene datos, especificar el nombre del titular de la cuenta relacionada. En caso contrario reportar el nombre de la persona relacionada. Si columna 34 es = 00 entonces no debe haber dato en esta columna (nulo). Si columna 34 es > 00 entonces debe haber dato (no nulo).
38	APELLIDO PATERNO DE LA PERSONA RELACIONADA *	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes. Para persona física cuando exista)	60	Para persona física cuando exista, especificar el apellido paterno del titular de la cuenta relacionada. En caso contrario reportar el apellido paterno de la persona relacionada. En caso de que la persona reportada no tenga apellido paterno se deberán capturar cuatro equis (xxxx). Si columna 34 es = 00 entonces no debe haber dato en esta columna (nulo). Si columna 34 es > 00 entonces debe haber dato (no nulo). Campo nulo en caso de que la persona moral no tenga diferencia entre su nombre comercial y su razón social.
39	APELLIDO MATERNO DE LA PERSONA RELACIONADA *	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes. Obligatorio para persona física cuando exista)	60	Especificar el apellido materno del titular de la cuenta relacionada. En caso contrario reportar el apellido materno de la persona relacionada. En el caso de que alguna entidad financiera o institución no pueda separar el apellido materno del paterno, podrá reportar el apellido materno en la columna 38 (apellido paterno) a efecto de que en dicha columna queden ambos apellidos. Si columna 34 es = 00 entonces no debe haber dato en esta columna (nulo). Si columna 34 es > 00 entonces puede haber dato (no nulo). Si la columna 38 = XXXX entonces la columna 39 no debe ser nulo.
40	DESCRIPCIÓN DE LA OPERACIÓN *	AN	Si (op. Inusuales y preocupantes)	Variable	En este campo se deberá describir la operación que motiva al reporte de la operación Inusual o Preocupante. Se sugiere incluir las características del cliente con información del comportamiento normal, sus promedios, cuentas, actividades e historia financiera. Por operativa, se indicará la fecha de generación de la alerta. Adicionalmente se detallará el periodo (fecha inicio y fecha fin) en el cual se acumularon las transacciones de la operativa a reportar. En caso de complemento indicar <<COMPLEMENTO>> al principio de este campo
41	RAZONES POR LAS	AN	Si	Variable	Este campo describirá el análisis de la operación Inusual o

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

Columna	Concepto	Tipo	Obligatorio	Longitud	Observaciones
	QUE EL ACTO U OPERACIÓN SE CONSIDERA INUSUAL O PREOCUPANTE *		(op. Inusuales y preocupantes)		preocupante.

CATALOGO(S)

NOTA: Estos catálogos son actualizados por los organismos supervisores en coordinación con la UIF, cuando existan cambios la CONSAR, notificará oportunamente estos a sus Sujetos obligados (AFORES). Haciendo llegar a cada Afore los catálogos denominados de tipo transversal con la fecha de publicación, de aplicación y la versión. Dichos catálogos son los siguientes:

1. Localidad,
2. Moneda,
3. Actividad Económica,
4. Tipo de Operación,
5. Instrumento Monetario,
6. Errores de Validación,
7. Reglas de Validación,
8. Tipo de Cambio por Moneda,
9. Días Feriados,
10. Sujetos Obligados (Afores),
11. Tipo de Reporte y,
12. País de Nacionalidad

Dichos catálogos serán notificados por CONSAR por medio electrónico o a través de un CD, cada vez que existan cambios en estos.

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Este formato no contempla periodo de retransmisión como lo establece la Circular 19 Vigente.
- III. Las entidades correspondientes comprometidas a enviar los archivos de reportes de Operaciones Relevantes, Inusuales y Preocupantes en el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES)
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

Anexo 69

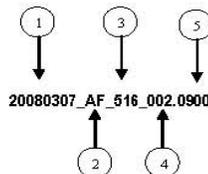
FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO:	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

- V. La CONSAR notificará oportunamente a las AFORES a través de medio electrónico (CD), los cambios que la Unidad de Inteligencia Financiera de la SHCP realice a los catálogos denominados transversales: Localidad, Moneda, Actividad Económica, Tipo de Operación, Instrumento Monetario, Errores de Validación, Reglas de Validación, Tipo de Cambio por Moneda, Días Feriados, Sujetos Obligados (Afores) y Tipo de Reporte.
- VI. Catálogos lineales. Los catálogos lineales son los que define cada Sujeto Obligado (Afore) y/o su Organismo Supervisor (Consar) y son: Catálogo de Sujeto Obligado (Afore) y finalmente Catálogo de Sucursales. Estos Catálogos deberán ser actualizados por el Organismo Supervisor (Consar) previa actualización por parte de las Afores hacia CONSAR. En caso de que el Organismo Supervisor (Consar) no actualice estos catálogos, las operaciones que hagan referencia a datos inexistentes en los catálogos serán rechazadas.
- VII. 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 "AAAAAMDD".
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 = "AF" .
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Afores que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento.
4	3 DÍgitos Numéricos	Estos establecen la clave del tipo de Reporte que se está transmitiendo, en donde: 001=Relevante, 002=Inusual y 003= Preocupante.
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 = "0900" .

