

**SEGUNDA SECCION**  
**PODER EJECUTIVO**  
**SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO**

**CIRCULAR CONSAR 19-20, modificaciones y adiciones a las Reglas Generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la base de datos nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro.**

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

**CIRCULAR CONSAR 19-20, MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO**

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

**CONSIDERANDO**

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

Que se estima conveniente que las Sociedades de Inversión proporcionen la información sobre el índice de rentabilidad diaria del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión, de tal manera que esta Comisión pueda evaluar la gestión y desempeño de las Sociedades de Inversión de acuerdo a sus portafolios de referencia;

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

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

Que de conformidad con el Anexo M de las “Disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro”, las Administradoras pueden replicar los índices o subíndices dictaminados por el experto independiente como una alternativa de inversión, y en este sentido, algunas Administradoras han implementado una estrategia de inversión adquiriendo directamente Valores Extranjeros de Renta Variable con el fin de replicar uno o varios índices permitidos, por lo que se estima conveniente que las Sociedades de Inversión proporcionen la información que permita supervisar diariamente el cumplimiento a los límites establecidos en el régimen de inversión;

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

Que dando cumplimiento al “Acuerdo que fija los lineamientos que deberán ser observados por las dependencias y organismos descentralizados de la Administración Pública Federal, en cuanto a la emisión de los actos administrativos de carácter general a los que les resulta aplicable el artículo 69-H de la Ley Federal de Procedimiento Administrativo”, a causa de la expedición de la presente Circular, se deroga la fracción XII de la regla Novena; la obligación de las Sociedades de Inversión de reportar la información del Anexo 79 relativo al desglose de operaciones con notas estructuradas, y se simplifica la información de flujos de efectivo incluida en el Anexo 78, ha tenido a bien a expedir la siguiente:

**CIRCULAR CONSAR 19-20, MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.**

**PRIMERO.-** Se **ADICIONAN** la fracción XVII de la regla Séptima, y la fracción XXII de la regla Novena; y se **DEROGA** la fracción XII, de la regla Novena de la Circular CONSAR 19-8, “Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro”, modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18 y CONSAR 19-19 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016 y 6 de septiembre de 2017 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

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

I a XVI. ...

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

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

I a XI. ...

**XII.** Se deroga.

XIII a XXI. ...

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

**SEGUNDO.-** Se **MODIFICAN** los anexos 74, 75, 77, 78, 79, 80, 92, 94, 111, 112 y 120, se **ADICIONAN** los anexos 121 y 122, y se **DEROGA** el anexo 97 de la Circular CONSAR 19-8, “Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro”, modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18 y CONSAR 19-19 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016, y 6 de septiembre de 2017 respectivamente, para quedar en los términos de los Anexos 74, 75, 77, 78, 79, 80, 92, 94, 111, 112, 120, 121 y 122 de las presentes modificaciones y adiciones.

#### TRANSITORIA

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

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

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

Anexo 74

 <p><b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b> 1101 <b>FUENTE:</b> SIEFORES</p>	<p><b>PROCESO:</b> CONTABLE <b>ACTUALIZACIÓN:</b></p>
---	---

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

**ENCABEZADO**

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

**DETALLE(S)**

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

## CATÁLOGO(S)

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	534	001	Siefore Básica Uno	Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001	Siefore Básica Uno	Principal Siefore 1, S.A. de C.V.
002	544	001	Siefore Básica Uno	Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V.
002	550	001	Siefore Básica Uno	Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V.
002	552	001	Siefore Básica Uno	Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V.
002	556	001	Siefore Básica Uno	Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V.
002	562	001	Siefore Básica Uno	Siefore Invercap, S. A. de C. V.
002	564	001	Siefore Básica Uno	Met1 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	001	Siefore Básica Uno	Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V.
002	578	001	Siefore Básica Uno	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.
002	530	002	Siefore Básica Dos	Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V.
002	534	002	Siefore Básica Dos	Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore
002	538	002	Siefore Básica Dos	Principal Siefore 2, S.A. de C.V.
002	544	002	Siefore Básica Dos	Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V.
002	550	002	Siefore Básica Dos	Inbursa Siefore, S.A. de C.V.
002	552	002	Siefore Básica Dos	Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V.
002	556	002	Siefore Básica Dos	Siefore Azteca, S.A. de C.V.
002	562	002	Siefore Básica Dos	Siefore Invercap II, S. A. de C. V.
002	564	002	Siefore Básica Dos	Met2 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	002	Siefore Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	Siefore Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	Siefore Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	Siefore Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	Siefore Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	Siefore Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	Siefore Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.

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

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

<b>POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO</b>
--

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

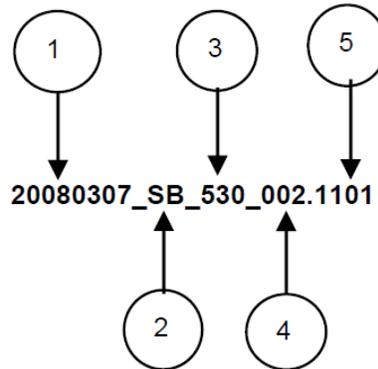
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con éste.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. La información que enviarán las entidades, deberá mantener un día hábil de desfase del cierre del proceso operativo diario.
- IV. Sólo será transmitida la información de las operaciones y del proceso que se realicen durante el procedimiento operativo diario (los procesos y operaciones que no tengan operación no serán transmitidos).
- V. Para cada registro del detalle: Saldo final debe ser igual al saldo inicial más la suma de todos los cargos menos la suma de todos los abonos.
- VI. Todos los montos deberán venir con el signo adecuado dependiendo de la naturaleza de la cuenta:
  - a. Cuenta Deudora: Saldo Deudor (+); Saldo Acreedor (-)
  - b. Cuenta Acreedora: Saldo Deudor (-); Saldo Acreedor (+)
- VII. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- VIII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- IX. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFORES.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "1101"</b> .

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_002.1101.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_002.1101**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 75

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

**DETALLE(S)**

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación <sup>1</sup> .
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores 12 Para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones Tercerizadas <sup>1</sup> .
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01 <sup>1</sup> .

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefiore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV. <sup>5</sup>
11	Serie		AN	7	0	52	58	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefiore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59	68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros <sup>15</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación <sup>3</sup> .
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77	88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
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 Siefiore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15 vigentes. <sup>2</sup> .
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135	140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	147	148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. <sup>1</sup>
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros <sup>2,9</sup> .
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países <sup>1</sup> .
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. 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. <sup>1</sup>
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172	175	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros <sup>10</sup> .
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176	176	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si=1 y No=0 <sup>1</sup> .
26	Medio de concertación		N	1	0	177	177	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación <sup>1</sup> .
27	Sistema de concertación		N	2	0	178	179	En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – MEIPresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO <sup>1</sup> .
28	Tipo de postura		N	1	0	180	180	Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 1 – Agresor 2 – Agredido Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción. <sup>1</sup>
29	Clase de Activo de la Inversión tercerizada		N	3	0	181	183	En caso de ser inversión tercerizada se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de Activos de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros <sup>1</sup> .
30	Observaciones		AN	20	0	184	203	Se deberá anotar el nombre de la contraparte en caso de haber utilizado el Identificador 076000 "otros operadores" o 700000 "otros Bancos extranjeros" como Contraparte <sup>15</sup> .

## CATÁLOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)	
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
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 Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.
002	538	090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	564	090	Siefore Básica de Pensiones	Met 0 Siefore, S.A. de C.V.
002	568	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001	Siefore Básica Uno	Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V.
002	534	001	Siefore Básica Uno	Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001	Siefore Básica Uno	Principal Siefore 1, S.A. de C.V.
002	544	001	Siefore Básica Uno	Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V.
002	550	001	Siefore Básica Uno	Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	552	001	Siefore Básica Uno	Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V.
002	556	001	Siefore Básica Uno	Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V.
002	562	001	Siefore Básica Uno	Siefore Invercap, S. A. de C. V.
002	564	001	Siefore Básica Uno	Met1 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	001	Siefore Básica Uno	Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V.
002	578	001	Siefore Básica Uno	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.
002	530	002	Siefore Básica Dos	Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V.
002	534	002	Siefore Básica Dos	Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore
002	538	002	Siefore Básica Dos	Principal Siefore 2, S.A. de C.V.
002	544	002	Siefore Básica Dos	Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V.
002	550	002	Siefore Básica Dos	Inbursa Siefore, S.A. de C.V.
002	552	002	Siefore Básica Dos	Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V.
002	556	002	Siefore Básica Dos	Siefore Azteca, S.A. de C.V.
002	562	002	Siefore Básica Dos	Siefore Invercap II, S. A. de C. V.
002	564	002	Siefore Básica Dos	Met2 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	002	Siefore Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	Siefore Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	Siefore Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	Siefore Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	Siefore Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	Siefore Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	Siefore Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.

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

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

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen Japonés
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi Chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción
10	EFF	Efectivo
11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
12	MDT	Inversión Tercerizada
13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente

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

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

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

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

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080029	Portfolio Investment Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013004	Casa de Bolsa Santander Serfín	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013006	HSBC Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080034	Banorte I, LLC.
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080037	Invex International, S.A.
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080038	Invex Worldwide, S.A.
013012	Finamex Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013013	IXE Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013018	Casa de Bolsa Arka	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013019	Value Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013020	Actinver Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013021	Monex Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013026	Vector Casa de Bolsa	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013027	Casa de Bolsa Banorte	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013041	Invex Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013106	Deustche Securities Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082037	Crema Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013120	UBS Casa de Bolsa	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
013124	Intercom Casa de Bolsa	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
013125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082049	Bancomer Sucursal en Houston
013126	BullTick Casa de Bolsa	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	700000	Otros Bancos Extranjeros
013129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
013130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701001	Abasis
013131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701002	American Express (Extranjero)
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016041	Casa de Cambio Tiber	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016044	Eurofimex, Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016067	Masari, Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
016408	B y B Casa de Cambio	701010	Bank One (Extranjero)
016419	Finamex Casa de Cambio	701011	BNP Paribas (Extranjero)
016507	Casa de Cambio Tamibe	701012	Barclays Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701013	Bear Stearns (Extranjero)
016587	Sterling Casa de Cambio	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
016629	Money Tron Casa de Cambio	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
016712	Intercom Casa de Cambio	701016	Citi National Bank (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701017	Citibank (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701018	Comerica Bank (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701019	Commerzbank (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701020	Controladora Prosa
016719	Unica Casa de Cambio	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701022	Credit Suisse (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701026	Fortis Bank (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
037135	Nacional Financiera	701030	Indosuez International (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701031	ING Bank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040002	Banco Nacional de México	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040014	Banco Santander	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040021	HSBC México	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701041	Societe Generale (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040037	Banco Interacciones	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040059	Banco Invex	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040060	Bansi	701048	Union Bank (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040103	American Express Bank (México)	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040106	Bank of America México	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)

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

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

**POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

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

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

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

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO****Políticas a seguir en la transmisión de la información**

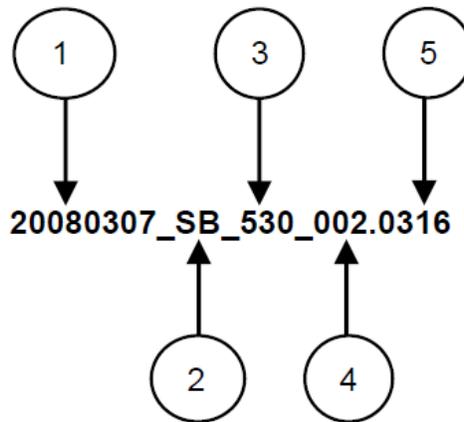
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION.. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "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 (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0316"</b> .

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_002.0316.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_002.0316**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

## Anexo 77

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

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

**Información de Tipo Agregada.** - Este archivo contiene información del desglose de operaciones con instrumentos financieros derivados (Forwards, Futuros, Opciones y Swaps).

PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	738	07:00 a 10:00 Hrs.

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante <b>"738"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0314"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	706	0	33	738	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

## DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Tipo de Operación		N	3	0	141	143	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
13	Subyacente		AN	18	0	144	161	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
14	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que será recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
15	Divisa de Liquidación		N	2	0	165	166	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. <sup>1</sup>
16	Plazo de referencia		N	4	0	167	170	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
17	Fecha de operación		F	8	0	171	178	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
18	Fecha de inicio		F	8	0	179	186	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor o no. <sup>3</sup>
19	Fecha de liquidación		F	8	0	187	194	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0	195	202	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
21	Tamaño del contrato		N	14	2	203	218	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
22	Número de contratos		N	14	0	219	232	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	233	235	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
24	Precio o Tasa pactada		N	14	7	236	256	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	257	262	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	263	263	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
27	Tipo de Valor del Cheapest to Deliver		AN	4	0	264	267	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
28	Emisora del Cheapest to Deliver		AN	7	0	268	274	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
29	Serie del Cheapest to Deliver		AN	6	0	275	280	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	281	289	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
31	Medio de Concertación		N	1	0	290	290	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
32	Contraparte		N	8	0	291	298	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	299	318	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista identificador para la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
34	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	319	321	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación contraparte primera		N	4	0	322	325	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
36	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	326	328	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación contraparte segunda		N	4	0	329	332	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	333	482	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	483	502	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	503	516	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
41	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	517	524	En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
42	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	525	544	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
43	Socio Operador		N	8	0	545	552	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
44	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	553	572	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Socio Liquidador		N	8	0	573	580	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	581	600	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Cámara de Compensación		N	8	0	601	608	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	609	628	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	629	642	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
50	Espacios en blanco		AN	96	0	643	738	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios asignado al contrato. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Tipo de Operación		N	3	0	141	143	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
13	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	144	151	Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. <sup>1</sup>
14	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	152	171	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
15	Subyacente		AN	18	0	172	189	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0	190	191	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
17	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	192	194	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia		N	4	0	195	198	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
19	Fecha de operación		F	8	0	199	206	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
20	Fecha de inicio		F	8	0	207	214	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
21	Fecha de liquidación		F	8	0	215	222	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	223	230	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
23	Tamaño del contrato		N	14	2	231	246	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
24	Número de contratos		N	14	0	247	260	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
25	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	261	263	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Precio o Tasa pactada		N	14	7	264	284	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
27	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	285	290	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
28	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	291	291	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
29	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	292	295	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	296	302	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
31	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	303	308	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
32	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	309	317	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
33	Observaciones y características especiales		AN	150	0	318	467	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
34	Medio de Concertación		N	1	0	468	468	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
35	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	469	482	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
36	Socio Operador		N	8	0	483	490	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no exista el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
37	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	491	510	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". <sup>5</sup>
38	Socio Liquidador		N	8	0	511	518	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
39	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	519	538	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
40	Cámara de Compensación		N	8	0	539	546	Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
41	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	547	566	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
42	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	567	580	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
43	Espacios en blanco		AN	158	0	581	738	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 o 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	141	148	En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
13	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	149	168	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
14	Tipo de opción		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
15	Subclase de opción		N	3	0	172	174	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
16	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	175	175	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
17	Subyacente		AN	18	0	176	193	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
18	Divisa de Liquidación		N	2	0	194	195	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta <sup>1</sup> .
19	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	196	198	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup>
20	Plazo de referencia		N	4	0	199	202	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
21	Fecha de la operación		F	8	0	203	210	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
22	Fecha de inicio		F	8	0	211	218	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
23	Fecha de Liquidación		F	8	0	219	226	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
24	Fecha de Vencimiento		F	8	0	227	234	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
25	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	235	242	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3-</sup>
26	Tipo de operación		N	3	0	243	245	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
27	Tamaño del contrato		N	14	2	246	261	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
28	Número de contratos		N	14	0	262	275	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
29	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	3	0	276	278	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
30	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	279	293	Se deberá anotar el strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
31	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	294	308	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
32	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	309	323	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
33	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	324	329	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas <sup>5</sup>
34	Prima Pactada		N	14	6	330	349	Se deberá anotar el monto de la prima en pesos, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
35	Contraparte		N	8	0	350	357	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC según el Catálogo Contrapartes. En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros <sup>1</sup>
36	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	358	377	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
37	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	378	380	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros <sup>1</sup>
38	Calificación contraparte primera		N	4	0	381	384	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
39	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	385	387	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros <sup>1</sup>
40	Calificación contraparte segunda		N	4	0	388	391	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
41	Observaciones y características especiales		AN	150	0	392	541	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
42	Medio de Concertación		N	1	0	542	542	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
43	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	543	562	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
44	Delta de la opción		N	2	6	563	570	Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes <sup>2</sup>
45	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	571	584	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
46	Socio Operador		N	8	0	585	592	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
47	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	593	612	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
48	Socio Liquidador		N	8	0	613	620	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup> En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
49	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	621	640	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
50	Cámara de Compensación		N	8	0	641	648	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existiera el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
51	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	649	668	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
52	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	669	682	<p>En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.</p> <p>Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.</p> <p>En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.</p> <p>En ningún caso se podrá reutilizar el folio.</p> <p>Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.<sup>1</sup></p>
53	Espacios en blanco		AN	56	0	683	738	Vacíos. <sup>6</sup>