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 Afore XXI estuviera enviando su Reporte de operaciones Inusuales, 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_AF_516_002.0900.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:

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO:	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

A20080307_AF_516_002.0900

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

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

TIPO DE ACCIÓN	RUTA
Envío	export/home/rec/LAVDIN/RECEPCION
Recuperación de Acuse CONSAR	export/home/rec/LAVDIN/TRANSMISION
Recuperación de Acuse UIF	export/home/rec/LAVDIN/UIF/TRANSMISION

- **NOTA:** Este formato no contempla retransmisiones

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

TIPO DE ACCIÓN	RUTA
Envío Pruebas	export/home/rec/LAVDIN/PRUEBAS/RECEPCION
Recuperación de Acuse de pruebas CONSAR	export/home/rec/LAVDIN/PRUEBAS/TRANSMISION
Recuperación de Acuse de pruebas UIF	export/home/rec/LAVDIN/PRUEBAS/UIF/TRANSMISION

IX. Recuperación de Acuses; las entidades deberán de recoger por cada envío de operaciones RIP, dos acuses, primeramente el que corresponde a la recepción de este a CONSAR y segundo los definitivos que corresponden a las validaciones internas de la información que emite la UIF. Cabe aclarar que si su acuse CONSAR presenta errores y el horario de ventana culmino, este archivo no será enviado a la UIF para su validación, solo aquellos archivos que tengan estatus correcto en el Acuse CONSAR, se enviaran a la UIF para que en un lapso no mayor a 24 hrs. y menor a 15 hrs. de su envío a CONSAR, pueda la entidad ir a tomar su acuse definitivo generado por la UIF en la ruta especificada según punto VII.

Acuse CONSAR:

Para la recuperación de los acuses generados por la CONSAR, 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 y quitar la extensión pgg, ejemplo:

A20080307_AF_516_002.0900

Acuse UIF:

Para la recuperación de los "Acuses" generados por la UIF, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que tomarán el generado por CONSAR, solo tendrán que agregar la extensión APA, ejemplo:

A20080307_AF_516_002.0900.APA

En caso de que fueran acuses de **correcciones y complementos**, estos se generarán una vez que la UIF acepte o rechace la transmisión de esos reportes y se generará un acuse de "Retransmisión" el cual tendrá la extensión ART, ejemplo:

A20080307_AF_516_002.0900.ART

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

NOTA: Si se encuentra el sujeto obligado (Afore) en esta situación y se tiene duda de cómo pedir una corrección o complemento deberá de comunicarse con el usuario de CONSAR encargado de vigilar dicho proceso.

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

1. La separación entre campos será mediante (,) un punto y coma entre cada columna, por tal motivo se debe evitar el uso indebido de este carácter (,) en la descripción de los campos de tipo texto. En el caso de no contar con la información de algún campo, se utilizará el punto y coma de manera consecutiva sin dejar espacios en blanco. Todas la operaciones reportadas deberán terminar con punto y coma ",". Es decir, un renglón de una operación reportada, deberá contener 41 puntos y comas en total, incluyendo al final un retorno de carro para indicar que sigue otra operación.
2. El tamaño del campo esta definido por la longitud especificada en cada columna, en donde la longitud del campo debe ser menor o igual a la longitud de campo, cuando el tamaño del algún campo sea mayor al definido en el Layout, se truncará la información al número de caracteres definidos en el presente formato layout, y se terminará con (,) siempre y cuando esta información sea texto libre.
3. Toda la información contenida en el archivo deberá ser reportada en letras mayúsculas.
4. Tipo de caracteres permitidos en el presente formato layout, deberá ser reportada de acuerdo a los caracteres contenidos en la siguiente tabla.