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) = <b>Constante "304"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Swap Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Fecha de operación		F	8	0	141	148	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
13	Tipo de Posición		N	1	0	149	149	<p>En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación al contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2.</p> <p>Se deberá reportar 1 en otro caso.<sup>1</sup></p>
14	Fecha de inicio		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
15	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	158	160	<p>Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar.</p> <p>Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado.<sup>1</sup></p>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
16	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	161	163	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
17	Fecha de próxima liquidación a entregar		F	8	0	164	171	Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>3</sup>
18	Fecha de próxima liquidación a recibir		F	8	0	172	179	Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>3</sup>
19	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	180	183	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
20	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	184	187	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
21	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	188	190	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
22	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	191	193	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
23	Número de cupones a entregar		N	3	0	194	196	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
24	Número de cupones a recibir		N	3	0	197	199	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
25	Valor notional		N	14	6	200	219	Se deberá anotar el monto del valor notional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor notional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
26	Valor nocional 2		N	14	6	220	239	Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
27	Tipo de cambio pactado		N	12	6	240	257	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con nocionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
28	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	258	263	En caso de que las divisas asociadas a los nocionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir, según el catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado. En otro caso, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos nocionales. <sup>5</sup>
29	Divisa del nocional a entregar		N	3	0	264	266	Se registrará el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
30	Divisa del nocional a recibir		N	3	0	267	269	Se registrará el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
31	Divisa de Liquidación		N	2	0	270	271	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que entregará/recibirá la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). <sup>1</sup>
32	Subyacente a entregar		AN	18	0	272	289	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
33	Subyacente a recibir		AN	18	0	290	307	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
34	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	308	313	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
35	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	314	319	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
36	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	320	335	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
37	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	336	351	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
38	Sobretasa a entregar		N	3	2	352	356	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
39	Sobretasa a recibir		N	3	2	357	361	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
40	Tipo tasa a entregar		N	3	0	362	364	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
41	Tipo tasa a recibir		N	3	0	365	367	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
42	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	368	377	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
43	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	378	387	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>5</sup>
44	Amortiza Capital		N	1	0	388	388	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
45	Tipo de intercambios		N	3	0	389	391	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
46	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	392	399	En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
47	Nombre Corto de Bolsa de Derivados		AN	20	0	400	419	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
48	Contraparte		N	8	0	420	427	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
49	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	428	447	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
50	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	448	450	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
51	Calificación contraparte primera		N	4	0	451	454	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
52	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	455	457	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
53	Calificación contraparte segunda		N	4	0	458	461	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
54	Medio de Concertación		N	1	0	462	462	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
55	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	463	482	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
56	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	483	496	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
57	Observaciones y características especiales		AN	117	0	497	613	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
58	Socio Operador		N	8	0	614	621	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
59	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	622	641	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
60	Socio Liquidador		N	8	0	642	649	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
61	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	650	669	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
62	Cámara de Compensación		N	8	0	670	677	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
63	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	678	697	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
64	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	698	711	<p>En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados, se deberá registrar un folio consecutivo para cada estrategia definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.</p> <p>Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.</p> <p>En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.</p> <p>En ningún caso se podrá reutilizar el folio.</p> <p>Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.<sup>1</sup></p>
65	Número de Contratos		N	13	0	712	724	<p>Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos en posición, en valor absoluto. Se deberá reportar en ceros en otro caso.<sup>1</sup></p>
66	Espacios en blanco		AN	14	0	725	738	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE LOS CUPONES DE LAS OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS) Solo se enviará la primera vez que se reporta la información del SWAP o bien cuando algún parámetro del calendario tenga cambios.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "305"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Swap Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Tipo de Cupón		N	1	0	138	138	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. <sup>1</sup>
12	Numero de Cupón		N	3	0	139	141	Comenzando con el cupón vigente. <sup>1</sup>
13	Fecha Inicio		F	8	0	142	149	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. <sup>3</sup>
14	Fecha Final		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. <sup>3</sup>
15	Días de cupón		N	3	0	158	160	Días de cupón. <sup>1</sup>
16	Monto de referencia para amortizar		N	14	6	161	180	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor notional. <sup>2</sup>
17	Nocional		N	14	6	181	200	Se deberá anotar el monto del valor notional del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. <sup>2</sup>

**DETALLE 5:** CONTIENE LA INFORMACION DE LOS CUPONES DE LAS OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS) Solo se enviará la primera vez que se reporta la información del SWAP o bien cuando algún parámetro del calendario tenga cambios.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
18	Subyacente		AN	18	0	201	218	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
19	Sobretasa		N	3	2	219	223	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. <sup>2</sup>
20	Observaciones o Características Especiales		AN	50	0	224	273	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
21	Fecha Inicial de Vigencia del cupón		F	8	0	274	281	Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
22	Fecha Final de Vigencia del cupón		F	8	0	282	289	Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
23	Espacios en blanco		AN	449	0	290	738	Vacios. <sup>6</sup>

**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". <sup>1</sup>
2	Tipo Garantía		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el identificador del tipo de la garantía conforme al catálogo Tipo de Garantía. <sup>1</sup>
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 otro caso se llenará con ceros. <sup>5</sup>
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 otro caso se llenará con ceros. <sup>13</sup>
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 otro caso se llenará con ceros. <sup>14</sup>
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". <sup>15</sup>
7	Emisora de la Garantía		AN	7	0	37	43	Se deberá reportar la clave de la emisora otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la emisora asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EFECTIV". <sup>15</sup>

**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	
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. <sup>15</sup>
9	Consecutivo de la Garantía		AN	10	0	51	60 Se deberá reportar en cero justificado a la izquierda. <sup>15</sup>
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 otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
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 la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros <sup>1</sup>
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 otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
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 otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
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 otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
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 otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
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 otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>

**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
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. <sup>1</sup>
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. <sup>2</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
22	Intereses Devengados		N	14	2	242	257	Importe de los Intereses devengados en pesos de las garantías a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
23	Divisa de la Garantía		N	2	0	258	259	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
24	Traslado de dominio (Prenda Bursátil)		N	2	0	260	261	Se reportará 01 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes nacionales (prenda bursátil) y 02 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes internacionales (CSA). Se reportará 00 en otro caso. <sup>1</sup>
25	Factor de Aforo		N	3	4	262	268	Se deberá reportar el factor de aforo o "haircut" aplicable a la garantía reportada. <sup>1</sup>
26	Número de contrato		AN	30	0	269	298	Se deberá reportar el número de contrato marco al amparo del cuál fue entregada o recibida la garantía. <sup>5</sup>
27	Espacios en blanco		AN	440	0	299	738	Vacios. <sup>6</sup>

**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". <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Tipo de Operación		N	3	0	142	144	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1 - Largo 2 - Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
14	Subyacente		AN	18	0	145	162	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
15	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	163	165	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0	166	167	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta <sup>1</sup> .
17	Plazo de referencia		N	4	0	168	171	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
18	Fecha de operación		F	8	0	172	179	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
19	Fecha de inicio		F	8	0	180	187	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0	188	195	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
21	Tamaño del contrato		N	14	2	196	211	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
22	Número de contratos		N	14	0	212	225	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	226	228	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
24	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	229	249	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
25	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	250	270	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros <sup>2</sup>
26	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	271	286	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
27	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	287	292	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
28	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	293	293	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega.
29	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	294	297	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	298	304	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
31	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	305	310	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
32	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	311	319	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
33	Medio de Concertación		N	1	0	320	320	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
34	Contraparte		N	8	0	321	328	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
35	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	329	348	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
36	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	349	351	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación contraparte primera		N	4	0	352	355	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
38	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	356	358	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
39	Calificación contraparte segunda		N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
40	Observaciones y características especiales		AN	150	0	363	512	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
41	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	513	532	Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
42	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	533	546	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
43	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	547	554	En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
44	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	555	574	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Socio Operador		N	8	0	575	582	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	583	602	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Socio Liquidador		N	8	0	603	610	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	611	630	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Cámara de Compensación		N	8	0	631	638	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
50	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	639	658	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
51	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	659	672	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
52	Espacios en blanco		AN	66	0	673	738	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "308"</b> . <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Tipo de Operación		N	3	0	142	144	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
14	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	145	152	Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. <sup>1</sup>
15	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	153	172	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
16	Subyacente		AN	18	0	173	190	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
17	Divisa de Liquidación		N	2	0	191	192	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
18	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	193	195	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
19	Plazo de referencia		N	4	0	196	199	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
20	Fecha de operación		F	8	0	200	207	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
21	Fecha de inicio		F	8	0	208	215	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	216	223	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
23	Tamaño del contrato		N	14	2	224	239	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
24	Número de contratos		N	14	0	240	253	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
25	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	254	256	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	257	277	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
27	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	278	298	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
28	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	299	314	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
29	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	315	320	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
30	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	321	321	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
31	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	322	325	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
32	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	326	332	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
33	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	333	338	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
34	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	339	347	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
35	Observaciones y características especiales		AN	150	0	348	497	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
36	Medio de Concertación		N	1	0	498	498	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
37	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	499	518	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
38	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	519	532	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
39	Socio Operador		N	8	0	533	540	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
40	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	541	560	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". <sup>5</sup>
41	Socio Liquidador		N	8	0	561	568	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
42	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	569	588	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
43	Cámara de Compensación		N	8	0	589	596	Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
44	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	597	616	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	617	630	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
46	Espacios en blanco		AN	108	0	631	738	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>15</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	142	149	En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
14	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	150	169	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" en otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
15	Tipo de opción		N	3	0	170	172	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
16	Subclase de opción		N	3	0	173	175	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
17	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	176	176	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
18	Subyacente		AN	18	0	177	194	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
19	Divisa de Liquidación		N	2	0	195	196	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta <sup>1</sup> .
20	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	197	199	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup>
21	Plazo de referencia		N	4	0	200	203	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
22	Fecha de la operación		F	8	0	204	211	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
23	Fecha de inicio		F	8	0	212	219	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
24	Fecha de Vencimiento		F	8	0	220	227	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
25	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	228	235	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3-</sup>
26	Tipo de operación		N	3	0	236	238	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
27	Tamaño del contrato		N	14	2	239	254	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
28	Número de contratos		N	14	0	255	268	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
29	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0	269	270	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
30	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	271	291	Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
31	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	292	312	En caso de cierre se deberá anotar el strike al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros <sup>2</sup>
32	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	313	328	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
33	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	329	343	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
34	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	344	358	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
35	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	359	373	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
36	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	374	379	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas <sup>5</sup>
37	Prima Pactada		N	14	6	380	399	Se deberá anotar el monto en pesos de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
38	Contraparte		N	8	0	400	407	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros. <sup>1</sup>
39	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	408	427	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
40	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	428	430	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
41	Calificación contraparte primera		N	4	0	431	434	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
42	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	435	437	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
43	Calificación contraparte segunda		N	4	0	438	441	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
44	Observaciones y características especiales		AN	150	0	442	591	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
45	Medio de Concertación		N	1	0	592	592	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
46	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	593	612	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
47	Delta de la opción		N	2	6	613	620	Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes <sup>2</sup>
48	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	621	634	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
49	Socio Operador		N	8	0	635	642	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
50	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	643	662	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
51	Socio Liquidador		N	8	0	663	670	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
52	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	671	690	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
53	Cámara de Compensación		N	8	0	691	698	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
54	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	699	718	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
55	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	719	732	<p>En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.</p> <p>Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.</p> <p>En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.</p> <p>En ningún caso se podrá reutilizar el folio.</p> <p>Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.<sup>1</sup></p>
56	Espacios en Blanco		AN	6	0	733	738	Vacios. 6

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "310"</b> . <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Swap Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Fecha de operación		F	8	0	142	149	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
14	Fecha de inicio		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
15	Tipo de Posición		N	1	0	158	158	<p>En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2.</p> <p>Se deberá reportar 1 en otro caso.<sup>1</sup></p>

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
16	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	159	161	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
17	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
19	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	169	172	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
20	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	173	175	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
21	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	176	178	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
22	Número de cupones a entregar		N	3	0	179	181	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
23	Número de cupones a recibir		N	3	0	182	184	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
24	Valor nocional		N	14	6	185	204	Se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
25	Valor nocional 2		N	14	6	205	224	Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>2</sup>

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
26	Tipo de cambio pactado		N	12	6	225	242	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con nocionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
27	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	243	248	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para nocionales, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir según el catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado. En otro caso se deberá registrar las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos nocionales. <sup>5</sup>
28	Divisa del nocional a entregar		N	2	0	249	250	Se registrará el identificador de la divisa del nocional a entregar conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
29	Divisa del nocional a recibir		N	2	0	251	252	Se registrará el identificador de la divisa del nocional a recibir conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
30	Divisa de Liquidación		N	2	0	253	254	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que recibirá/entregará la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). <sup>1</sup>
31	Subyacente a entregar		AN	18	0	255	272	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
32	Subyacente a recibir		AN	18	0	273	290	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
33	Divisa del subyacente a entregar		AN	3	0	291	293	Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
34	Divisa del subyacente a recibir		AN	3	0	294	296	Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
35	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	297	312	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
36	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	313	328	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
37	Sobretasa a entregar		N	3	2	329	333	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
38	Sobretasa a recibir		N	3	2	334	338	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
39	Tipo tasa a entregar		N	3	0	339	341	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
40	Tipo tasa a recibir		N	3	0	342	344	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
41	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	345	354	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
42	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	355	364	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
43	Amortiza Capital		N	1	0	365	365	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
44	Tipo de intercambios		N	3	0	366	368	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
45	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	369	376	En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	377	396	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Contraparte		N	8	0	397	404	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	405	424	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	425	427	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
50	Calificación contraparte primera		N	4	0	428	431	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro reportar ceros. <sup>1</sup>
51	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	432	434	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
52	Calificación contraparte segunda		N	4	0	435	438	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
53	Medio de Concertación		N	1	0	439	439	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
54	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	440	459	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
55	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	460	473	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
56	Observaciones y características especiales		AN	117	0	474	590	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
57	Socio Operador		N	8	0	591	598	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
58	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	599	618	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
59	Socio Liquidador		N	8	0	619	626	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
60	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	627	646	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
61	Cámara de Compensación		N	8	0	647	654	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
62	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	655	674	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
63	Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición		N	14	7	675	695	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
64	Monto Neto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	696	711	Se deberá anotar el monto neto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
65	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	712	725	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
66	Número de Contratos		N	13	0	726	738	Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos operados, en valor absoluto. <sup>1</sup>

**DETALLE 11:** CONTIENE LA INFORMACION VIGENTE DE LAS LÍNEAS OPERATIVAS (THRESHOLDS) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION), LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX) ASÍ COMO LOS CONTRATOS QUE CUENTAN CON PRENDA BURSÁTIL.

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "311". <sup>1</sup>
2	Contraparte		N	8	0	4	11	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
5	Tipo de Neteo		N	1	0	34	34	Se deberá anotar el tipo de neteo de derivados establecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para el cómputo de consumo de las líneas operativas (threshold) según el catálogo de "Tipo de Neteo"
6	Threshold establecido por la Contraparte		N	9	0	35	43	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como línea operativa o margen operativo para la SIEFORE. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
11	Liquidación en Pesos		N	1	0	58	58	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en pesos. En otro caso reportar 0.
12	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas		N	1	0	59	59	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo I de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
15	Número de contrato		AN	30	0	62	91	Se deberá reportar el número de contrato marco.
16	Observaciones		AN	647	0	92	738	En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo "Tipo de Neteo", se deberán reportar 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. <sup>6</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V.
002	534	001	SIEFORE Básica Uno	Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001	SIEFORE Básica Uno	Principal Siefore 1, S.A. de C.V.
002	544	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V.
002	550	001	SIEFORE Básica Uno	Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V.
002	552	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V.
002	556	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V.
002	562	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore Invercap, S. A. de C. V.
002	564	001	SIEFORE Básica Uno	Met1 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	001	SIEFORE Básica Uno	Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V.
002	578	001	SIEFORE Básica Uno	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.
002	530	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V.
002	534	002	SIEFORE Básica Dos	Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore
002	538	002	SIEFORE Básica Dos	Principal Siefore 2, S.A. de C.V.
002	544	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V.
002	550	002	SIEFORE Básica Dos	Inbursa Siefore, S.A. de C.V.
002	552	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V.
002	556	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore Azteca, S.A. de C.V.
002	562	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore Invercap II, S. A. de C. V.
002	564	002	SIEFORE Básica Dos	Met2 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	002	SIEFORE Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	SIEFORE Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	SIEFORE Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	SIEFORE Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	SIEFORE Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	SIEFORE Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	SIEFORE Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	SIEFORE Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	SIEFORE Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	SIEFORE Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	SIEFORE Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	SIEFORE Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	SIEFORE Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	SIEFORE Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	SIEFORE Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	SIEFORE Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	SIEFORE Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen Japonés
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi Chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

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

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

Catálogo de Estatus de Operación	
Identificador	Descripción
1	Posición Abierta.
7	Se ejerce la opción (Este estatus se empleará únicamente en la fecha de ejercicio de la opción)
8	Se utiliza el layout de detalle (Estatus para indicar que el instrumento cuenta con un calendario de cupones). En las fechas que no exista detalle, a reportar, de cupones se empleará el Estatus de Operación 1

Catálogo de Tipos de Tasa		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Tasa Fija	TF
2	Tasa Variable al Inicio del Cupón	TVI
3	Tasa Variable al Final del Cupón	TVF
4	Tasa Variable Promedio	TVP
5	Tasa Capitalizable Simple	TCS
6	Tasa Capitalizable Compuesta	TCC
100	Otros	OTR