!	2	@	M	Z
#	3	A	N	[
\$	4	B	O]
%	5	C	P	^
(6	D	Q	=
)	7	E	R	~
*	8	F	S	¡
+	9	G	T	À
Espacio	:	H	U	É

-	<	I	V	Í
.	=	J	W	Ï
0	>	K	X	Û
1	?	L	Y	Ñ
&	/	,		

*** Este es como tal el espacio y se dejó el nombre para no dejarlo en blanco.

Por lo que en cualquier envío de información solo se permitirán caracteres que se encuentren en este listado, especialmente para los denominados "ALFANUMERICOS" (Nota: verificar que solamente se manden letras mayúsculas). Para los datos de tipo "Numérico" solo se podrán enviar números del 0 al 9, salvo que se describa lo contrario en algún caso en especial sin signo.

Anexo 69

FORMATO DE TRANSMISIÓN DE INFORMACIÓN POR PROCESO			
	FORMATO DEL ARCHIVO :	0900	PROCESO : LAVADO DE DINERO
	FUENTE :	AFORES	ACTUALIZACIÓN :

5. Un sujeto obligado (AFORE) sólo puede enviar al día un archivo de cada tipo por tipo de reporte por periodo.
6. Se deberá de enviar el archivo aún cuando el Sujeto Obligado (AFORE) no tenga operaciones que reportar, para transmitir en ceros bastará con mandar el archivo del periodo a reportar con un "0" (CERO) en su interior.
7. En el caso de personas y/o cuentas relacionadas que estén involucradas con reportes de operaciones inusuales y preocupantes, solo deberán llenarse de las columnas 1 a la 5 y de las columnas 34 a 39 sin que sea necesario que se repita la información de la cuenta principal, esto es, las demás columnas se deberán enviar en blanco.
8. Las columnas marcadas con * (14, 34 a la 41) no aplican para operaciones relevantes.
9. Las columnas marcadas con ** (29 a la 33) no aplican para CONSAR, por lo cual los sujetos obligados (Afores) deberán de especificar un nulo.
10. Los Catálogos transversales son los que son utilizados por todos los Sujetos Obligados, independientemente de su Organismo Supervisor, estos catálogo son actualizado por los organismos supervisores en coordinación con la Unidad de Inteligencia Financiera, estos son: País, Estado, Localidad, Moneda, Actividad Económica, Tipo de Operación, Instrumento Monetario, Errores de Validación, Reglas de Validación, Tipo de Cambio por Moneda y Días Feriados. La UIF tiene la administración de "catálogos transversales" coordinándose con los diferentes Organismos Supervisores en cuanto a la definición de criterios para su elaboración y mantenimiento.
11. En caso de que algún archivo sea rechazado, el Sujeto Obligado (AFORE) deberá reportar en un nuevo periodo de transmisión los registros que corrigen los rechazos.

REPORTES DE OPERACIONES EXTEMPORÁNEAS, CORRECCIONES Y COMPLEMENTOS

12. Se trata de un archivo de envío (periodo y folios nuevos) que contiene además de la información del periodo a reportar algunos de los siguientes registros:
 - Registros de operación no reportados en un periodo anterior. (Periodo y folios nuevos)
 - Registros que por error hayan sido rechazados en su momento (periodo y folios nuevos)
13. Se trata de un archivo de envío (periodo y folios iguales al envío original) que contiene solamente algunos de los siguientes registros:
 - Registros con información que corrige registros aceptados previamente (periodo y folios originales, esto es, iguales al registro enviado anteriormente. Se requiere una detallada explicación en la descripción de la operación de la sustitución, esto último además de la descripción normal de la operación que se reporta.
 - Registros que solicitan la exclusión de una registro aceptado previamente (periodo y folios originales, esto es, iguales al registro enviado anteriormente), incluyendo <<EXCLUSIÓN>> como primera palabra en la descripción de la operación, (entre dobles signos << >>, como se muestra). Se requiere una detallada explicación en la descripción de la operación del porqué de la exclusión, esto último además de la descripción normal de la operación que se reporta.

Esto sólo se puede presentar en archivos de inusuales y preocupantes.

 - Registros con información complementaria a operaciones (periodo y folios originales, esto es, iguales al registro enviado anteriormente), incluyendo <<COMPLEMENTO>> como primera palabra en la descripción de la operación (entre dobles signos << >>, como se muestra). Este tipo de registros tienen permiso de hasta 60 días posteriores a la fecha de detección.

Se da sólo en archivos de inusuales y preocupantes.

Anexo 75

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO 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. ¹
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. ⁶

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

		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
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 Siefore 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 Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
12	Consecutivo		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

		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
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104 118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que los valores reportados no cuenten con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo 15 del presente formato "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Monto total a liquidar		N	14	2	119 134	Monto total a liquidar en la operación en pesos En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. ²
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135 140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141 146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
20	Divisa		N	2	0	147 148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. ¹
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149 163	Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con 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: -En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación. -En caso de flujos por dividendos o cupones se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes. -En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172 175	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporte se deberá llenar con ceros ¹⁰ .

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	
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176 176	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: SF=1 y No=0 ¹ .
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. 1 – Agresor 2 – Agredido Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción. ¹
29	Clase de Activo de la Inversión tercerizada		N	3	0	181 183	En caso de ser inversión tercerizada se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de Activos de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con 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

Anexo 75

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

004	SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL	PS
017	SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS	AV

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

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

Anexo 75

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0316 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	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

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

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción

Anexo 75

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

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

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

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

Anexo 75

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

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

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

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

Anexo 75

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

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

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080020	Valores Finamex International Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080021	Finamex Securities Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080022	Valores Finamex Limited
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080023	Interacciones Global Incorporated
013006	HSBC Casa de Bolsa	080024	Inter-Financial Services, Limited
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080025	Monex Securities Incorporated
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finamex Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013013	IXE Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013018	Casa de Bolsa Arka	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013019	Value Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013020	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 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.

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
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	Intercom Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Yanguardia 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	Confía 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	Bancreecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofimec, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Aesoría 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	Finanex 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)

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
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701011	BNP Paribas (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701013	Bear Stearns (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701017	Citibank (Extranjero)
037135	Nacional Financiera	701018	Comerica Bank (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701019	Commerzbank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Invex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca 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)

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
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
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040145	Banco Base	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801152	Citi Bank N.A. New York Offices
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801153	Pershing Inc.
076000	Otros Operadores	801154	Calyon Financial Inc.
076001	Derfin	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076008	Stock & Price	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076010	Sotia Inverlat Derivados	801157	Segregación de Instrumentos
076014	García Macías, Araneda y Asociados G-AMAA Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Seraf)	801159	Reclasificaciones
076022	Darka	801160	Acciones Propias
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801161	Cortes Transversales
076043	Timber Hill LLC.	801162	Bank West
076044	Enlace Derivados	801163	Bcpbank Canada
076048	Intercam Derivados	801164	Bridgewater Bank
079001	Bancomer Holding Islas Caimán	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801166	Canadian Tire Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079005	Intemex Holding, S.A.-Luxemburgo	801168	Citizens 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
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán	801169	Cs Alterra Bank
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801172	General Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust — Islas Caimán	801174	Manulife Bank Of Canada
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079016	B.J. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079017	B.J. Bank and Trust.- Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079018	B.J. Remitances Company.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801179	Us Bank N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801180	Surtrust Bank
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Natinsa Holdings Corp.	801182	Fia Card Svc N.A.
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801183	Regions Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801184	National City Bank
079028	BBVA Bancomer USA	801185	Branch Bkg & TC
079029	Dinero Express	801186	State Street B&TC
079030	Banorte USA Corporation	801187	Countrywide Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801188	Pnc Bank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801189	Keybank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801190	Lasalle Bank N.A.
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801191	North Fork Bank
080001	Acci Securities Incorporated	801192	Manufacturers & Traders Tc
080004	Afin Securities International Limited	801193	Bank Of The West
080005	Arka Securities Incorporated	801194	Fifth Third Bank
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801195	Northern TC
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	801196	Goldman Sachs Paris
080013	Vectormex Incorporated	900000	Otros mandatarios
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900001	Schroders Plc.
080015	Vectormex International Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	910000	Otras Bolsas de Derivados
		920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

Anexo 75

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0316
	FUENTE : 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. La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CERO para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

Anexo 75

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

POLITICAS GENERALES DEL PROCESO

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

- 1° ISIN, de no existir éste,
- 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,
- 3° SEDOL

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

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

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;

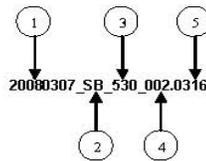
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo 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 guion bajo, después del paso 4 será mediante un punto decimal.