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>						
AAA (mex)	Aaa.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	Aa1.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	Aa2.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	Aa3.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	Ba2.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	Ba3.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B1.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B2.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014

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

Catálogo de Tipo de Garantía	
Identificador	Descripción
1	Garantía otorgada por la SIEFORE 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	080029	Portfolio Investment Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013006	HSBC Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080034	Banorte I, LLC.
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080037	Invex International, S.A.
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080038	Invex Worldwide, S.A.
013012	Finamex Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013013	IXE Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013018	Casa de Bolsa Arka	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013019	Value Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013020	Actinver Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013021	Monex Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013026	Vector Casa de Bolsa	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013027	Casa de Bolsa Banorte	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013041	Invex Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082037	Crema Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013120	UBS Casa de Bolsa	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
013124	Intercam Casa de Bolsa	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
013125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082049	Bancomer Sucursal en Houston
013126	BullTick Casa de Bolsa	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	700000	Otros Bancos Extranjeros
013129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
013130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701001	Abasis
013131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701002	American Express (Extranjero)

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016041	Casa de Cambio Tiber	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016044	Eurofimex, Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016067	Masari, Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
016408	B y B Casa de Cambio	701010	Bank One (Extranjero)
016419	Finamex Casa de Cambio	701011	BNP Paribas (Extranjero)
016507	Casa de Cambio Tamibe	701012	Barclays Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701013	Bear Stearns (Extranjero)
016587	Sterling Casa de Cambio	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701016	Citi National Bank (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701017	Citibank (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701018	Comerica Bank (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701019	Commerzbank (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701020	Controladora Prosa
016719	Unica Casa de Cambio	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701022	Credit Suisse (Extranjero)
025002	S.D. Ineval, Institución para el Depósito de Valores	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701026	Fortis Bank (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
037135	Nacional Financiera	701030	Indosuez International (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701031	ING Bank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040002	Banco Nacional de México	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040014	Banco Santander	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040021	HSBC México	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701041	Societe Generale (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040037	Banco Interacciones	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040059	Banco Invex	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040060	Bansi	701048	Union Bank (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040103	American Express Bank (México)	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040106	Bank of America México	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040110	Banco J.P. Morgan	701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
040112	Banco Monex	701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
040113	Banco Ve por Más	701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
040116	ING Bank (México)	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040128	Banco Autofin México	701276	Chicago Board of Trade
040129	Barclays Bank México	701277	Credit Agricole Corp
040130	Banco Compartamos	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040131	Banco Ahorro Famsa	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040132	Banco Multiva	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040133	Banco Actinver	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	801153	Pershing Inc.
040136	Banco Regional	801154	Calyon Financial Inc.
040137	BanCoppel	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
040138	Banco Amigo	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
040139	UBS Bank México	801157	Segregación de Instrumentos
040140	Banco Fácil	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
040141	Volkswagen Bank	801159	Reclasificaciones
040142	El Banco Deuno	801160	Acciones Propias
040143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple	801161	Cortes Transversales
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801162	Bank West
040145	Banco Base	801163	Bcpbank Canada
046048	Citibank (Banamex USA)	801164	Bridgewater Bank
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076000	Otros Operadores	801166	Canadian Tire Bank
076001	Derfin	801167	Canadian Western Bank
076008	Stock & Price	801168	Citizens Bank Of Canada
076010	Scotia Inverlat Derivados	801169	Cs Alterna Bank
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados	801170	Dundee Bank Of Canada
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801171	First Nations Bank Of Canada
076022	Darka	801172	General Bank Of Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801173	Laurentian Bank Of Canada
076043	Timber Hill LLC.	801174	Manulife Bank Of Canada
076044	Enlace Derivados	801175	National Bank Of Greece (Canada)
076048	Intercam Derivados	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.

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

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

#### **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

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

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

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

#### **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

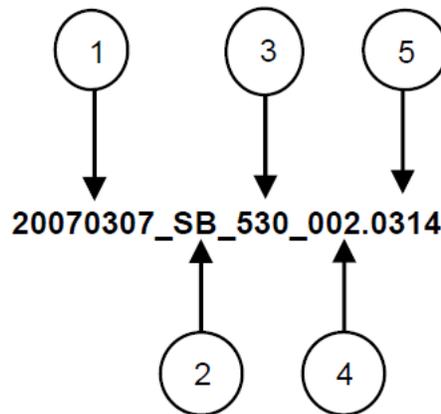
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con éste.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las SIEFOREs Básicas, SIEFOREs de Aportaciones Voluntarias, SIEFOREs de Aportaciones Complementarias y SIEFOREs de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

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

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

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



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

**20070307\_SB\_530\_002.0314.gpg**

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

**A20070307\_SB\_530\_002.0314**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

## Anexo 78

		COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO	
		<b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b> 0300 <b>FUENTE:</b> SIEFORES	<b>PROCESO:</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACION:</b>

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

## ENCABEZADO

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

## DETALLE(S)

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>15</sup>

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
9	Plazo Total de la Operación de Reporto		N	6	0	60	65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Reporto. <sup>1</sup>
10	Plazo Actual del Reporto		N	6	0	66	71	El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. <sup>1</sup>
11	Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto		N	12	0	72	83	Número de títulos de los valores recibidos como colateral de la operación en Reporto (unidades). <sup>1</sup>
12	Costo total de adquisición del Reporto		N	14	2	84	99	Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. <sup>2</sup>
13	Tasa Premio		N	3	3	100	105	Tasa Premio pactada del Reporto. <sup>2</sup>
14	Precio Pactado		N	9	6	106	120	Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. <sup>2</sup>
15	Importe pactado de cada operación		N	14	2	121	136	El valor total de la operación en Reporto al vencimiento, equivalente al costo total de adquisición más el premio pactado. <sup>2</sup>
16	Premio devengado		N	14	2	137	152	Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Valor razonable		N	14	2	153	168	Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
18	Tipo de garantía pactada		N	2	0	169	170	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores <sup>1</sup>
19	Tasa de mercado		N	3	3	171	176	Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	177	178	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	179	180	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Tipo de cambio pactado		N	9	6	181	195	Tipo de cambio pactado <sup>2</sup> , en el reporte para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. <sup>9</sup>
23	Contraparte		N	6	0	196	201	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
24	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. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
30	Espacios en blanco		AN	96	0	248	343	Vacios. <sup>6</sup>

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". <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. <sup>1</sup>
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, en el caso de llamadas de capital también se deberán reportar con tipo de inversión 0 y como una operación de compra, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 12 para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones tercerizadas, 16 para operaciones cambiarias de compra o venta de divisas. Para las operaciones cambiarias se deberán reportar la operación de compra de la divisa recibida y la operación venta de la divisa entregada. <sup>1</sup>
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. <sup>1</sup>
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIVO. <sup>5</sup>
11	Serie		AN	7	0	52	58	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la 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. <sup>15</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59	68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros. <sup>15</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación. <sup>3</sup>

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77	88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
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". <sup>2</sup>
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135	140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	147	148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. <sup>1</sup>
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio <sup>9</sup> promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13: <ul style="list-style-type: none"> <li>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</li> <li>En caso de flujos por dividendos o pagos de cupón se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes.</li> </ul> En caso de llamadas de capital se deberá reportar el identificador "025002". En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
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. <sup>10</sup>
26	Banco de Trabajo		N	1	0	196	196	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
28	Sistema de concertación		N	2	0	198	199	En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – MEIPresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
33	Espacios en blanco		AN	119	0	225	343	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "303"</b> <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 7 para Garantías entregadas por operaciones con Instrumentos Financieros Derivados, 11 para el Inst. de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados, 14 para Inversiones Tercerizadas 15 para Garantías entregadas por operaciones con instrumentos estructurados. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>

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. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. <sup>5</sup>
9	Serie		AN	7	0	47	53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la 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 Ineval. <sup>15</sup>
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. <sup>15</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
12	Costo promedio unitario en pesos de Adquisición		N	9	6	76	90	En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
13	Costo Total de Adquisición		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". <sup>2</sup>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a 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". <sup>2</sup>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
18	País de origen		N	2	0	160	161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario. <sup>1</sup>
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172	175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
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, vehículos, Fibras o CKD, de lo contrario llenar con ceros. <sup>1</sup>
28	Fecha en que se decreta el derecho o modificación accionaria		F	8	0	192	199	Si se ha decretado algún tipo de derecho o modificación accionaria a la fecha del reporte que no haya sido liquidado/ejercido, se deberá anotar la fecha en que se decretó. Solamente en el caso de acciones o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. <sup>3</sup>
29	Proporción de la modificación accionaria		N	6	6	200	211	En caso de reportarse algún Tipo de derecho o modificación accionaria en el Id 27, indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones o vehículos (reportar el factor que se multiplica por cada título: #Títulos nuevos / #Títulos anteriores). <sup>2</sup>
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". <sup>1</sup>

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
31	Monto del Derecho		N	14	2	213	228	Si el tipo de derecho decretado es pago en efectivo se deberá anotar el monto decretado de pago por unidad accionaria o por título del vehículo. <sup>2</sup>
32	Valor Nominal Actualizado		N	14	6	229	248	Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos), Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen). En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
33	Títulos en circulación		N	14	0	249	262	Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
34	Valor Nominal Inicial		N	14	6	263	282	Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0 (Denominado en moneda de origen). En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
35	Títulos en Circulación Inicial		N	14	0	283	296	Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
36	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	297	310	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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. <sup>1</sup>
37	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	311	313	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercealizada. <sup>1</sup>
38	Aviso de Recomposición		N	1	0	314	314	Se deberá anotar el identificador con forme al catálogo de Aviso de Recomposición. <sup>1</sup>
39	Índice de Mandato		N	3	8	315	325	Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberá reportar el índice del mandato (truncado a 8 decimales) construido con base 1, afectado por la rentabilidad en pesos diaria del Mandato. En otro caso llenar con ceros. <sup>2</sup>
40	Observaciones		AN	18	0	326	343	Si el tipo de derecho o modificación accionaria es "8" se deberá especificar el nombre anterior de la emisora. Si el tipo de derecho o modificación accionaria es "10" se deberá especificar el instrumento anterior utilizando el formato de Tipo Valor, Emisora y Serie respetando la longitud de dichos indicadores de 4, 7 y 7 respectivamente, los espacios en blanco deberán de ir a la izquierda dejando en blanco los que no se ocupen y sin espacios intermedios <sup>5</sup> .

DETALLE 4: DETERMINACION DEL PRECIO DE LA ACCION Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	Capital Contable (Activo Total de la Sociedad de Inversión)		N	14	2	4	19	Es el capital contable, la suma del Activo Administrado por una Sociedad de Inversión y de los Activos Administrados por los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
3	Activo Administrado por la Sociedad de Inversión		N	14	2	20	35	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión directamente gestionado en materia de inversiones por ésta, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>

DETALLE 4: DETERMINACION DEL PRECIO DE LA ACCION Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
4	Activo Administrado por los Mandatarios		N	14	2	36	51	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión que se encuentre bajo la gestión financiera de los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
5	Acciones en circulación finales		N	12	0	52	63	Es la cantidad de acciones en circulación en día que se está reportando. <sup>1</sup>
6	Precio de la acción		N	9	6	64	78	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales <sup>2</sup>
7	Espacios en blanco		AN	265	0	79	343	Vacios. <sup>6</sup>

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
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 8 para Garantías recibidas por operaciones de Reporto, 10 para Garantías recibidas por Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
9	Serie		AN	7	0	47	53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Ineval. <sup>15</sup>
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>15</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). <sup>1</sup>
12	Costo unitario original en pesos		N	9	6	76	90	En este campo se debe poner el costo unitario original al que se recibió. <sup>2</sup>
13	Costo Total Original		N	14	2	91	106	Se debe poner el costo total original al que se recibió la posición en garantía. Este valor debe ser igual al costo unitario original por el número de títulos. <sup>2</sup>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. <sup>2</sup>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión. <sup>1</sup>
18	País de origen		N	2	0	160	161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>

<b>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</b>								
<b>Id</b>	<b>Concepto</b>	<b>Dato</b>	<b>Tipo</b>	<b>Longitud</b>		<b>Posición</b>		<b>Observaciones</b>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172	175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
27	Contraparte		N	6	0	190	195	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes <sup>1</sup> .
28	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. <sup>5</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup> .
34	Espacios en blanco		AN	102	0	242	343	Vacios <sup>6</sup> .

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

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
27	Folio de operación		N	12	0	214	225	Se deberá anotar un folio único por cada operación de préstamo de valores definido por la Siefore, el cual está asociado al folio de garantía de la operación. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Garantías recibidas por concepto de operaciones en reporto, prestamos de valores y derivados que no forman parte del activo total de la sociedad de inversión). <sup>1</sup>
28	Espacios en blanco		AN	118	0	226	343	Vacios <sup>6</sup> .

**DETALLE 7: ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307". <sup>1</sup>
2	Tipo de inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión. <sup>1</sup>
3	Tipo de valor		AN	4	0	6	9	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado. En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el tipo de valor asignado por el proveedor a la divisa del flujo, o EF si se encuentra denominado en pesos. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7	0	10	16	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado. En caso de ser Inversiones tercerizadas deberá ser definido por la SIEFORE para cada mandatario. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la emisora asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o EFECTIV si se encuentra denominado en pesos. <sup>5</sup>

**DETALLE 7:** ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
5	Serie		AN	7	0	17	23	<p>Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado.</p> <p>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.</p> <p>En caso de ser Inversiones tercerizadas será un consecutivo definido por la SIEFORE el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario.</p> <p>Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la serie asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o 990101 si se encuentra denominado en pesos.<sup>15</sup></p>
6	Consecutivo		AN	10	0	24	33	<p>Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. Para el caso de Inversiones tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión tercerizada.<sup>15</sup></p>
7	ISIN		AN	12	0	34	45	<p>Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.</p> <p>En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0.<sup>12</sup></p>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	46	54	<p>Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.</p> <p>En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0.<sup>13</sup></p>
9	SEDOL		AN	7	0	55	61	<p>Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo.</p> <p>En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0.<sup>14</sup></p>
10	Tipo de flujo		N	2	0	62	63	<p>Se deberá reportar el tipo de flujo según el Catálogo de Tipos de Flujo.</p> <p>Para el caso de los flujos por dividendos y distribuciones de efectivo estos deberán ser reportados en la fecha exderecho.</p> <p>Aquí se deberán reportar las comisiones de cualquier tipo (comisiones sobre saldo, las comisiones Mexder, la tasa PAI, las comisiones de los Brókers, etc) y se deberá especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" del presente detalle el tipo de comisión.<sup>1</sup></p>
11	Descriptivo de tipo de flujo		AN	30	0	64	93	<p>En caso de utilizar el identificador "99 - Otros flujos" en el campo "Tipo de flujo", se deberá registrar un nombre descriptivo del tipo de flujo que se está reportando.<sup>5</sup></p>
12	Contraparte flujo		N	6	0	94	99	<p>Se deberá anotar el identificador de la Contraparte liquidadora de conformidad con el Catálogo de Contrapartes.<sup>1</sup></p>
13	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	100	119	<p>Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte liquidadora limitado a 20 caracteres cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes.</p> <p>En otro caso se deberá reportar vacío.<sup>5</sup></p>

**DETALLE 7:** ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
14	Fecha de liquidación		F	8	0	120	127	Se deberá reportar la fecha de liquidación del flujo. <sup>3</sup>
15	Títulos o unidades		N	12	0	128	139	Se deberá reportar el número de títulos o unidades del Activo Objeto de Inversión de los cuales se deriva el flujo reportado. Para el caso de swaps se deberá reportar el monto notional utilizado para valuar la posición con el precio otorgado por el proveedor de precios. Para el caso de operaciones con derivados se deberá reportar el producto de número de contratos por tamaño de contratos. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el número de divisas o pesos de los cuales se deriva el flujo reportado. <sup>1</sup>
16	Divisa		N	2	0	140	141	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se encuentra denominado el flujo reportado. <sup>1</sup>
17	Divisa de liquidación		N	2	0	142	143	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se liquidará el flujo reportado. <sup>1</sup>
18	Tipo de cambio aplicado		N	9	6	144	158	Se deberá anotar el tipo de cambio aplicado para valuar en pesos mexicanos el flujo denominado en divisas, o 1 si el flujo está denominado en pesos mexicanos. <sup>2</sup>
19	Dirección del flujo		N	1	0	159	159	Se deberá reportar un 1 si se trata de un flujo de entrada a la cartera de la SIEFORE. Se deberá reportar un 2 si se trata de un flujo de salida a la cartera de la SIEFORE. <sup>1</sup>
20	Monto de flujo en Divisa		N	14	2	160	175	Monto total del flujo expresado en la divisa en la que se encuentra denominado. <sup>2</sup>
21	Monto de flujo en pesos mexicanos		N	14	2	176	191	Monto total del flujo expresado en pesos mexicanos. <sup>6</sup>
22	Espacios en blanco		AN	152	0	192	343	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 8:** DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "308"</b> . <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>5</sup>

DETALLE 8: DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
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". <sup>1</sup>
5	Monto en divisa		N	12	2	32	45	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de liquidación. <sup>2</sup>
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. <sup>2</sup>
7	Tipo de Depósito		N	1	0	60	60	Se deberá anotar el tipo de depósito según el catálogo de tipo de depósito. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
12	Espacios vacíos		AN	269	0	75	343	Vacios. <sup>6</sup>

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

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". <sup>1</sup>
2	Identificador Mandato		AN	4	0	4	7	Se indicará el valor constante MDT. <sup>5</sup>
3	Identificador Mandatario		AN	7	0	8	14	Deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Emisora reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. <sup>5</sup>

DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
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. <sup>5</sup>
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.
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
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. <sup>1</sup>
15	Espacios vacíos		AN	174	0	170	343	Vacios. <sup>6</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V.
017	652	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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 Tipos de flujo	
Identificador	Descripción
01	Flujo por pago de cupón
02	Flujo por amortización parcial o total
03	Flujo por dividendos (reportado en fecha exderecho)
04	Flujo por distribuciones de efectivo (reportado en fecha exderecho)
05	Flujo por pago de cupones en swaps
06	Flujo por liquidación diaria de derivados listados
07	Flujo por pago de intereses sobre depósitos en efectivo y por AIMS excedentes
08	Flujo por comisiones (Especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" la descripción del tipo de comisión.)
09	Liquidación de Comisiones sobre saldo
99	Otros flujos

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen Japonés
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño

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 Divisa		
Id	Clave	Descripción
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi Chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

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

Catálogo de Sistema de Concertación	
Identificador	Descripción
0	No aplica
1	MEI
2	SIPO
3	VAR
4	MEIPresval
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 Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>						
AAA (mex)	Aaa.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	Aa1.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	Aa2.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	Aa3.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010

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

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

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

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080029	Portfolio Investment Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013006	HSBC Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080034	Banorte I, LLC.
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080037	Invex International, S.A.
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080038	Invex Worldwide, S.A.
013012	Finamex Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013013	IXE Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013018	Casa de Bolsa Arka	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013019	Value Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013020	Actinver Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013021	Monex Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013026	Vector Casa de Bolsa	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013027	Casa de Bolsa Banorte	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013041	Invex Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013120	UBS Casa de Bolsa	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
013124	Intercam Casa de Bolsa	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
013125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082049	Bancomer Sucursal en Houston
013126	BullTick Casa de Bolsa	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	700000	Otros Bancos Extranjeros
013129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
013130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701001	Abasis
013131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701002	American Express (Extranjero)
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016041	Casa de Cambio Tiber	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016044	Eurofimex, Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016067	Masari, Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
016408	B y B Casa de Cambio	701010	Bank One (Extranjero)
016419	Finamex Casa de Cambio	701011	BNP Paribas (Extranjero)
016507	Casa de Cambio Tamibe	701012	Barclays Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701013	Bear Stearns (Extranjero)
016587	Sterling Casa de Cambio	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701016	Citi National Bank (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701017	Citibank (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701018	Comerica Bank (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701019	Commerzbank (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701020	Controladora Prosa
016719	Unica Casa de Cambio	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701022	Credit Suisse (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701026	Fortis Bank (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
037135	Nacional Financiera	701030	Indosuez International (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701031	ING Bank (Extranjero)

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040002	Banco Nacional de México	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040014	Banco Santander	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040021	HSBC México	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701041	Societe Generale (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040037	Banco Interacciones	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040059	Banco Invex	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040060	Bansi	701048	Union Bank (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040103	American Express Bank (México)	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040106	Bank of America México	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040110	Banco J.P. Morgan	701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
040112	Banco Monex	701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
040113	Banco Ve por Más	701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
040116	ING Bank (México)	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040128	Banco Autofin México	701276	Chicago Board of Trade
040129	Barclays Bank México	701277	Credit Agricole Corp
040130	Banco Compartamos	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040131	Banco Ahorro Famsa	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040132	Banco Multiva	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040133	Banco Actinver	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	801153	Pershing Inc.
040136	Banco Regional	801154	Calyon Financial Inc.
040137	BanCoppel	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
040138	Banco Amigo	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
040139	UBS Bank México	801157	Segregación de Instrumentos
040140	Banco Fácil	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
040141	Volkswagen Bank	801159	Reclasificaciones
040142	El Banco Deuno	801160	Acciones Propias
040143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple	801161	Cortes Transversales
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801162	Bank West
040145	Banco Base	801163	Bcpbank Canada

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
046048	Citibank (Banamex USA)	801164	Bridgewater Bank
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076000	Otros Operadores	801166	Canadian Tire Bank
076001	Derfin	801167	Canadian Western Bank
076008	Stock & Price	801168	Citizens Bank Of Canada
076010	Scotia Inverlat Derivados	801169	Cs Alterna Bank
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMA A Derivados	801170	Dundee Bank Of Canada
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801171	First Nations Bank Of Canada
076022	Darka	801172	General Bank Of Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801173	Laurentian Bank Of Canada
076043	Timber Hill LLC.	801174	Manulife Bank Of Canada
076044	Enlace Derivados	801175	National Bank Of Greece (Canada)
076048	Intercam Derivados	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801179	Us Bank N.A.
079005	InterMex Holding, S.A.- Luxemburgo	801180	Suntrust Bank
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.- Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079010	California Commerce Bank-California, E.U.A.	801183	Regions Bank
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801184	National City Bank
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801185	Branch Bkg & TC
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801186	State Street B&TC
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801187	Countrywide Bank N.A.
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801188	Pnc Bank N.A.
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801189	Keybank N.A.
079018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán	801190	Lasalle Bank N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801191	North Fork Bank
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801192	Manufacturers & Traders Tc
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801193	Bank Of The West
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801194	Fifth Third Bank
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801195	Northern TC
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801196	Goldman Sachs Paris
079028	BBVA Bancomer USA	801197	Citigroup Global Markets, INC
079029	Dinero Express	801198	Jefferies Group, LLC
079030	Banorte USA Corporation	801199	UBS Securities, LLC
079031	INB Financial Corp.	801200	Evercore, LLC
079032	INB Delaware Corporation	801201	GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney)
079033	Inter Nacional Bank	801202	Santander USA
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801203	CME Clearing

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
080001	Acci Securities Incorporated	801204	Barclays Capital, Inc
080004	Afin Securities International Limited	801205	BCP Securities, LLC
080005	Arka Securities Incorporated	801206	BTG Pactual US Capital, LLC
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801207	Bulltick, LLC
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	801208	Santander Investment Securities, Inc
080013	Vectormex Incorporated	801209	Scotia Capital, Inc
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated	900000	Otros mandatarios
080015	Vectormex International Incorporated	900001	Schroders Plc.
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.	900002	Blackrock Inc.
080020	Valores Finamex International Incorporated	900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
080021	Finamex Securities Incorporated	900004	Pioneer Investment Management Ltd.
080022	Valores Finamex Limited	900005	Nomura Holdings, Inc.
080023	Interacciones Global Incorporated	900006	Pioneer Investments Global Asset Management
080024	Inter-Financial Services, Limited	900007	Wellington Management Company LLP
080025	Monex Securities Incorporated	900008	Investec Asset Management
080026	Invex Incorporated	910000	Otras Bolsas de Derivados
080027	GBM International Incorporated	920000	Otros Socios Operadores
080028	Foreign Holdings Ltd.	930000	Otros Socios Liquidadores
		940000	Otras Cámaras de Compensación

Catálogo de Aviso de Recomposición	
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).
5	Depósitos en garantía por derivados OTC

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

HH = hora

MM = min

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

<sup>14</sup> SEDOL o “Stock Exchange Daily Official List” es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

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

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:
  - 1° ISIN, de no existir éste,
  - 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,
  - 3° SEDOL.

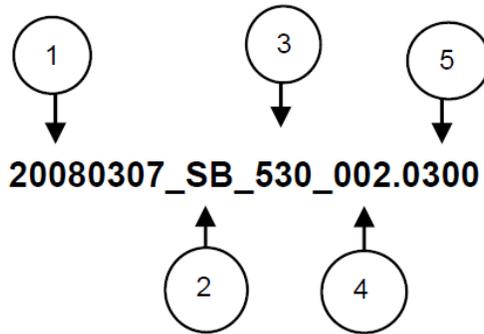
Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores, salvo en instrumentos provenientes de operaciones primarias, pendientes de liquidar, en donde estos identificadores aún no sean asignados y por tanto no existan.

- VI. En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las indicaciones de cada campo; de lo contrario se anotará un CERO y espacios en blanco.
- VII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- VIII. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

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

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_002.0300.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_002.0300**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

## Anexo 79

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

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

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000" <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0317". <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
5	Subtipo de Entidad		N	3	0	14	16	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Fecha de Información		F	8	0	17	24	Fecha de la Operación que se reporta. <sup>3</sup>
7	Tamaño del Registro		N	3	0	25	27	Número de caracteres por registro = Constante "212". <sup>1</sup>
8	Número de Registros		N	5	0	28	32	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
9	Espacios en blanco		AN	180	0	33	212	Vacios. <sup>6</sup>

## SUBENCABEZADO

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

<b>SUBENCABEZADO 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS ESTRUCTURAS VINCULADAS A SUBYACENTES E ÍNDICES REPLICADOS</b>								
<b>Id</b>	<b>Concepto</b>	<b>Dato</b>	<b>Tipo</b>	<b>Longitud</b>		<b>Posición</b>		<b>Observaciones</b>
4	Fecha de inicio de la Operación		F	8	0	13	20	Se deberá anotar la fecha de inicio de la operación de la estructura vinculada a subyacentes o réplica del índice. <sup>3</sup>
5	Cantidad de Instrumentos.		N	2	0	21	22	Se deberá anotar el número de los distintos Activos Objeto de Inversión que componen la estructura vinculada a subyacentes o réplica del Índice y que se encuentran registrados en los Detalles 2 a 6 del presente Subencabezado. <sup>1</sup>
6	Tipo de Estructuración		N	1	0	23	23	Se anotará el identificador según el catálogo de Tipo de Estructura, donde se anotará 1 si la estructura vinculada a subyacentes fue adquirida en Directo en el Mercado por la Siefore, o 2 si la Nota está estructurada por la Siefore mediante la administración de sus componentes. <sup>6</sup> Para el caso de la réplica de índices que sean replicados siempre utilizará el 2.
7	Descripción		AN	100	0	24	123	Se deberá anotar una breve descripción del tipo de estructura vinculada a subyacentes o réplica que se esté realizando.
8	Espacios en blanco		AN	89	0	124	212	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE(S)**

<b>DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS estructuras vinculadas a subyacentes EN CASO DE SER NOTAS ADQUIRIDAS EN DIRECTO POR LA SIEFORE. (Para reportar este detalle, el tipo de estructuración del subencabezado deberá ser igual a 1)</b>								
<b>Id</b>	<b>Concepto</b>	<b>Dato</b>	<b>Tipo</b>	<b>Longitud</b>		<b>Posición</b>		<b>Observaciones</b>
				<b>Ent.</b>	<b>Dec.</b>	<b>De:</b>	<b>A:</b>	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL la estructura vinculada a subyacentes. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie de la estructura vinculada a subyacentes. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de indeval. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
9	Fecha de colocación de la Nota Estructurada.		F	8	0	60	67	Se deberá anotar la fecha de colocación de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>3</sup>
10	Fecha de vencimiento		F	8	0	68	75	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>3</sup>
11	Valor Nominal		N	14	2	76	91	Se deberá anotar el Valor Nominal, en la divisa de cotización, de la estructura vinculada a subyacentes en directo (Principal Protegido a Vencimiento). <sup>2</sup>
12	Número de Títulos		N	12	0	92	103	Se deberá anotar el número de títulos de la estructura vinculada a subyacentes adquiridos por la Siefore. <sup>1</sup>
13	Divisa de la Nota Estructurada		N	2	0	104	105	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización de la estructura vinculada a subyacentes según el catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Observaciones		AN	107	0	106	212	Observaciones de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>

**DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA INSTRUMENTO DE DEUDA O VALOR EXTRANJERO DE DEUDA AL QUE SE VINCULA LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES DEL SUBENCAJEZADO 1.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de indeval. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda. <sup>5</sup>
9	Número de Títulos		N	12	0	60	71	Cantidad de Títulos del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que componen la estructura vinculada a subyacentes. <sup>1</sup>
10	Fecha de Vencimiento		F	8	0	72	79	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la estructura vinculada a subyacentes. <sup>3</sup>
11	Tasa de Rendimiento		N	2	4	80	85	Se deberá anotar la tasa de rendimiento ligada al cupón que garantiza la protección del principal al vencimiento, correspondiente al día en que se inició la estructuración de la estructura vinculada a subyacentes. <sup>2</sup>
12	Divisa		N	2	0	86	87	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Instrumento de Deuda o Valor Extranjero de Deuda que estructura la estructura vinculada a subyacentes. <sup>1</sup>
13	Espacios en blanco		AN	125	0	88	212	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 3:** CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNA DE LAS DIFERENTES ACCIONES ADQUIRIDAS EN DIRECTO PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "303"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN Acción		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Acción		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>13</sup>
4	SEDOL Acción		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Acción		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
6	Emisora Acción		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>

**DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNA DE LAS DIFERENTES ACCIONES ADQUIRIDAS EN DIRECTO PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
7	Serie Acción		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
8	Consecutivo Acción		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo de la acción utilizada para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
9	Número de Acciones		N	12	0	60	71	Número de Acciones que componen la Nota a la fecha del reporte. <sup>1</sup>
10	Divisa		N	2	0	72	73	Se anotará el identificador de la Divisa en la cual está cotizada la acción, según el catálogo de Divisas. <sup>2</sup>
11	Índice o Subíndice		AN	18	0	74	91	En caso de que la posición en acciones se use para la replicación de algún Índice o Subíndice, este campo estará conformado por el Tipo de Valor, Emisora y Serie del Índice o Subíndice, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. En otro caso, el campo debe ir vacío. <sup>5</sup>
12	Espacios en blanco		AN	121	0	92	212	Vacíos. <sup>6</sup>

**DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES DERIVADOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	ISIN Derivado		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Derivado		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL Derivado		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Instrumento Derivado utilizado para conformar la Nota, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Derivado		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
6	Emisora Derivado		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
7	Serie Derivado		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de indeval. <sup>5</sup>
8	Consecutivo Derivado		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Instrumento Derivado utilizado para conformar la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
9	Fecha de vencimiento		F	8	0	60	67	Se deberá anotar la fecha en que teóricamente vence el Instrumento Derivado. <sup>3</sup>
10	Fecha de liquidación		F	8	0	68	75	Se deberá anotar la fecha en la que se liquida o se intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
11	Tamaño del contrato		N	14	2	76	91	Se deberá anotar el tamaño del contrato o Monto Ncional pactado en valor absoluto en la Divisa pactada. En caso de ser un Swap, se deberá anotar el Monto Ncional de los flujos a entregar en la divisa pactada. <sup>2</sup>

**DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES DERIVADOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES**

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

**DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHICULOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	ISIN Vehículo		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP o CINS Vehículo		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL Vehículo		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes, proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor Vehículo		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
6	Emisora Vehículo		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes. <sup>5</sup>
7	Serie Vehículo		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Vehículo que conforma la estructura vinculada a subyacentes. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de indeval. <sup>5</sup>

**DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACION DE CADA UNO DE LOS DIFERENTES VEHICULOS UTILIZADOS PARA CONFORMAR LA ESTRUCTURA VINCULADA A SUBYACENTES.**

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

**DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION UTILIZADA PARA LA RÉPLICA DE ÍNDICES.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "307"</b> .
2	Tipo de Valor Índice		AN	7	0	4	10	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del índice que se está replicando
3	Emisora Índice		AN	4	0	11	14	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del índice que se está replicando.
4	Serie Índice		AN	7	0	15	21	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del índice que se está replicando
5	ISIN Componente		AN	12	0	22	33	Se deberá anotar la clave del ISIN del componente utilizado para conformar el índice.
6	CUSIP o CINS Componente		AN	9	0	34	42	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS del componente utilizado para conformar el índice.
7	SEDOL Componente		AN	7	0	43	49	Se deberá anotar la clave del SEDOL del componente utilizado para conformar el índice.
8	Tipo de Valor Componente		AN	4	0	50	53	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del componente utilizado para conformar el índice.
9	Emisora Componente		AN	7	0	54	60	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del componente utilizado para conformar el índice.
10	Serie Componente		AN	7	0	61	67	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del componente utilizado para conformar el índice.
11	Consecutivo Componente		AN	10	0	68	77	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del componente utilizado para conformar el índice.
12	Número de Unidades		N	12	0	78	89	Número de Acciones, Títulos o Subyacentes (número de contratos por tamaño de contratos) del componente con el que se está realizando la réplica a la fecha del reporte.
13	Valor a Mercado Unitario		N	12	4	90	105	En este campo se deberá reportar el valor unitario a mercado de las acciones, instrumentos o subyacentes del componente en pesos mexicanos.
14	Valor a Mercado Total			12	4	106	121	En este campo se deberá reportar el valor total a mercado de la posición en pesos mexicanos.
15	Monto expuesto		N	12	4	122	137	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos.
16	Peso específico del Instrumento en la réplica.		N	3	6	138	146	Se deberá anotar el peso específico, en puntos porcentuales, del componente en la réplica realizada. Las posiciones enteras son puntos porcentuales y las decimales fracciones de puntos porcentuales.
17	Ponderador del instrumentos en el índice.		N	3	6	147	155	Se deberá anotar el ponderador, en puntos porcentuales, de este componente en el índice que se está replicando. Las posiciones enteras son puntos porcentuales y las decimales fracciones de puntos porcentuales.
18	Descripción del componente		AN	50	0	156	205	Se deberá anotar una breve descripción de la entidad que emite el componente o bien el subyacente de este.
19	Espacios en blanco		AN	7	0	206	212	Vacios.