Anexo 75

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

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
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. ¹
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. ⁶

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 INFORMACIÓN 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 Siefore, 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. En otro caso reportar ceros. 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.
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	Fecha	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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. ¹
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 Siefore. 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. ⁶

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. ⁵ 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. ⁸

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. En otro caso reportar ceros. 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 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 ³ 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 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. ⁶

Anexo 77

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

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
32	Medio de Concertación		N	1	0	389 389	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1= Telefónico 2= Electrónico. ¹
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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
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 Siefore. 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	Vacios. ⁶

Anexo 77

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Longitud Dec.	Posición De:	Posición A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303"
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 Siefore, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹

Anexo 77

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
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. En otro caso reportar ceros. ¹
19	Fecha de la operación		F	8	0	124 131 Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ²
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 Contraparte primera		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 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		
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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
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	Vacíos. ⁵

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		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.
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

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO 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. ⁸
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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura.
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. ²
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

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO 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. ⁶
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. ⁶

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE LOS CUPONES DE LAS OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)							
Solo se enviará la primera vez que se reporta la información del SWAP o bien cuando algún parámetro del calendario tenga cambios.							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		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. ⁶
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁶
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. ¹⁶
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 nominal. 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		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. ²
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. ²
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 "EFFECTIV". 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. ¹⁶

Anexo 77

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

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	
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

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

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.	
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. ³
24	Espacios en blanco		AN	394	0	260	653	Vacios. ⁶

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De.	A.	
1	Tipo de Registro		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, ⁵ cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja.
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

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 Siefore, 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. En otro caso reportar ceros. ¹
16	Fecha de operación		F	8	0	93 100	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
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 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. ²
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

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	
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
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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. ¹
41	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	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

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



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	
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
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 Siefore. 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. ⁵

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION 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; 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	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. En otro caso reportar ceros. ⁴
18	Fecha de operación		F	8	0 121 128	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ⁴
19	Fecha de inicio		F	8	0 129 136	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. ³
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0 137 144	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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura.
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

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

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	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 Siefore. 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. ⁶

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	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 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	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. ⁶
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 Siefore, 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. En otro caso reportar ceros. ¹
20	Fecha de la operación		F	8	0	125 132	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ⁴
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

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

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACIÓN 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. ²
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

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

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Data	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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
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	Data	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". ¹

Anexo 77

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

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	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. ⁸	
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. ³
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 a 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 Siefiore. 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

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

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Fecha	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.
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 Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
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 INFORMACIÓN 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 INFORMACIÓN VIGENTE DE LAS LINEAS OPERATIVAS (THRESHOLDS) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN 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 ISDAM EX 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 VIGENTE DE LAS LINEAS OPERATIVAS (THRESHOLDS) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN 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 Siefore para cada contrato ISDA reportado para cada contraparte, en el presente detalle. No se podrán reutilizar los identificadores para la misma contraparte en ningún caso. ¹
5	Tipo de Neteo		N	1	0 34 34	Se deberá anotar el tipo de neteo de derivados establecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para el cómputo de consumo de las líneas operativas (threshold) según el catálogo de "Tipo de Neteo". ¹
6	Threshold establecido por la Contraparte		N	9	0 35 43	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como línea operativa o margen operativo para la Siefore. ¹
7	Divisa del Threshold establecido por la Contraparte		N	2	0 44 45	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. ¹
8	Threshold establecido por la Siefore		N	9	0 46 54	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la Siefore como línea operativa 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. ¹
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

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

CATALOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI 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

Anexo 77

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

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 (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo Aperturas y Cierres

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

Catálogo de Divisa

Identificador	Descripción
---------------	-------------

Anexo 77

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

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

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).

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

Anexo 77

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

En las fechas que no exista detalle, a reportar, de cupones se empleará el Estatus de Operación 1	100	Otros	OTR
---	-----	-------	-----

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 nacionales
1	Intercambia nacionales al inicio
2	Intercambia nacionales al final
3	Intercambia nacionales 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.mex	mxAAA	HR AAA	1000
AA+ (mex)	Aa1.mex	mxAA+	HR AA+	1001

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
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
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

Anexo 77

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

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

Catálogo de Tipo de Garantía	
Identificador	Descripción
1	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

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
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 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	Intercom Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.

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
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	Cremita Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	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 Tambe	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	BNP 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 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
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 Inwex	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	LIFFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)

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
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
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040145	Banco Base	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801153	Pershing Inc.
076000	Otros Operadores	801154	Calyon Financial Inc.
076001	Derfin	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076008	Stock & Price	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076010	Scotia Inverlat Derivados	801157	Segregación de Instrumentos
076014	García Macías, Aráneda y Asociados GAMA Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801159	Reclasificaciones
076022	Darka	801160	Acciones Propias
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801161	Cortes Transversales
076043	Timber Hill LLC.	801162	Bank West
076044	Enlace Derivados	801163	Bcpbank Canada
076048	Intercom Derivados	801164	Bridgewater Bank
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801166	Canadian Tire Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc.-Delaware, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079005	Internex Holding, S.A.- Luxemburgo	801168	Citizens Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801169	Cs Alterna Bank
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada

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
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801172	General Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801174	Manulife Bank Of Canada
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801179	Us Bank N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801180	Suntrust Bank
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801182	Fia Card Svc N.A.
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801183	Regions Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801184	National City Bank
079028	BBVA Bancomer USA	801185	Branch Bkg & TC
079029	Dinero Express	801186	State Street B&TC
079030	Banorte USA Corporation	801187	Countrywide Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801188	Pnc Bank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801189	Keybank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801190	Lasalle Bank N.A.
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801191	North Fork Bank
080001	Acci Securities Incorporated	801192	Manufacturers & Traders Tc
080004	Afin Securities International Limited	801193	Bank Of The West
080005	Arka Securities Incorporated	801194	Fifth Third Bank
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801195	Northern TC
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	801196	Goldman Sachs Paris
080013	Vectormex Incorporated	900000	Otros mandatarios
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900001	Schroders Plc.
080015	Vectormex International Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	910000	Otras Bolsas de Derivados
		920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	FORMATO DEL ARCHIVO : 0314 FUENTE : 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. 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 = "AAAAMDDAAAAMDD" donde:

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

Anexo 77

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

- 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 Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente:

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

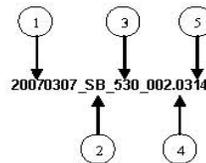
Anexo 77

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

5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0314" .
---	---------------------	---

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

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



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

20070307_SB_530_002.0314.gpg

Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a CONSAR el archivo. Para la recuperación de los acuses, las entidades participantes deberán tomar su "Acuse" con el mismo nombre con el que lo renombraron antes de encryptarlo, 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 encryptado el acuse.

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 078

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

ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = 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 Siefiore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. ¹
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad Siefiore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefiores, anexos. 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 Siefiores, anexos. 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 REPORTE						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = 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 Ineval. 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 ⁴ , 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

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

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
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 definido por la Siefore, el cual está asociado al folio del colateral de la operación en su caso. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Colateral recibido por concepto de operaciones en 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	Vacios. 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

		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
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 Siefore 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 Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Ineval. ¹⁵

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
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		N	14	2	119 134	Monto total a liquidar en la operación en pesos. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". ²
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135 140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141 146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
20	Divisa		N	2	0	147 148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. ¹
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149 163	Tipo de 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

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	
23	Contraparte		N	6	0	166 171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13: -En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación -En caso de flujos por dividendos o cupones se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes -En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
24	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. Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción. 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	
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. ⁵
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 Siefore para cada mandatario. ⁵
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 Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
10	Consecutivo		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
13	Costo Total de Adquisición		N	14	2	91 106	De acuerdo al Catálogo de Tipos de inversión: -Si se indica "1" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner el costo total de la operación del reporto sin incluir el premio. -Si se indica "0, 6, 7, 11" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner costo total de adquisición. Este costo debe ser igual a la cantidad de títulos por el costo promedio unitario. -En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". ²

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
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107 121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122 137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". ²
16	Intereses Devengados		N	14	2	138 153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154 159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
18	País de origen		N	2	0	160 161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario. ¹
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162 164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 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

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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
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 de información 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

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		
34	Valor Nominal Inicial		N	14	6	263	282	Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0 (Denominado en moneda de origen). En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
35	Títulos en Circulación Inicial		N	14	0	283	296	Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
36	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	297	310	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
37	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	311	313	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. ¹
38	Aviso de Recomposición		N	1	0	314	314	Se deberá anotar el identificador con forme al catálogo de Aviso de Recomposición. ¹
39	Índice de Mandato		N	3	8	315	325	Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberá reportar el índice del mandato (truncado a 8 decimales) construido con base 1, afectado por la rentabilidad en pesos diaria del Mandato. En otro caso llenar con ceros. ²
40	Observaciones		AN	18	0	326	343	Si el tipo de derecho o modificación 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	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

Anexo 078

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

DETALLE 4: DETERMINACIÓN DEL PRECIO DE LA ACCIÓN Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
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 GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTO 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:	
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

Anexo 078

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

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTIAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRESTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
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
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

Anexo 078

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

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRÉSTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
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. ⁸
29	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	216	218	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
30	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	219	222	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
31	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	223	225	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
32	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	226	229	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
33	Folio de operación		N	12	0	230	241	Se deberá anotar el folio asociado a la operación de reporte o préstamo de valores definido por la Siefore, el cual deberá ser el mismo reportado en los detalle 1 (Desglose de Valores en Reporto) y 6 (Desglose de valores en préstamo) respectivamente ¹ .
34	Espacios en blanco		AN	102	0	242	343	Vacios ⁶ .