## CATÁLOGO(S)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Estatus del Registro	
Identificador	Descripción
1	Alta
4	Constante

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen Japonés
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca

(Continúa en la Tercera Sección)

## TERCERA SECCION

### SECRETARIA DE HACIENDA Y CREDITO PUBLICO

(Viene de la Segunda Sección)

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi Chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

**POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

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

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

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las observaciones de cada campo.

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO****Políticas a seguir en la transmisión de la información**

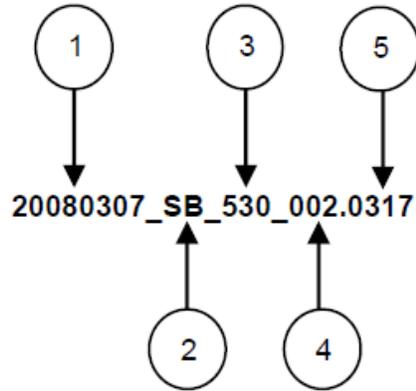
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefors Básicas, Siefors de Aportaciones Voluntarias, Siefors de Aportaciones Complementarias y Siefors de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefors Básicas, Siefors de Aportaciones Voluntarias, Siefors de Aportaciones Complementarias y Siefors de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0317"</b> .

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_002.0317.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_002.0317**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

...

Anexo 80

 <p><b>CONSAR</b> Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro FSCD-DGI-02</p>	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro
<h2 style="margin: 0;">Solicitud de</h2> <h1 style="margin: 0;">Altas, Bajas y/o Cambios de Nodo Connect:Direct</h1>	

- Esta solicitud aplicará solo para aquellas Entidades que están obligadas a transmitir a esta Comisión su información a través de la red privada por medio del software Connect Direct o cualquier otro compatible con este.
- La presente solicitud tendrá que ser llenada en su totalidad por parte de las Entidades relacionadas con el SAR en los espacios designados para tal fin, no se recibirán aquellas que vengan llenadas a mano.
- La presente solicitud deberá enviarse a la Dirección de Informática de la CONSAR.
- Si después de 5 días hábiles posteriores a su recepción, no recibe la Entidad respuesta de la Dirección de Informática de la CONSAR, por favor comunicarse al teléfono (55) 3000-2561, para su seguimiento.

<b>DATOS DE LA ENTIDAD SOLICITANTE</b>	
POR FAVOR ESCRIBA SUS RESPUESTAS A MAQUINA O CON LETRA DE IMPRENTA EN LOS ESPACIOS EN BLANCO DEBAJO DE CADA PUNTO	
1.- TIPO DE ENTIDAD (Marcar con una X)	
<input type="checkbox"/> AFORE <input type="checkbox"/> SIEFORE <input type="checkbox"/> ICEFA <input type="checkbox"/> EMPRESA OPERADORA <input type="checkbox"/> CUSTODIO DE VALORES <input type="checkbox"/> OTRA	
¿CUAL?	
2.- RAZON SOCIAL DE LA ENTIDAD	3.- CLAVE DE LA ENTIDAD ASIGNADA POR CONSAR
4.- DIRECCION DE LA ENTIDAD (Calle, Número, CP, Colonia y Delegación)	

<b>DATOS DEL USUARIO SOLICITANTE</b>		
5.- NOMBRE(S)	6.- APELLIDO PATERNO	7.- APELLIDO MATERNO
8.- PUESTO QUE DESEMPEÑA	9.- CORREO ELECTRONICO (Institucional)	10.- TELEFONO / EXT.
11.- IDENTIFICARSE CON: (Anexar copia a la solicitud, marcar con una X)		
<input type="checkbox"/> CREDENCIAL PARA VOTAR <input type="checkbox"/> CEDULA PROFESIONAL <input type="checkbox"/> PASAPORTE		

<b>DATOS DEL JEFE INMEDIATO SUPERIOR DEL USUARIO SOLICITANTE</b>		
12.- NOMBRE(S)	13.- APELLIDO PATERNO	14.- APELLIDO MATERNO
15.- PUESTO QUE DESEMPEÑA	16.- CORREO ELECTRONICO (Institucional)	17.- TELEFONO / EXT.
18.- IDENTIFICARSE CON: (Anexar copia a la solicitud, marcar con una X)		
<input type="checkbox"/> CREDENCIAL PARA VOTAR <input type="checkbox"/> CEDULA PROFESIONAL <input type="checkbox"/> PASAPORTE		

<b>DATOS DEL NODO CONNECT-DIRECT</b>		
19.- TIPO DE MOVIMIENTO (Marcar con una X)		20.- NOMBRE DEL NODO
<input type="checkbox"/> ALTA <input type="checkbox"/> BAJA <input type="checkbox"/> CAMBIO <input type="checkbox"/> PRUEBAS DE COMUNICACIÓN		
21.- DIRECCION IP	22.- MASCARA DE LA RED	23.- DIRECCION DE LA RED
POR FAVOR ESCRIBA AQUÍ EL NUEVO NODO SOLO SI EL TIPO DE MOVIMIENTO ASIGNADO FUE CAMBIO		
24.- NOMBRE DEL NODO	25.- DIRECCION IP	26.- MASCARA DE LA RED

<b>OBSERVACIONES</b>

<b>NOMBRE Y FIRMA</b>	
27.- USUARIO SOLICITANTE	28.- JEFE INMEDIATO SUPERIOR DEL USUARIO SOLICITANTE

...

## Anexo 92

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

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

## ENCABEZADO

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

## DETALLE(S)

DETALLE 1: DETERMINACION DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACION DE LA ACCION POR SERIE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios <sup>12</sup> .
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios <sup>13</sup> .
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios <sup>14</sup> .
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo <sup>5</sup> .
9	Porcentaje de Participación		N	2	6	60	67	Determinar el % que representa, el capital contable de cada serie respecto del capital contable, se deberá anotar el resultado en forma de porcentaje a seis decimales <sup>2</sup> .

DETALLE 1: DETERMINACION DEL PRECIO ACTUALIZADO DE VALUACION DE LA ACCION POR SERIE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
10	Comisión por Serie		N	2	4	68	73	Es la comisión aplicada a cada Serie, se deberá anotar en forma de porcentaje a cuatro decimales <sup>2</sup> .
11	Acciones en circulación iniciales		N	12	0	74	85	Es la cantidad de acciones en circulación finales por Serie del día anterior <sup>1</sup> .
12	Acciones vendidas		N	12	0	86	97	Es la cantidad de acciones por Serie vendidas del día que se está reportando <sup>1</sup> .
13	Acciones compradas		N	12	0	98	109	Es la cantidad de acciones por Serie compradas del día que se está reportando <sup>1</sup> .
14	Acciones en circulación finales		N	12	0	110	121	Es la cantidad de acciones en circulación por Serie en día que se está reportando <sup>1</sup> .
15	Precio de la acción		N	9	6	122	136	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales <sup>2</sup> .

**CATÁLOGO(S)**

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

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
Clave de Entidad	Descripción
430	XXI 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
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 Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.
002	538	090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Banamex Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	564	090	Siefore Básica de Pensiones	Met 0 Siefore, S.A. de C.V.
002	568	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001	Siefore Básica Uno	Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V.
002	534	001	Siefore Básica Uno	Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001	Siefore Básica Uno	Principal Siefore 1, S.A. de C.V.
002	544	001	Siefore Básica Uno	Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V.
002	550	001	Siefore Básica Uno	Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V.
002	552	001	Siefore Básica Uno	Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V.
002	556	001	Siefore Básica Uno	Siefore Azteca Básica 1, S.A. de C.V.
002	562	001	Siefore Básica Uno	Siefore Invercap, S.A. de C.V.
002	564	001	Siefore Básica Uno	Met1 Siefore, S.A. de C.V.
002	568	001	Siefore Básica Uno	Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V.
002	578	001	Siefore Básica Uno	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.
002	530	002	Siefore Básica Dos	Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V.
002	534	002	Siefore Básica Dos	Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore
002	538	002	Siefore Básica Dos	Principal Siefore 2, S.A. de C.V.
002	544	002	Siefore Básica Dos	Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V.
002	550	002	Siefore Básica Dos	Inbursa Siefore, S.A. de C.V.
002	552	002	Siefore Básica Dos	Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V.
002	556	002	Siefore Básica Dos	Siefore Azteca, S.A. de C.V.
002	562	002	Siefore Básica Dos	Siefore Invercap II, S.A. de C.V.
002	564	002	Siefore Básica Dos	Met2 Siefore, S.A. de C.V.
002	568	002	Siefore Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	Siefore Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	Siefore Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	Siefore Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	Siefore Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	Siefore Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	Siefore Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S.A. de C.V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S.A. de C.V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V.
017	652	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> 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.

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

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

...

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

<b>POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO</b>
--

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

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son Solo aquellas Siefores de Previsión Social que tengan en su estructura diferentes series accionarias derivadas del cobro de comisiones sobre saldo diferenciadas.
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:
  - 1° ISIN, de no existir éste,
  - 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,
  - 3° SEDOL.

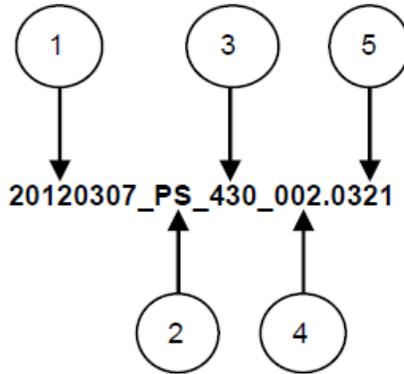
Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores.

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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "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 (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0321"</b> .

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

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



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

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

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

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

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 94

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

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

CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		AN	2	0	1	2	Identificador de registro Constante "H" <sup>4</sup> .
2	Tipo de Mercado		AN	2	0	3	4	Constante "DR" Mercado de Derivados <sup>4</sup> .
3	Fecha del Vector		F	8	0	5	12	Fecha de información <sup>3</sup> .
4	Tipo de Valor		AN	4	0	13	16	Clave de tipo de operación Para Derivados OTC, se tomará el Tipo de Valor según el "Catálogo de Tipos de Valor OTC". Para los Mercados listados se tomará la clasificación preestablecida, o la que determine cada proveedor de Precios <sup>4</sup> .
5	Emisora		AN	7	0	17	23	Para el caso de derivados que coticen en bolsas locales, se deberá reportar la clave del contrato asignada por la bolsa en donde cotice. Para el caso de futuros que coticen en mercados internacionales, se deberá reportar el identificador que asigna Bloomberg al tipo de contrato y que forma parte del Ticker. Para derivados OTC, distintos a los swaps, se usará la clave larga de acuerdo a las Reglas para Emisoras del Anexo I correspondiente al subyacente; en caso de que el subyacente no tenga clave larga asociada, el Proveedor de Precios definirá la clave larga a usar. Para derivados OTC donde el subyacente sea una divisa diferente del peso se utilizarán seis caracteres que describa la cotización usando las tres primeras letras para la divisa a entregar y las últimas tres para la divisa a recibir conforme a las Reglas para Emisoras del Anexo I. Para el caso de operaciones de swap, la Emisora se definirá de acuerdo con el Anexo I del presente formato. <sup>4</sup>
6	Serie		AN	6	0	24	29	Para el caso de derivados que coticen en bolsas locales, se deberá reportar la clave del vencimiento asignada por la bolsa en donde cotice. Para el caso de futuros que coticen en mercados internacionales, se deberá reportar el identificador que asigna Bloomberg al vencimiento del contrato y que forma parte del Ticker. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser construida considerando el formato "aammdd" <sup>4</sup> .
7	Precio Sucio		N	9	6	30	44	Precio de origen, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
8	Precio Limpio		N	9	6	45	59	Precio de origen, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
9	Delta		N	6	6	60	71	Para el caso de opciones, será la delta de la opción, en otro caso será constante "0000000000" <sup>2</sup> .
10	Volatilidad Implícita		N	3	8	72	82	Para el caso de las opciones, se deberá anotar la Volatilidad con la que se valúa la operación, en otro caso se deberá anotar ceros <sup>2</sup> .
11	ID del Proveedor		AN	6	0	83	88	ID del proveedor de Precios de acuerdo al "Catálogo de Proveedores de Precios" <sup>4</sup> .
12	Días por Vencer		N	6	0	89	94	Son los días que faltan para el vencimiento de la emisión <sup>1</sup> .
13	Tasa de Descuento		N	3	6	95	103	Será constante "00000000" <sup>1</sup> .

CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
14	ISIN		AN	12	0	104	115	Se deberá anotar la clave del ISIN <sup>5</sup> .
15	Consecutivo		AN	10	0	116	125	Identificador que le otorgue como consecutivo el proveedor de precios al derivado <sup>8</sup> .
16	Precio Cierre		N	9	6	126	140	Precio de cierre de mercados listados <sup>2</sup> .
17	CUSIP o CINS		AN	9	0	141	149	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS <sup>5</sup> .
18	SEDOL		AN	7	0	150	156	Se deberá anotar la clave del SEDOL <sup>7</sup> .
19	Precio de referencia de la pata a entregar.		N	14	6	157	176	Se deberá anotar el precio sucio de la pata a entregar por la SIEFORE para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales. Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el precio sucio de la pata a entregar en el contrato, asumiendo una posición larga en dicho contrato. En caso de reportar operaciones distintas a swaps, se deberán reportar ceros <sup>2</sup> .
20	Precio de referencia de la pata a recibir.		N	14	6	177	196	Se deberá anotar el precio sucio de la pata a recibir por la SIEFORE para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales. Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el precio sucio de la pata a recibir en el contrato, asumiendo una posición larga en dicho contrato. En caso de reportar operaciones distintas a swaps, se deberán reportar ceros <sup>2</sup> .
21	Curva de descuento		AN	5	0	197	201	Para el caso de derivados distintos de swaps, se deberá anotar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar el derivado de acuerdo con el Catálogo de Curvas. Para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a entregar por la SIEFORE de acuerdo con el Catálogo de Curvas. Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a entregar en el contrato asumiendo una posición larga en el mismo. Para el caso de los derivados de tipo de cambio, en este campo se deberá reportar la curva de descuento correspondiente a la divisa a entregar del derivado. Para cualquier otro caso se deberá reportar vacío <sup>4</sup> .
22	Curva de descuento de la pata a recibir		AN	5	0	202	206	Para el caso de derivados distintos de swaps, se deberá reportar en ceros. Para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a recibir por la SIEFORE de acuerdo con el Catálogo de Curvas. Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el identificador de la curva de descuento utilizada para valuar la pata a recibir en el contrato asumiendo una posición larga en el mismo. Para el caso de los derivados de tipo de cambio, en este campo se deberá reportar la curva de descuento correspondiente a la divisa a recibir del derivado. Para cualquier otro caso se deberá reportar vacío <sup>4</sup> .
23	Curva de estimación de tasas a entregar		AN	5	0	207	211	Para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a entregar por la SIEFORE, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante. Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a entregar en el contrato asumiendo una posición larga en dicho contrato, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante. Se deberá reportar en ceros para cualquier otro caso <sup>4</sup> .

CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
24	Curva de estimación de tasas a recibir		AN	5	0	212	216	<p>Para el caso de swaps OTC que no liquiden en contrapartes centrales se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a recibir por la SIEFORE, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.</p> <p>Para el caso de swaps que liquiden en contrapartes centrales y swaps listados, se deberá reportar el identificador de la curva utilizada para realizar la proyección de tasas de interés, de acuerdo con el Catálogo de Curvas, de la pata a recibir en el contrato asumiendo una posición larga en dicho contrato, cuando la tasa asociada a la pata sea flotante.</p> <p>Se deberá reportar en ceros para cualquier otro caso<sup>4</sup>.</p>

**CATÁLOGO(S)**

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

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

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

Catálogo de Curvas	
Identificador	Curva
00001	Cross Currency Swap Dólar - Peso mexicano
00002	Cross Currency Swap Euro - Peso mexicano
00003	Cross Currency Swap Libor Dólar - Euribor
00004	Cross Currency Swap TIIE Euribor
00005	Cross Currency Swap UDI Libor
00006	Cross Currency Swap UDI TIIE
00007	Curva Treasury
00008	Euribor 6M
00009	Fed Funds
00010	Implícita en Forward de Dólar australiano - Dólar
00011	Implícita en Forward de Dólar canadiense - Dólar
00012	Implícita en Forward de Dólar de Hong Kong - Dólar
00013	Implícita en Forward de Euro - Dólar
00014	Implícita en Forward de Euro - Pesos mexicanos
00015	Implícita en Forward de Franco suizo - Dólar
00016	Implícita en Forward de Libra Esterlina - Dólar
00017	Implícita en Forward de Peso chileno - Dólar
00018	Implícita en Forward de Pesos mexicanos - Dólar
00019	Implícita en Forward de Pesos mexicanos- Dólar (Fix)
00020	Implícita en Forward de Real brasileño - Dólar
00021	Implícita en Forward de Yen japonés - Dólar
00022	Implícita en Forward de Yen japonés - Peso mexicano
00023	Implícita en Forward de Yuan chino - Dólar
00024	Libor Dólar australiano
00025	Libor Dólar canadiense
00026	Libor Dólar neozelandés
00027	Libor Dólares construcción 1M
00028	Libor Dólares construcción 3M
00029	Libor Dólares construcción 6M
00030	Libor Euro
00031	Libor Franco suizo
00032	Libor Libra Esterlina
00033	Libor Yen japonés
00034	Soberana nominal (Cetes y BONOS M)
00035	Soberana real (UDIBONOS)
00036	TIIE OIS colateral en MXN
00037	TIIE IRS sin colateral
00038	TIIE OIS colateral en USD
00039	Otras Curvas

## ANEXO I

## 1. Claves de emisora de Swaps

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Operación	1	2	3	4	5	6	7	Resultado
Swap tasa fija 8.25 vs CETES. La SIEFORE entrega tasa fija 8.25 y recibe Cetes	1	M	X	P	C	E	T	1MXP CET
Swap TIIE vs CETES. La SIEFORE entrega TIIE y recibe CETES	2	T	I	E	C	E	T	2TIE CET
Swap MXP 7.28 vs USD 2.00. La SIEFORE entrega tasa Pesos y recibe tasa Dólares	3	M	X	P	U	S	D	3MXP USD
Swap EUR 1.35 vs USD Libor. La SIEFORE entrega tasa EUR y recibe USD Libor	4	E	U	R	L	U	S	4EUR USD
Swap MXP TIIE vs EUR Libor. SIEFORE entrega TIIE y recibe EUR Libor	5	T	I	E	L	E	U	5TIE EUR
Swap listado TIIE vs MXP 5.02 en posición larga El contrato en posición larga entrega TIIE y recibe fija al 5.02 en pesos. La SIEFORE entrega TIIE y recibe fija al 5.02 en pesos	6	T	I	E	M	X	P	6TIEMXP
Swap listado TIIE vs MXP 5.02 en posición corta. Pese a que por tener el contrato en posición corta la SIEFORE entrega tasa fija al 5.02 en pesos y recibe TIIE, la especificación para la construcción de la emisora señala que para este tipo de swaps se debe asumir una posición larga en el contrato, el cual entrega TIIE y recibe tasa fija al 5.02 en pesos.	6	T	I	E	M	X	P	6TIEMXP

**Reglas para Emisoras**

- Las claves largas para cada una de las monedas operadas están contempladas dentro del vector de precios, siendo formada por la clave de cada una de las monedas participantes según el catálogo de divisa quedando en seis caracteres.
- Las claves largas de las tasas libor se conforman de la siguiente manera: las dos primeras posiciones corresponderán a las letras LI y las siguientes tres a la moneda a la que corresponda la tasa libor.
- Las claves cortas de las tasas libor se conforman de la siguiente manera: la 1ª posición corresponderá a la letra L y las siguientes dos a las dos primeras letras de la moneda a la que corresponda la tasa libor.

Ejemplos:

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

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

Las claves cortas para TIIE se conforman del texto TIE.

Ejemplos:

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

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

Las claves cortas para CETES se conforman del texto CET.

Ejemplos:

Descripción	Clave Larga	Clave Corta	Categoría
Cetes 28	CET28	CET	Tasa
Cetes 91	CET91	CET	Tasa
Cetes 182	CET182	CET	Tasa

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO**

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

- 1 y 2: corresponden al prefijo del país
- 3: corresponde al identificador de región
- 4 al 9: corresponden al identificador del emisor
- 10 y 11: corresponden al identificador de la emisión
- 12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

No. de carácter	Descripción						
1	Letra Inicial de Proveedor P = PIP, V = VALMER.						
2-3	Clave que identifica el año en el que se dio de alta el Derivado 03 = 2003, 04 = 2004... y así sucesivamente.						
4-8	Número consecutivo de la operación, el cual será diferente para cada proveedor; dado que dependerá de las operaciones que sus clientes vayan realizando. Será incrementado en uno cada vez que exista duplicidad en "Tipo de valor", "Emisora" y "Serie".						
9-10	En caso de que las operaciones estén respaldadas por un acuerdo de intercambio de colateral conocidos como "Credit Support Annex" (CSA) que impacte la valuación del instrumento, se deberán reportar los siguientes caracteres de acuerdo con el tipo de colateral que respaldan los contratos:						
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Caracteres</th> <th>Tipo de colateral</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>"CU"</td> <td>Colateral en dólares americanos (USD)</td> </tr> <tr> <td>"CM"</td> <td>Colateral en pesos mexicanos (MXN)</td> </tr> </tbody> </table>	Caracteres	Tipo de colateral	"CU"	Colateral en dólares americanos (USD)	"CM"	Colateral en pesos mexicanos (MXN)
	Caracteres	Tipo de colateral					
	"CU"	Colateral en dólares americanos (USD)					
"CM"	Colateral en pesos mexicanos (MXN)						
En caso de las operaciones que liquiden en las cámaras de compensación de CME o Asigna se utilizarán los caracteres "CU".							
En otro caso llenar con espacios en blanco.							

**POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

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

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

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

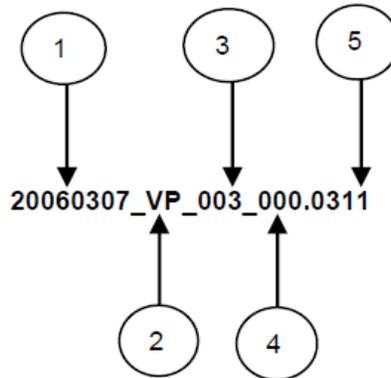
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de una VPN (Red privada Virtual) para cada proveedor de precios.
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de Precios contratado por cada Administradora.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 16:00 a las 20:00 hrs.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte del proveedor a CONSAR se compone de lo siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0311</b> .

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

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



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

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

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

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

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

...

**Anexo 97**

Se deroga.

...

**Anexo 111**

	COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO <b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b> 0330 <b>FUENTE:</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO:</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN:</b>
---	--	---

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

**ENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> <sup>1</sup> .
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado <sup>1</sup> .
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "419"</b> <sup>1</sup> .
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0330"</b> <sup>1</sup> .
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Se deberá anotar la "Clave del Tipo de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Tipos de Entidades" anexo <sup>1</sup> .
6	Entidad		N	3	0	19	21	Se deberá anotar la "Clave de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Entidades" anexo <sup>1</sup> .
7	Subtipo de Entidad		N	3	0	22	24	Se deberá anotar la "Clave del Subtipo de Entidad" de la Siefore a nombre de la cual se reporta la información de acuerdo al "Catálogo de Subtipo de Entidades", anexos <sup>1</sup> .
8	Fecha de Información		F	8	0	25	32	Fecha de operación que se reporta <sup>3</sup> .
9	Espacios en blanco		AN	387	0	33	419	Vacios <sup>5</sup> .

**SUBENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "101"</b> <sup>1</sup> .
2	Identificador Mandatario		AN	7	0	4	10	Se deberá reportar el nombre descriptivo del Mandatario que defina la Administradora. Deberá corresponder a la información que reporta la Siefore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .
3	Consecutivo Mandato		AN	7	0	11	17	Deberá ser un consecutivo que defina la Administradora, el cual se incrementará para cada mandato que se contrate con un mismo mandatario. Deberá corresponder a la información del campo "Serie" que reporta la Siefore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
4	Clase de Inversión tercerizada		AN	10	0	18	27	Se deberá reportar el indicador de clase de activo sobre el que operará el mandato según el catálogo "Clase de Inversión tercerizada". Deberá corresponder a la información que la Siefore reporta en el campo "Consecutivo" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .
5	País del Mandatario		N	2	0	28	29	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países <sup>1</sup> .
6	Fecha de Concertación del Mandato.		F	8	0	30	37	Reportar la fecha en que se pactó el mandato (Fecha de firma del contrato) <sup>3</sup> .
7	Espacios en blanco		AN	382	0	38	419	Vacios <sup>5</sup> .

## DETALLE(S)

## DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión conforme al "Catálogo de Tipo de Inversión" <sup>1</sup> .
3	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	6	15	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
4	ISIN		AN	12	0	16	27	Se deberá anotar la clave del ISIN del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>7</sup> .
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	28	36	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>9</sup> .
6	SEDOL		AN	7	0	37	43	Se deberá anotar la clave del SEDOL del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>9</sup> .
7	Ticker Bloomberg		AN	20	0	44	63	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista <sup>10</sup> .
8	Ticker Reuters		AN	20	0	64	83	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al activo en directo, colateral de la operación de reporto o el valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista <sup>11</sup> .
9	Clase de Activo		N	2	0	84	85	Se deberá anotar el identificador de la clase de activo reportado según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" <sup>1</sup> .
10	País de origen		N	2	0	86	87	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al "Catálogo de Países" <sup>1</sup> .
11	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	88	97	Los identificadores reportados en este campo se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo denominado "ID Emisor/Contraparte". En caso de reportar instrumentos de deuda, estructuras vinculadas a subyacentes o acciones se deberá anotar el identificador correspondiente al emisor del instrumento. En caso de reportar vehículos, se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador del mismo. En el caso de reportar operaciones de reporto, préstamo de valores o garantías entregadas, se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte <sup>4</sup> .

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
12	Primera Calificación		N	4	0	98	101	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la calificación mínima, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
13	Segunda Calificación		N	4	0	102	105	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la segunda calificación más baja, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
14	Primera Calificadora		N	2	0	106	107	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Primera Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras". Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
15	Segunda calificadora		N	2	0	108	109	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Segunda Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras". Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
16	Fecha de Emisión		F	8	0	110	117	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se deberá indicar la fecha de emisión. En caso de que se reporten operaciones de reporto o préstamo de valores se deberá indicar la fecha de concertación de la operación. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
17	Fecha de Vencimiento		F	8	0	118	125	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes indicar la fecha de vencimiento. En caso de que reporten operaciones de reporto y préstamo de valores indicar la fecha de vencimiento de las operaciones. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
18	Plazo Cupón		N	4	0	126	129	En caso de tratarse de instrumentos de deuda con cupones, indicar el plazo del cupón en días. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .
19	Tasas o sobretasas		N	2	6	130	137	En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones a tasa fija, se deberá indicar el nivel de la tasa cupón. En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones flotantes se deberá indicar el nivel de la sobretasa del cupón. En caso de estar reportando operaciones de reporto, indicar la tasa pactada. Finalmente, en caso de estar reportando valores en préstamo, se deberá indicar la tasa premio pactada en la operación. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
20	Divisa de Cotización		N	2	0	138	139	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del activo según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
21	Divisa de liquidación		N	2	0	140	141	Se anotará el identificador de la divisa de liquidación del instrumento o de la operación que se reporte, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
22	Cantidad de Títulos		N	12	0	142	153	Se deberá reportar el número de títulos o acciones que conforman la posición del Mandato <sup>1</sup> .
23	Valor a Mercado		N	12	2	154	167	En este campo se deberá reportar el valor total a mercado de la posición en pesos mexicanos <sup>6</sup> .

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
24	Valor Nominal		N	8	2	168	177	Para activos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se indicará el Valor Nominal en la divisa de cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
25	Títulos en Circulación		N	8	0	178	185	En el caso de instrumentos de deuda y estructuras vinculadas a subyacentes, se deberá reportar el número de títulos que se encuentran en circulación en la fecha en que se reporta la información. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .
26	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	186	195	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". Para el caso de activos a través de los cuales se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -En caso de tratarse de una acción, el identificador que se definió para la acción. -En el caso de vehículos que repliquen Índices, se deberá anotar el identificador del Índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
27	Protección Inflacionaria		N	1	0	196	196	Se deberá anotar 1 si el o los flujos del instrumento están denominados en Unidades de Inversión (UDIs) o en moneda nacional cuyos intereses garanticen un rendimiento mayor o igual a la variación de las Unidades de Inversión (UDIs) o del Índice Nacional de Precios al Consumidor (INPC), Se deberá anotar 0 en otro caso <sup>1</sup> .
28	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	197	197	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
29	Aviso de Recomposición		N	1	0	198	198	Este campo se utilizará para indicar el tipo de recomposición al que la posición será sometida en caso de que con la misma se incurra en algún tipo de violación al Régimen de Inversión conforme a las disposiciones y lineamientos emitidos por la Comisión. Se deberá indicar si la posición a la fecha de reporte de información no está sujeta a ningún tipo de recomposición, si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición y se mantendrá la inversión de recursos en ella, o si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición y se planea deshacer la posición. Para este fin, se deberá anotar el identificador correspondiente al estatus vigente de la posición reportada y que se define en el "Catálogo Aviso de Recomposición" <sup>1</sup> .
30	Descriptivo		AN	100	0	199	298	Se deberá anotar una breve descripción del activo <sup>4</sup> .
31	Espacios vacíos		AN	121	0	299	419	Vacios <sup>5</sup> .

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento reportado <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento reportado <sup>8</sup> .

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento reportado <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento reportado en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento reportado en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de operación		F	8	0	82	89	Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90	97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del forward <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98	113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y denominado en la divisa en que se pacte <sup>9</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114	127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128	147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .
13	Plazo de Referencia		N	4	0	148	151	En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152	152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
15	Entrega Física o Diferenciales		AN	1	0	153	153	Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D" cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega" <sup>4</sup> .
16	Clase de Activo		N	2	0	154	155	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" correspondiente al subyacente <sup>1</sup> .
17	Ticker Bloomberg Subyacente		AN	20	0	156	175	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver <sup>10</sup> .
18	Ticker Reuters Subyacente		AN	20	0	176	195	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver <sup>11</sup> .
19	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	196	205	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberá anotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso. -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
20	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	8	0	206	213	Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	214	223	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
22	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	224	233	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
23	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	234	235	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
24	Divisa del tamaño del contrato		N	2	0	236	237	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
25	Divisa de Liquidación		N	2	0	238	239	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
26	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	240	245	En caso de que el forward tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga. En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
27	Valor a Mercado		N	12	2	246	259	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
28	Monto expuesto		N	12	2	260	273	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
29	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	274	274	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
30	Descriptivo		AN	100	0	275	374	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
31	Espacios en blanco		AN	45	0	375	419	Vacíos <sup>5</sup> .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de Operación		F	8	0	82	89	Se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el futuro <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90	97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del futuro <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98	113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y en la divisa en que se pacte <sup>2</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114	127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128	147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .
13	Plazo de Referencia		N	4	0	148	151	En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152	152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
15	Entrega Física o Diferenciales		AN	1	0	153	153	Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D" cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega" <sup>4</sup> .
16	Clase de Activo		N	2	0	154	155	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" correspondiente al subyacente <sup>1</sup> .
17	Ticker Bloomberg Subyacente		AN	20	0	156	175	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver <sup>10</sup> .
18	Ticker Reuters Subyacente		AN	20	0	176	195	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver <sup>11</sup> .
19	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	196	205	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberá anotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso. -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
20	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	8	0	206	213	Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Bolsa de Derivados		AN	8	0	214	221	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados en la cual fue adquirida la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
22	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	222	223	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
23	Divisa del tamaño del contrato		N	2	0	224	225	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
24	Divisa de Liquidación		N	2	0	226	227	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación diaria del contrato según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
25	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	228	233	En caso de que el futuro tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga. En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
26	Valor a Mercado		N	12	2	234	247	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
27	Monto expuesto		N	12	2	248	261	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
28	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	262	262	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
29	Descriptivo		AN	100	0	263	362	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
30	Espacios en blanco		AN	57	0	363	419	Vacios <sup>5</sup> .

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "304"</b> <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de Operación		F	8	0	82	89	En caso de reportar derivados estandarizados, se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre la opción. En caso de reportar derivados OTC, se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90	97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la opción <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98	113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto en la divisa en que se pacte <sup>2</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114	127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	9	6	128	142	Se deberá anotar el precio o tasa strike que se pactó en la operación <sup>2</sup> .

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
13	Prima Pactada		N	14	6	143	162	Se deberá anotar el importe de la prima que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato, denominada en la divisa de liquidación de la misma <sup>2</sup> .
14	Tipo de Opción		N	3	0	163	165	Se deberá anotar el identificador correspondiente al tipo de opción que se reporta de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Opción" <sup>1</sup> .
15	Opción CALL/PUT		N	1	0	166	166	Se deberá anotar con 1 las opciones CALL y con 2 las opciones PUT <sup>1</sup> .
16	Plazo de Referencia		N	4	0	167	170	En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
17	Tipo de Operación		N	1	0	171	171	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
18	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	172	172	Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D" cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega" <sup>4</sup> .
19	Clase de Activo		N	2	0	173	174	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" correspondiente al subyacente <sup>1</sup> .
20	Ticker Bloomberg Subyacente		AN	20	0	175	194	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver <sup>10</sup> .
21	Ticker Reuters Subyacente		AN	20	0	195	214	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver <sup>11</sup> .
22	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	215	224	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberá anotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso. -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
23	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	8	0	225	232	Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
24	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	233	242	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
25	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	243	252	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
26	Divisa de Cotización del Subyacente		N	2	0	253	254	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
27	Divisa del Tamaño del Contrato		N	2	0	255	256	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	257	258	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
29	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	259	264	En caso de que la opción tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga. En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
30	Valor a Mercado		N	12	2	265	278	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
31	Monto expuesto		N	12	2	279	292	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
32	Delta		N	3	8	293	303	Se deberá reportar la delta de la opción y con la cual se lleva a cabo el cálculo de la Exposición Delta <sup>2</sup> .
33	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	304	304	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
34	Descriptivo		AN	100	0	305	404	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
35	Espacios vacíos		AN	15	0	405	419	Vacíos <sup>5</sup> .