Anexo 078

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

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud 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 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. Se mantendrá constante en tanto el instrumento se encuentre en préstamo. ¹
10	Plazo Actual de la Operación de Préstamo de Valores		N	6	0	66	71	Número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. ¹
11	Cantidad de Títulos en préstamo		N	12	0	72	83	Número de títulos en préstamo (en unidades). ¹
12	Valor inicial de mercado del Préstamo de Valores		N	9	6	84	98	Precio unitario pactado para la operación de Préstamo de Valores en pesos. ²
13	Valor inicial total de mercado del Préstamo de Valores		N	14	2	99	114	Valor inicial total de la operación de Préstamo de Valores sin incluir el premio en pesos. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por valor inicial de mercado. ²
14	Importe pactado de cada operación		N	14	2	115	130	El valor total de la operación de Préstamo de Valores al vencimiento, equivalente al valor inicial total de mercado más el premio 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 del activo objeto del Préstamo de Valores según el Catálogo de Divisas. 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	
19	Divisa de Liquidación		N	2	0	157 158	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el premio de la operación según el Catálogo de Divisas. ¹
20	Tipo de cambio pactado		N	9	6	159 173	Tipo de cambio ⁹ pactado para la liquidación del premio, en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. Para la liquidación del premio en pesos mexicanos reportar 1. ²
21	Contraparte		N	6	0	174 179	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. ¹
22	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	180 199	Se deberá anotar el nombre de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁶
23	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	200 202	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
24	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	203 206	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
25	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	207 209	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	210 213	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
27	Folio de operación		N	12	0	214 225	Se deberá anotar un folio único por cada operación de préstamo de valores definido por la Siefore, el cual está asociado al folio de garantía de la operación. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Garantías recibidas por concepto de operaciones en reporto, 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	Vacios ⁶ .

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO 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 "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

Anexo 078

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

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
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 la emisora asignada 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
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 y 2 Egreso). 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 ³ para liquidar operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. ³

Anexo 078

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

DETALLE 7: INGRESO Y EGRESO MISMO DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
19	Contraparte		N	6	0	139 144	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
20	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	145 164	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
21	Hora de liquidación de la operación mismo día		N	4	0	165 168	Hora de concertación de la operación en caso de ser liquidada el mismo día. ¹⁰
22	Observaciones		AN	16	0	169 184	Se deberá anotar una descripción corta en caso de haber utilizado el Identificador 9 del Catálogo de Subtipo de movimiento. ⁶
23	Espacios en blanco		AN	159	0	185 343	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".
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
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

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	
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	Posición	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 reportada es de entrada 2 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de salida. ¹
4	Monto por liquidar		N	12	2	7 20	Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, en pesos mexicanos, para la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar. ²
5	Monto en divisa		N	12	2	21 34	Se deberán reportar los flujos netos totales que estén pendientes por liquidar en la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle. ²
6	Espacios vacíos		AN	309	0	35 343	Vacios. ⁶

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
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 Siefore para cada mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Emisora reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. ⁵
4	Consecutivo mandato		AN	7	0	15 21	Deberá ser un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Serie reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. ⁵
5	Límite establecido para valores extranjeros		N	14	2	22 37	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en valores extranjeros en el mandato.

Anexo 078

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

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
6	Consumo del límite para valores extranjeros		N	14	2	38 53	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en valores extranjeros. ¹
7	Límite establecido para Renta Variable		N	14	2	54 69	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en renta variable en el mandato. ¹
8	Consumo del límite para Renta Variable		N	14	2	70 85	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en renta variable. ¹
9	Límite establecido para Mercancías		N	14	2	86 101	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en mercancías. ¹
10	Consumo del límite para Mercancías		N	14	2	102 117	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en mercancías. ¹
11	Límite establecido para Divisas		N	14	2	118 133	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en divisas. ¹
12	Consumo del límite para divisas		N	14	2	134 149	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en divisas. ¹
13	Límite establecido para Medida de Control de Riesgo		N	3	8	150 160	Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecido por la Siefore correspondiente al límite de medida de control de riesgo. ¹
14	Consumo del límite para Medida Control de Riesgo		N	3	6	161 169	Se deberá anotar el límite consumido, en porcentaje (truncado a 6 decimales), por el mandato correspondiente al límite de medida de control de riesgo. ¹
15	Espacios vacíos		AN	174	0	170 343	Vacios. ⁶

CATALOGO(S)

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

Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO : 0300		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 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 (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 de Tipo de Inversión		
Id	Abreviación	Descripción
0	Di	Directo
1	Re	Reporto
6	Pv	Préstamo de Valores

Catálogo de Tipo de Liquidación		
Id	Abreviación	Descripción
1	MD	Mismo Día
2	24	24 Hrs.
3	48	48 Hrs.