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Entregar		AN	20	0	82	101	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
9	Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Entregar		AN	20	0	102	121	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
10	Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Recibir		AN	20	0	122	141	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .
11	Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Recibir		AN	20	0	142	161	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
12	Fecha de Operación		F	8	0	162	169	En caso de reportar derivados estandarizados, se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el swap. En caso de reportar derivados OTC, se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
13	Fecha de Vencimiento Flujos a Entregar		F	8	0	170	177	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a entregar en el swap <sup>3</sup> .
14	Fecha de Vencimiento Flujos a Recibir		F	8	0	178	185	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a recibir en el swap <sup>3</sup> .
15	Valor Nocional Flujos a Entregar		N	12	2	186	199	Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a entregar en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
16	Valor Nocional Flujos a Recibir		N	12	2	200	213	Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a recibir en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
17	Plazo de flujos a entregar		N	3	0	214	216	Anotar el plazo en días de los flujos a entregar <sup>1</sup> .
18	Plazo de flujos a recibir		N	3	0	217	219	Anotar el plazo en días de los flujos a recibir <sup>1</sup> .
19	Intercambio de Nocionales a Vencimiento		N	1	0	220	220	Anotar 1 si se pacta entrega de nocionales al vencimiento de la operación. Anotar cero en otro caso <sup>1</sup> .
20	Tipo de flujos a Entregar		N	1	0	221	221	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 1 <sup>1</sup> .
21	Tipo de flujos a Recibir		N	1	0	222	222	En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 1 <sup>1</sup> .
22	Tipo de cambio pactado		N	12	6	223	240	Se deberá anotar el tipo de cambio que se pactó para el caso de swaps con nocionales en distinta divisa. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
23	Tasa de Flujos a Entregar		N	3	4	241	247	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
24	Tasa de Flujos a Recibir		N	3	4	248	254	En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
25	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Entregar		AN	10	0	255	264	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" En caso de que los flujos a entregar estén ligados a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
26	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Recibir		AN	10	0	265	274	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" En caso de que los flujos a recibir estén ligados a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
27	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	275	284	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
28	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	285	294	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
29	Divisa flujos a entregar		N	2	0	295	296	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
30	Divisa flujos a recibir		N	2	0	297	298	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisa" <sup>1</sup> .
31	Divisa nomenclal a entregar		N	2	0	299	300	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nomenclal de los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
32	Divisa nomenclal a recibir		N	2	0	301	302	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nomenclal de los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
33	Divisa de Liquidación		N	2	0	303	304	Se deberá reportar el identificador de la divisa de con la que se estarán liquidando los flujos, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
34	Valor a mercado.		N	12	2	305	318	En este campo se debe anotar el valor total a mercado la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>9</sup> .
35	Indicador para cobertura de divisas.		N	1	0	319	319	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
36	Descriptivo		AN	100	0	320	419	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTE, PRESTAMO DE VALORES E INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Operación asociada a la Garantía.		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el tipo de operación que origino la recepción de las Garantías según el catálogo de "Tipo de Operación asociada a la Garantía" <sup>1</sup> .
3	Identificador de posición de Garantía Recibida		AN	10	0	5	14	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada garantía de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
4	Identificador de operación del Mandato asociado a la garantía		AN	10	0	15	24	En caso de que la garantía se reciba por una operación de préstamo de valor o reporte, se deberá anotar el "Identificador del Instrumento del Mandato" que se reporta en el "Detalle 1" del presente formato correspondiente a la operación a la que se asocia la garantía <sup>4</sup> .
5	ISIN		AN	12	0	25	36	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se recibe como garantía <sup>7</sup> .
6	CUSIP O CINS		AN	9	0	37	45	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se recibe como garantía <sup>9</sup> .
7	SEDOL		AN	7	0	46	52	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se recibe como garantía <sup>9</sup> .
8	Ticker Bloomberg		AN	20	0	53	72	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento que se recibe en garantía <sup>10</sup> .

**DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LAS GARANTÍAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTO, PRESTAMO DE VALORES E INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
9	Ticker Reuters		AN	20	0	73	92	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento que se recibe en garantía <sup>11</sup> .
10	Clase de Activo		N	2	0	93	94	Se deberá anotar el identificador de la clase del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Clase de Activo de la inversión tercerizada" <sup>11</sup> .
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	95	106	Se deberá reportar el número de títulos recibidos en garantía <sup>1</sup> .
12	Precio limpio		N	12	2	107	120	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de las garantías reportadas a precio y en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
13	Intereses devengados		N	12	2	121	134	En este campo se deberán anotar los intereses devengados de las garantías reportadas en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
14	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	135	144	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la cual se reciben las garantías. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
15	Divisa de Cotización		N	2	0	145	146	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
16	Valor Nominal		N	8	2	147	156	En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar el Valor Nominal en la Divisa de Cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
17	Fecha de Vencimiento		F	8	0	157	164	En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de vencimiento del instrumento que se reporta. En otro caso anotar 19000101 <sup>3</sup> .
18	Fecha de Emisión		F	8	0	165	172	En caso de estar reportando instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de emisión del instrumento que se reporta. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
19	Descriptivo		AN	100	0	173	272	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
20	Espacios vacíos		AN	147	0	273	419	Vacios <sup>5</sup> .

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307" <sup>1</sup> .
2	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	4	13	En caso de reportar depósitos en instituciones financieras se deberá anotar el identificador correspondiente a la Institución Financiera con la cual se realiza el depósito. En caso de reportar aportaciones iniciales mínimas y excedentes para operaciones con derivados listados, se deberá anotar el identificador correspondiente a la bolsa de derivados en cuya cámara de compensación se están realizando las aportaciones mínimas y excedentes. Estos identificadores se deberán agregar en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
3	Divisa		AN	2	0	14	15	Se reportará el identificador de la divisa en la cual está denominado el depósito o la aportación según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
4	Monto en divisa		N	12	2	16	29	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa en la que se encuentre denominado <sup>2</sup> .
5	Monto		N	12	2	30	43	Se deberá anotar el valor en pesos mexicanos del depósito o aportación <sup>6</sup> .
6	Espacios vacíos		AN	376	0	44	419	Vacios <sup>5</sup> .

**DETALLE 8: FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRÁNSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "308" <sup>1</sup> .
2	Divisa del Flujo		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que se liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
3	Tipo de Operación		N	1	0	6	6	Anotar 1 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de entrada (Flujo positivo). Anotar 2 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de salida (Flujo negativo) <sup>1</sup> .
4	Monto por liquidar		N	12	2	7	20	Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, para la divisa reportada en el campo 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar y en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
5	Espacios vacíos		AN	399	0	21	419	Vacíos <sup>5</sup> .

**CATÁLOGO(S)**

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V.
017	652	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

Catálogo de Clase de Inversión Tercerizada	
Identificador	Descripción
0	No Aplica
1	Mercancías
2	Renta Variable
3	Deuda Extranjera
4	Tipos de Cambio
9	Mixto

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
CCC	Caa2	CCC		1045
CCC-	Caa3	CCC-		1046
CC	Ca	CC	HR C (G)	1047
C	C	C	HR C- (G)	1048
D		D	HR D (G)	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global				
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)	1050
F1		A-1	HR1 (G)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)	1053
B			HR4 (G)	1054
C			HR5 (G)	1055

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

<sup>6</sup> Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- 1 y 2: corresponden al prefijo del país.
- 3: corresponde al identificador de región
- 4 al 9: corresponden al identificador del emisor
- 10 y 11: corresponden al identificador de la emisión
- 12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

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

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal:

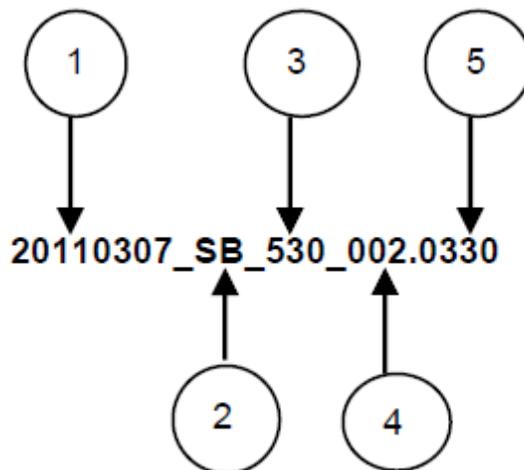
<https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/>

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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad a nombre de quien se transmite la información, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidades anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social a nombre de quien se transmite la información conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta la información (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0330"</b> .

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

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



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

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

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

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

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

## Anexo 112

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

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

## ENCABEZADO

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

## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101" <sup>1</sup> .
2	Identificador Mandatario		AN	7	0	4	10	Se deberá reportar el nombre descriptivo del Mandatario definido por la Administradora. Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Emisora" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .
3	Consecutivo Mandato		AN	7	0	11	17	Deberá ser un consecutivo definido por la Administradora el cual se incrementará para cada mandato contratado con un mismo mandatario. Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Serie" reportado por la Siefiore en el formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .
4	Clase de Inversión tercerizada		AN	10	0	18	27	Se deberá reportar el indicador de clase de activo sobre el que operará el mandato según el catálogo "Clase de Inversión Tercerizada". Deberá corresponder a la información reportada en el campo "Consecutivo" del formato de transmisión 0300 "Detalle 3" <sup>4</sup> .
5	País del Mandatario		N	2	0	28	29	Se identificará el país de origen del mandatario conforme al catálogo de Países <sup>1</sup> .
6	Fecha de Concertación del Mandato		F	8	0	30	37	Se deberá reportar la fecha en que se pactó el mandato <sup>3</sup> .
7	Espacios en blanco		AN	66	0	38	103	Vacios <sup>5</sup> .

**DETALLE(S)**

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

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

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

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

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

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> <sup>1</sup> .
2	ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único para cada nuevo elemento de Renta Variable o Mercancías, este identificador deberá ser generado para cada nuevo elemento que se integre a este catálogo debido a: -Que alguna posición del mandato esté tomando exposición al elemento y se requiera del identificador para incluirse en los Detalles 1 a 5 del formato de información 0330 en el campo "ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías". -Que alguna posición del mandato esté tomando exposición a algún índice que contenga a este elemento y se requiera el identificador para el "Detalle 2" del presente formato de transmisión en el campo "ID acciones o mercancías" para descomponer a dicho índice. -Que exista alguna recomposición en cualquiera de los índices a los que se tenga exposición y se incorporen acciones que no existan en el catálogo. Este identificador no podrá ser reutilizado y una vez que se envíe algún elemento por primera vez tendrá que reportarse permanentemente <sup>4</sup> .
3	Nombre Descriptivo		AN	50		14	63	Indicar el nombre descriptivo del elemento de Renta Variable o Mercancía que se esté reportando dentro del catálogo <sup>4</sup> .
4	Ticker de Bloomberg del Componente de Renta Variable o Mercancía.		AN	20	0	64	83	Se deberá reportar el ticker que Bloomberg asigna al elemento de Renta Variable o Mercancía de que se trate <sup>6</sup> .
5	Ticker de Reuters del Componente de Renta Variable o Mercancía.		AN	20	0	84	103	Se deberá reportar el ticker que Reuters asigna al elemento de Renta Variable o Mercancía de que se trate <sup>7</sup> .

**DETALLE 2:** CONTIENE LA INFORMACIÓN DE LA DESCOMPOSICIÓN DE ÍNDICES. Todos los índices reportados en el "Detalle 1" deben contar con una descomposición en todas las acciones que lo componen. (Este catálogo tiene dependencia con el Detalle 1)

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "302"</b> <sup>1</sup> .
2	ID índice		AN	10	0	4	13	Se deberá anotar el identificador "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" para cada índice contenido en el "Detalle 1" del presente formato de transmisión <sup>4</sup> .
3	ID acciones o mercancías.		AN	10	0	14	23	Se deberá anotar el identificador "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías" reportado en el "Detalle 1" del presente formato, correspondiente a cada una de las acciones que componen al índice reportado en el campo anterior <sup>4</sup> .
4	Peso del componente en el Índice.		N	3	6	24	32	En este campo se deberá anotar el ponderador en puntos porcentuales que el componente reportado en el campo 3 "ID acciones" del presente Detalle, tiene dentro de la composición del Índice reportado en el campo 2 "ID índice" al cierre de la fecha de envío de información <sup>2</sup> .
5	Espacios vacíos		AN	71	0	33	103	Vacíos <sup>5</sup> .

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

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

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

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

<b>DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO DE RELACIÓN DE ENTIDADES.</b> Al interior de este detalle se deberá reportar la identificación de las compañías matriz, holding, o grupos empresariales necesarios para agrupar a los emisores o contrapartes reportados en el “Detalle 4” del presente formato, y que se encuentren relacionadas por sus nexos patrimoniales o de responsabilidad, porque la situación financiera de una o varias de ellas pueda influir en forma decisiva en la de las demás, o porque la administración de dichas personas morales dependa directa o indirectamente de una persona.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante “303” <sup>1</sup> .
2	ID Relación de Entidades		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único para cada Entidad agrupadora reportada en el presente detalle y que no podrá ser reutilizado <sup>4</sup> .
3	Nombre		AN	50	0	14	63	Indicar el nombre descriptivo de la entidad grupo que relacionará a los emisores de instrumentos en posición de los mandatarios, contrapartes con los que los mandatarios tengan concertadas operaciones de reporto, de valores en préstamo y derivados, patrocinadores de vehículos y bolsas de derivados previstas en el Detalle 4 del presente formato <sup>4</sup> .
4	Espacios vacíos		AN	40	0	64	103	Vacios <sup>5</sup> .

**DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACIÓN DEL CATÁLOGO DE EMISORES, CONTRAPARTES, PATROCINADORES DE VEHÍCULOS Y BOLSAS DE DERIVADOS.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "304"</b> <sup>1</sup> .
2	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador único para cada emisor, bolsa de derivados o contraparte, de los valores y operaciones reportados en el formato de transmisión 0330 y que no podrá ser reutilizado <sup>4</sup> .
3	Nombre		AN	20	0	14	33	Indicar el nombre descriptivo del emisor, bolsa de derivados o contraparte reportado <sup>4</sup> .
4	ID Relación de Entidades		AN	10	0	34	43	Se deberá reportar el identificador de relación de entidades reportado en el "Detalle 3" en caso de que aplique, con el cual se relaciona a la entidad reportada en el Id 2 del presente detalle con los demás emisores y contrapartes pertenecientes al mismo grupo o compañía matriz. En otro caso llenar con espacios en blanco <sup>4</sup> .
5	Primera Calificación CP		N	4	0	44	47	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la calificación crediticia de corto plazo más baja emitida por alguna agencia calificadoras listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión <sup>1</sup> .
6	Segunda Calificación CP		N	4	0	48	51	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la segunda calificación crediticia de corto plazo más baja emitida por alguna agencia calificadoras listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión <sup>1</sup> .
7	Primera Calificadora CP		N	2	0	52	53	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" <sup>1</sup> .
8	Segunda calificadora CP		N	2	0	54	55	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación CP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" <sup>1</sup> .
9	Primera Calificación LP		N	4	0	56	59	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la calificación crediticia de largo plazo más baja emitida por alguna agencia calificadoras listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión <sup>1</sup> .
10	Segunda Calificación LP		N	4	0	60	63	Se deberá reportar el identificador del "Catálogo de Calificaciones Homologadas" correspondiente a la segunda calificación crediticia de largo plazo más baja emitida por alguna agencia calificadoras listada en el catálogo de "Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión <sup>1</sup> .
11	Primera Calificadora LP		N	2	0	64	65	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Primera Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" <sup>1</sup> .
12	Segunda calificadora LP		N	2	0	66	67	Se deberá anotar el identificador de la Calificadora que emitió la calificación reportada en el campo "Segunda Calificación LP", de acuerdo al catálogo "Agencias Calificadoras" <sup>1</sup> .
13	Espacios vacíos		AN	36	0	68	103	Vacios <sup>5</sup> .

**CATÁLOGO(S)**

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

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	564	090	Siefore Básica de Pensiones	Met 0 Siefore, S.A. de C.V.
002	568	090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001	Siefore Básica Uno	Siefore XXI Banorte Protege, S.A. de C.V.
002	534	001	Siefore Básica Uno	Fondo Profuturo SB1, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001	Siefore Básica Uno	Principal Siefore 1, S.A. de C.V.
002	544	001	Siefore Básica Uno	Siefore SURA Básica 1, S.A. de C.V.
002	550	001	Siefore Básica Uno	Inbursa Siefore Básica, S.A. de C.V.
002	552	001	Siefore Básica Uno	Siefore Banamex Básica 1, S.A. de C.V.
002	556	001	Siefore Básica Uno	Siefore Azteca Básica 1, S. A. de C. V.
002	562	001	Siefore Básica Uno	Siefore Invercap, S. A. de C. V.
002	564	001	Siefore Básica Uno	Met1 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	001	Siefore Básica Uno	Siefore Coppel Básica 1, S.A. de C.V.
002	578	001	Siefore Básica Uno	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.
002	530	002	Siefore Básica Dos	Siefore XXI Banorte Consolida, S.A. de C.V.
002	534	002	Siefore Básica Dos	Fondo Profuturo SB2, S.A. de C.V., Siefore
002	538	002	Siefore Básica Dos	Principal Siefore 2, S.A. de C.V.
002	544	002	Siefore Básica Dos	Siefore SURA Básica 2, S.A. de C.V.
002	550	002	Siefore Básica Dos	Inbursa Siefore, S.A. de C.V.
002	552	002	Siefore Básica Dos	Siefore Banamex Básica 2, S.A. de C.V.
002	556	002	Siefore Básica Dos	Siefore Azteca, S.A. de C.V.
002	562	002	Siefore Básica Dos	Siefore Invercap II, S. A. de C. V.
002	564	002	Siefore Básica Dos	Met2 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	002	Siefore Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	Siefore Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	Siefore Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	Siefore Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	Siefore Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	Siefore Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	Siefore Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	24	Eslovaquia
2	Australia	25	Eslovenia
3	Austria	26	Estonia
4	Bélgica	27	Hungría
5	Canadá	28	Letonia
6	Dinamarca	29	Lituania
7	España	30	Malta
8	Estados Unidos de Norteamérica	31	República Checa
9	Finlandia	32	Suecia
10	Francia	33	Brasil
11	Grecia	34	China
12	Países Bajos (Holanda)	35	India
13	Hong Kong	36	Otro
14	Irlanda	37	Rumanía
15	Italia	38	Noruega
16	Japón	39	Chile
17	Luxemburgo	40	Israel
18	México	41	Bulgaria

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
19	Polonia	42	Colombia
20	Portugal	43	Corea del Sur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	44	Islandia
22	Suiza	45	Perú
23	Chipre	46	Singapur

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>				
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)	1032
A	A2	A	HR A (G)	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)	1041
B	B2	B	HR B (G)	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)	1044
CCC	Caa2	CCC		1045
CCC-	Caa3	CCC-		1046
CC	Ca	CC	HR C (G)	1047
C	C	C	HR C- (G)	1048
D	-	D	HR D (G)	1049
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Global</b>				
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)	1050
F1		A-1	HR1 (G)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)	1053
B			HR4 (G)	1054
C			HR5 (G)	1055

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

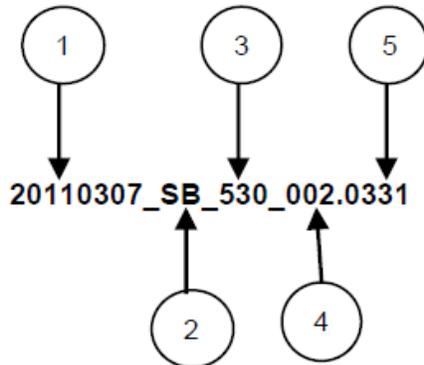
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal:  
<https://www.consar.gob.mx/gobmx/aplicativo/custodios/upload/>
- II. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios en nombre de las Siefores.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato “AAAAMDD”.
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad a nombre de quien se transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social a nombre de quien se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad a nombre de quien se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = “0331”</b> .

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

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



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

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

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

## Anexo 120

		FORMATO DEL ARCHIVO : 0405	PROCESO : SUCURSALES
		FUENTE : AFORE	ACTUALIZACIÓN :

## DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

Este archivo contiene información de la composición de género en números absolutos del total de personas integrantes en el Consejo de Administración, del Director(a) General, de los funcionarios de los dos niveles inmediatos siguientes y de sus comisarios, de la integración de los Comités de Inversión y de Riesgos, así como del Contralor Normativo.

PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
Semestral	2do día hábil posterior al semestre que reporta	255	07:00 a 19:00 Hrs.

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo = Constante "0405". <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, Constante = "001". <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Entidades (AFORES) anexo. <sup>1</sup>
5	Fecha de Información		F	8	0	14	21	Fecha de la información que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tamaño del Registro		N	3	0	22	24	Número de caracteres por registro = Constante "255". <sup>1</sup>
7	Número de Registros		N	5	0	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
8	Espacios en Blanco		AN	226	0	30	255	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

**DETALLE 1:** En este apartado, se deberá reportar la información relativa al género de los integrantes de su Consejo de Administración, del Director o Directora General, de los funcionarios y funcionarias de los dos niveles inmediatos siguientes y de sus comisarios, así como de las y los integrantes de los Comités de Inversión y de Riesgos y finalmente del Contralor o Contralora Normativo(a).

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Área		N	2	0	4	5	Se deberá reportar la Clave de Área a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Áreas. <sup>1</sup>
3	Género		N	2	0	6	7	Se deberá reportar la clave que identifica el género de funcionarias o funcionarios de acuerdo al catálogo de género. <sup>1</sup>
4	Número de Funcionarios		N	8	0	8	15	Se deberá reportar el dato numérico, por separado, de las Funcionarias y de Funcionarios que se reportan. <sup>1</sup>
5	Espacios en Blanco		AN	240	0	16	255	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 2:** Deberá indicar si la Administradora cuenta con alguna política o programa que impulse la inclusión laboral sin distinción de sexo en la composición de sus órganos de gobierno y entre sus empleados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = Constante "302". <sup>1</sup>
2	Cuenta con Política/Programa		N	1	0	4	4	La Administradora deberá de indicar si cuenta con alguna política o programa que impulse la inclusión laboral sin distinción de sexo en la composición de sus órganos de gobierno y entre sus empleados, deberá asignar 1 = Sí o 0 = No <sup>1</sup>
3	Descripción de Política/Programa		AN	251	0	5	255	Si reporto que cuenta con una política/programa describir brevemente esta. <sup>5</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

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

Catálogo de Género	
Identificador	Descripción
01	Hombres
02	Mujeres

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

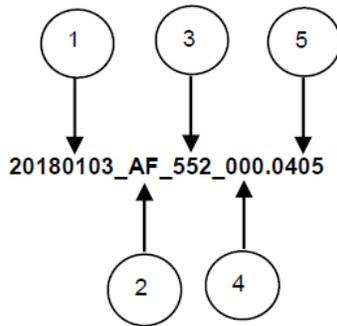
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).
- II. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente. <b>Constante = "AF"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad (AFORES) que se reporta conforme al catálogo de Entidades anexo al documento.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta ("Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será la <b>Constante = "000"</b> )
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0405"</b> .

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

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



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

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

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

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

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 121

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0341 FUENTE : AFORE	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :
---	--	---

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
Este archivo contiene información de las certificaciones y especificaciones sobre los funcionarios que realizan actividades y labores en materia financiera dentro de las Sociedades de inversión.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
TRIMESTRAL	Último día hábil de los meses de marzo, junio, septiembre y diciembre.	522	07:00 a 20:00 Hrs.

**ENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo = <b>Constante "0341"</b> . <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, <b>Constante = "001"</b> . <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Entidades (AFORES) anexo. <sup>1</sup>
5	Fecha de Información		F	8	0	14	21	Fecha de la información que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tamaño del Registro		N	3	0	22	24	Número de caracteres por registro = <b>Constante "522"</b> . <sup>1</sup>
7	Número de Registros		N	5	0	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	493	0	30	522	Vacios. <sup>6</sup>

**SUBENCABEZADO**

En este subencabezado, se deberá reportar la información relativa a cada cargo o puesto contemplado en los procesos de inversión en la estructura de la Administradora.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "101"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Cargo		N	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador numérico definido por la Administradora, que sea único para cada puesto, y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>1</sup>
3	Cargo		AN	80	0	14	93	Se deberá reportar el nombre del cargo o puesto. <sup>5</sup>
4	Descripción del Cargo		AN	255	0	94	348	Se deberá reportar una breve descripción de las responsabilidades asociadas al cargo o puesto. <sup>5</sup>
5	Área		N	2	0	349	350	Se deberá reportar la Clave de Área a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Áreas. <sup>1</sup>
6	Nombre Área		AN	80	0	351	430	En caso de que se reporte el identificador "99 - Otras áreas de la Administradora" en el campo "Área", se deberá reportar el nombre del Área a la que pertenece el cargo o puesto. <sup>5</sup>
7	Subárea		N	2	0	431	432	Se deberá reportar la Clave de la Subárea a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Subáreas. <sup>1</sup>

En este subencabezado, se deberá reportar la información relativa a cada cargo o puesto contemplado en los procesos de inversión en la estructura de la Administradora.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
8	Nombre Subárea		AN	80	0	433	512	En caso de que se reporte el identificador "99 - Otras subáreas de la Administradora" en el campo "Subárea", se deberá reportar el nombre del subárea a la que pertenece el cargo o puesto. <sup>5</sup>
9	ID Cargo del cargo de quien depende		AN	10	0	513	522	Se deberá reportar el "ID Cargo" correspondiente al cargo al cual reporta, o del cual depende directamente en dirección vertical en la estructura de la Administradora. Únicamente para el caso de cargos o puestos que no dependan directamente de otro cargo dentro de la estructura de la Administradora, como el Director General o el Contralor Normativo, este campo se deberá reportar vacío de conformidad con las especificaciones del mismo. <sup>5</sup>

#### DETALLES

**DETALLE 1:** En este detalle se deberá reportar la información del funcionario que ocupa el cargo o puesto reportado en el subencabezado del presente formato cuando el campo con Id 10 del SUBENCABEZADO se reporte en 1.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	Nombre		AN	40	0	4	43	Se deberá anotar el nombre del funcionario. <sup>5</sup>
3	Apellido Paterno		AN	40	0	44	83	Se deberá anotar el apellido paterno del funcionario. <sup>5</sup>
4	Apellido Materno		AN	40	0	84	123	Se deberá anotar el apellido materno del funcionario. <sup>5</sup>
5	Correo Electrónico Institucional		AN	50	0	124	173	Se deberá anotar el correo electrónico institucional del funcionario. <sup>5</sup>
6	Fecha de ingreso al cargo		F	8	0	174	181	Se deberá reportar la fecha en la que se tomó posesión del cargo. <sup>3</sup>
7	Fecha de ingreso a la Administradora		F	8	0	182	189	Se deberá reportar la fecha de ingreso del funcionario a la Administradora. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	333	0	190	522	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de las certificaciones que posee el funcionario ocupante del puesto o cargo cuando el campo con Id 10 del SUBENCABEZADO se reporte en 1.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo de Certificación		N	2	0	4	5	Se deberá reportar el identificador correspondiente al tipo de certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo Tipos de Certificaciones. <sup>1</sup>
3	Certificación		N	2	0	6	7	Se deberá reportar el identificador correspondiente a la Certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo de Certificaciones. <sup>1</sup>
4	Identificador Certificación		AN	50	0	8	57	Se deberá reportar el número o clave de identificación otorgada por la institución certificadora al funcionario, como por ejemplo, el "CFA Institute ID", otorgado por CFA a sus aplicantes. <sup>5</sup>
5	Fecha de emisión de la certificación		F	8	0	58	65	Se deberá reportar la fecha de emisión de la certificación reportada. <sup>3</sup>
6	Fecha fin vigencia		F	8	0	66	73	Se deberá reportar la fecha de fin de la vigencia de la certificación reportada. Para el caso de las certificaciones concluidas con vigencia permanente se deberá llenar con ceros. <sup>3</sup>
7	Espacios en blanco		AN	449	0	74	522	Vacios. <sup>6</sup>

## CATÁLOGO(S)

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

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

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

Catálogo Tipos de Certificación	
Identificador	Descripción
01	Certificación general en materia financiera
02	Certificación para operaciones con Derivados
03	Certificación de Funcionarios para Instrumentos Estructurados

Catálogo Certificación	
Identificador	Descripción
00	Certificación genérica en materia de inversiones (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
01	Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 1
02	Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 2
03	Chartered Financial Analyst (CFA)
04	Financial Risk Manager (FRM-GARP) Nivel 1
05	Financial Risk Manager (FRM-GARP)
06	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 2 Exámenes
07	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 3 Exámenes
08	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA)
09	Associate of the Society of Actuaries (ASA) 3 Exámenes
10	Associate of the Society of Actuaries (ASA)
11	Fellow of the Society of Actuaries (FSA): Especialización en Quantitative Finance and Investment (QFI)
12	Claritas Investment Certificate (aplicado por CFA Institute) o The CFA Institute Investment Foundations
13	Certificación en Derivados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
14	Certificación en Instrumentos Estructurados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
15	Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) Nivel 1
16	Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA)

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

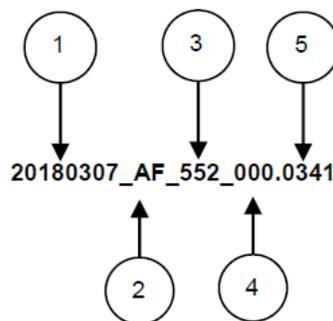
- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro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

- III. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- VI. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, <b>Constante = "AF"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad AFORES que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, <b>Constante = "001"</b> .
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será <b>Constante = "000"</b> )
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0341"</b> .

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

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



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

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

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

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

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

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

## Anexo 122

		Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
		FORMATO DEL ARCHIVO : 0342 FUENTE : SIEFORES	PROCESO : FINANCIERO ACTUALIZACIÓN :

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

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0342"</b> . <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad Siefore que reporta la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
5	Subtipo de Entidad		N	3	0	14	16	Clave del Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
6	Fecha de Información		F	8	0	17	24	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
7	Tamaño del Registro		N	3	0	25	27	Número de caracteres por registro = <b>Constante "032"</b> . <sup>1</sup>
8	Número de Registros		N	5	0	28	32	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: ÍNDICE DE RENTABILIDAD DEL PORTAFOLIO DE REFERENCIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	Índice de rentabilidad base 1 del portafolio de referencia		N	3	8	4	14	Se deberá reportar un índice afectado por la rentabilidad diaria en pesos del portafolio de referencia aplicable a la cartera de inversión del Activo Total de la Sociedad de Inversión al que hace referencia el artículo 36 de las DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro. El índice deberá ser construido con base 1, a la fecha del primer envío de la presente información y se deberá redondear a ocho decimales. <sup>2</sup>
3	Espacios en blanco		AN	18	0	15	32	Vacios. <sup>6</sup>

## CATÁLOGO(S)

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	564	002	Siefore Básica Dos	Met2 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	002	Siefore Básica Dos	Siefore Coppel Básica 2, S.A. de C.V.
002	578	002	Siefore Básica Dos	Más Pensión Siefore Básica 2, S.A. de C.V.
002	530	003	Siefore Básica Tres	Siefore XXI Banorte Desarrolla, S.A. de C.V.
002	534	003	Siefore Básica Tres	Fondo Profuturo SB3, S.A. de C.V., Siefore
002	538	003	Siefore Básica Tres	Principal Siefore 3, S.A. de C.V.
002	544	003	Siefore Básica Tres	Siefore SURA Básica 3, S.A. de C.V.
002	550	003	Siefore Básica Tres	Inbursa Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	552	003	Siefore Básica Tres	Siefore Banamex Básica 3, S.A. de C.V.
002	556	003	Siefore Básica Tres	Siefore Azteca Básica 3, S.A. de C.V.
002	562	003	Siefore Básica Tres	Siefore Invercap III, S. A. de C. V.
002	564	003	Siefore Básica Tres	Met3 Siefore Básica, S. A. de C. V.
002	568	003	Siefore Básica Tres	Siefore Coppel Básica 3, S.A. de C.V.
002	578	003	Siefore Básica Tres	Más Pensión Siefore Básica 3, S.A. de C.V.
002	530	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore XXI Banorte Crece, S.A. de C.V.
002	534	004	Siefore Básica Cuatro	Fondo Profuturo SB4, S.A. de C.V., Siefore
002	538	004	Siefore Básica Cuatro	Principal Siefore 4, S.A. de C.V.
002	544	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore SURA Básica 4, S.A. de C.V.
002	550	004	Siefore Básica Cuatro	Inbursa Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
002	552	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Banamex Básica 4, S.A. de C.V.
002	556	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Azteca Básica 4, S.A. de C.V.
002	562	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Invercap IV, S. A. de C. V.
002	564	004	Siefore Básica Cuatro	Met4 Siefore, S. A. de C. V.
002	568	004	Siefore Básica Cuatro	Siefore Coppel Básica 4, S.A. de C.V.
002	578	004	Siefore Básica Cuatro	Más Pensión Siefore Básica 4, S.A. de C.V.
003	334	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
003	364	001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	MetA Siefore Adicional, S.A. de C.V.
004	430	001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias, S.A. de C.V.
017	652	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO****Políticas a seguir en la transmisión de la información**

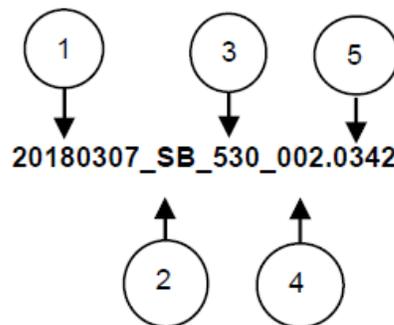
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "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 (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0342"</b> .

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

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



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

**20180307\_SB\_530\_002.0342.gpg**

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

**A20180307\_SB\_530\_002.0342**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