Anexo 078

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

Catálogo de Tipo de Inversión		
Id	Abreviación	Descripción
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
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
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

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	BTY	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

Anexo 078

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
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

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

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

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

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

Catálogo de Tipo de Movimiento			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	001	Ing	Ingreso
2	002	Egr	Egreso

Anexo 078

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

Catálogo de Subtipo de Movimiento			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	1000-1999	AMRT	Flujo de efectivo por amortización (parcial o total) de activos objeto de inversión
2	2000-2999	LINT	Flujo de efectivo por liquidación de Intereses o cupones
3	3000-3999	LDIV	Flujo de efectivo por liquidación de Dividendos, derechos o premios.
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
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

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
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
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

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
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

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

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

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

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

Anexo 078

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
FORMATO DEL ARCHIVO :	0300	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	Activer 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 Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013124	Intercam Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	BullTick Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	082035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	082037	Creml Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofimec, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	082049	Bancomer Sucursal en Houston
016408	B y B Casa de Cambio	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016419	Finamex Casa de Cambio	700000	Otros Bancos Extranjeros
016507	Casa de Cambio Tamibe	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701001	Abasis
016587	Sterling Casa de Cambio	701002	American Express (Extranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
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	BNP 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)

Anexo 078

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
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	Ike 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 Inwex	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 Landezbank 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	LFE (London International Financial Futures and

Anexo 078

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040133	Banco Actirver	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
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040145	Banco Base	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801153	Pershing Inc.
076000	Otros Operadores	801154	Calyon Financial Inc.
076001	Derfin	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076008	Stock & Price	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076010	Scotia Inverlat Derivados	801157	Segregación de Instrumentos
076014	García Macías, Aráneda y Asociados GAMAA Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801159	Reclasificaciones
076022	Darka	801160	Acciones Propias
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801161	Cortes Transversales
076043	Timber Hill LLC.	801162	Bank West
076044	Enlace Derivados	801163	Bcpbank Canada
076048	Interam Derivados	801164	Bridgewater Bank
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801166	Canadian Tire Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc.-Delaware, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo	801168	Citizens Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801169	Cs Alterna Bank

Anexo 078

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801171	First Nations Bank Of Canada
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801172	General Bank Of Canada
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801173	Laurentian Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801174	Manulife Bank Of Canada
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079018	B.I. Remittances Company.- Islas Caimán	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801179	Us Bank N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801180	Suntrust Bank
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801182	Fia Card Svc N.A.
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801183	Regions Bank
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801184	National City Bank
079028	BBVA Bancomer USA	801185	Branch Bkg & TC
079029	Dinero Express	801186	State Street B&TC
079030	Banorte USA Corporation	801187	Countrywide Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801188	Pnc Bank N.A.
079032	INB Delaware Corporation	801189	Keybank N.A.
079033	Inter Nacional Bank	801190	Lasalle Bank N.A.
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801191	North Fork Bank
080001	Acci Securities Incorporated	801192	Manufacturers & Traders Tc
080004	Afin Securities International Limited	801193	Bank Of The West
080005	Arka Securities Incorporated	801194	Fifth Third Bank
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801195	Northern TC
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	801196	Goldman Sachs Paris
080013	Vectormex Incorporated	900000	Otros mandatarios
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900001	Schroders Plc.
080015	Vectormex International Incorporated	900002	Blackrock Inc.
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	910000	Otras Bolsas de Derivados
		920000	Otros Socios Operadores
		930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

Anexo 078

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

Catálogo de Aviso de Recomposición	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
0	No aplica recomposición
1	En caso de encontrarse en proceso de recomposición se opta por conservar el instrumento
2	En caso de encontrarse en proceso de recomposición 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 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 = "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 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 reporte se deberá calcular conforme a lo siguiente:

Anexo 078

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

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

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.

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.

POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

Anexo 078

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

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect.Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. 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 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 = "0300" .

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

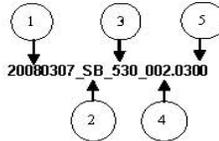
Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Siefore XXI BANORTE estuviera enviando un archivo de Siefore Básica dos, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:

Anexo 078

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0300 **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:

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/P RUEBAS/RECEPCION
Recuperación de Acuse de pruebas	export/home/rec/FINAN/P RUEBAS/TRANSMISION