

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFCRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

### DESCRIPCIÓN DEL FORMATO

<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene información del desglose de operaciones con instrumentos financieros derivados (Forwards, Futurs, Opciones y Swaps).			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	565	07:00 a 10:00 Hrs.

### ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "565". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0314". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3 0	16 18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3 0	19 21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	3 0	22 24	Clave de Subtipo de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8 0	25 32	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	533 0	33 565	Vacios. <sup>6</sup>

### DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9 0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4 0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7 0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6 0	43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>6</sup>
8	Consecutivo		AN	10 0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3 0	59 61	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Tipo de Operación		N	3 0	62 64	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
11	Subyacente		AN	18	0 65 82	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
12	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 83 85	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del activo subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
13	Divisa de Liquidación		N	2	0 86 87	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Plazo de referencia		N	4	0 88 91	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
15	Fecha de operación		F	8	0 92 99	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
16	Fecha de inicio		F	8	0 100 107	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor o no. <sup>3</sup>
17	Fecha de liquidación		F	8	0 108 115	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
18	Fecha de Vencimiento		F	8	0 116 123	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
19	Tamaño del contrato		N	14	2 124 139	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
20	Número de contratos		N	14	0 140 153	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 154 156	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Precio o Tasa pactada		N	14	7 157 177	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
23	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0 178 183	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones a 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>
24	Entrega física o diferenciales		AN	1	0 184 184	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
25	Tipo de Valor del Cheapest to Deliver		AN	4	0 185 188	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
26	Emisora del Cheapest to Deliver		AN	7	0 189 195	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFCRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
27	Serie del Cheapest to Deliver		AN	6	0 196 201	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
28	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6 202 210	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>4</sup>
29	Medio de Concertación		N	1	0 211 211	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
30	Contraparte		N	8	0 212 219	Se registrará el Identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
31	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0 220 239	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
32	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0 240 242	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
33	Calificación primera	contraparte	N	4	0 243 246	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
34	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0 247 249	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación segunda	contraparte	N	4	0 250 253	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>
36	Observaciones y características especiales		AN	150	0 254 403	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
37	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0 404 423	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
38	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 424 437	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
39	Socio Operador		N	8	0 438 445	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
40	Socio Liquidador		N	8	0 446 453	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
41	Folio para estrategia con derivados	🔑	N	14	0	454 467	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrán agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
42	Espacios en blanco		AN	98	0	468 565	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones	
1	Tipo de Registro	🔑	N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ISIN	🔑	AN	12	0	4 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins	🔑	AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol	🔑	AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor	🔑	AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora	🔑	AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie	🔑	AN	6	0	43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
8	Consecutivo	🔑	AN	10	0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3	0	59 61	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Tipo de Operación		N	3	0	62 64	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	65 72	Se deberá anotar el Identificador de la Bolsa de derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>
12	Subyacente		AN	18	0	73 90	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 definían el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
13	Divisa de Liquidación		N	2	0	91 92	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>



## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
33	Folio para cobertura de divisas		N	14	390 403	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
34	Socio Operador		N	8	404 411	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
35	Socio Liquidador		N	8	412 419	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
36	Folio para estrategia con derivados		N	14	420 433	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
37	Espacios en blanco		AN	132	434 565	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 la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que coice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3	0	59 61	Se registrará el Identificador 1 ó 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
10	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0 62 69	En el caso que la opción se realice en una Bolsa de derivados se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>
11	Tipo de opción		N	3	0 70 72	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
12	Subclase de opción		N	3	0 73 75	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
13	Entrega física o diferenciales		AN	1	0 76 76	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
14	Subyacente		AN	18	0 77 94	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 definen el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
15	Divisa de Liquidación		N	2	0 95 96	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
16	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 97 99	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del activo subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
17	Plazo de referencia		N	4	0 100 103	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. <sup>1</sup>
18	Fecha de la operación		F	8	0 104 111	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
19	Fecha de inicio		F	8	0 112 119	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
20	Fecha de Liquidación		F	8	0 120 127	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
21	Fecha de Vencimiento		F	8	0 128 135	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
22	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0 136 143	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3</sup>
23	Tipo de operación		N	3	0 144 146	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
24	Tamaño del contrato		N	14	2 147 162	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
25	Número de contratos		N	14	0 163 176	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
26	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	3	0 177 179	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6 180 194	Se deberá anotar el strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
28	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6 195 209	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
29	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6 210 224	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Data	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
30	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	225 230	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>
31	Prima Pactada		N	14	6	231 250	Se deberá anotar el monto de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
32	Contraparte		N	8	0	251 258	Identificador de la Contraparte en caso de que la opción se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	259 278	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
34	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	279 281	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 primera	contraparte	N	4	0	282 285	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
36	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	286 288	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.
37	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	289 292	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
38	Observaciones características especiales	y	AN	150	0	293 442	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
39	Medio de Concertación		N	1	0	443 443	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
40	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	444 463	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
41	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	464 471	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura <sup>2</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
42	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 472 485	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
43	Socio Operador		N	8	0 486 493	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
44	Socio Liquidador		N	8	0 494 501	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
45	Folio para estrategia con derivados		N	14	0 502 515	Se deberá reportar ceros de manera constante. <sup>1</sup>
46	Espacios en blanco		AN	50	0 516 565	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12 0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9 0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7 0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4 0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7 0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6 0	43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10 0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Estatus de operación		N	3 0	59 61	Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
10	Fecha de operación		F	8 0	62 69	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
11	Fecha de inicio		F	8 0	70 77	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
12	Número de cupón vigente a entregar		N	3 0	78 80	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. <sup>1</sup>
13	Número de cupón vigente a recibir		N	3 0	81 83	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. <sup>1</sup>
14	Fecha de próxima liquidación a entregar		F	8 0	84 91	Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo. <sup>3</sup>
15	Fecha de próxima liquidación a recibir		F	8 0	92 99	Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo. <sup>3</sup>
16	Plazo de referencia a entregar		N	4 0	100 103	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. <sup>1</sup>
17	Plazo de referencia a recibir		N	4 0	104 107	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. <sup>1</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Data	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
18	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	108	110	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>
19	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	111	113	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>
20	Número de cupones a entregar		N	3	0	114	116	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. <sup>1</sup>
21	Número de cupones a recibir		N	3	0	117	119	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. <sup>1</sup>
22	Valor notional		N	14	6	120	139	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). <sup>2</sup>
23	Valor notional 2		N	14	6	140	159	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). <sup>2</sup>
24	Tipo de cambio pactado		N	12	6	160	177	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
25	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	178	183	En caso de que las divisas asociadas a los notacionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al notional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al notional a recibir, según el catálogo de divisas. En caso contrario, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones la divisa asociada a ambos notacionales. <sup>5</sup>
26	Divisa del notional a entregar		N	3	0	184	186	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Divisa del notional a recibir		N	3	0	187	189	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
28	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>
29	Subyacente a entregar		AN	18	0	192	209	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 definían 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 cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
30	Subyacente a recibir		AN	18	0	210	227	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 definían 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 cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
31	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	228	233	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
32	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	234	239	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
33	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	240	255	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
34	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	256	271	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
35	Sobretasa a entregar		N	3	2	272 276	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
36	Sobretasa a recibir		N	3	2	277 281	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
37	Tipo tasa a entregar		N	3	0	282 284	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
38	Tipo tasa a recibir		N	3	0	285 287	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
39	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	288 297	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
40	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	298 307	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
41	Amortiza Capital		N	1	0	308 308	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
42	Tipo de intercambios		N	3	0	309 311	Se registrará el identificador correspondiente según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
43	Contraparte		N	8	0	312 319	Se registrará el Identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
44	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	320 339	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
45	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	340 342	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>
46	Calificación contraparte primera		N	4	0	343 346	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
47	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	347 349	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>
48	Calificación contraparte segunda		N	4	0	350 353	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" en el concepto "Calificación contraparte segunda". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
49	Medio de Concertación		N	1	0	354 354	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
50	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	355 374	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

**DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
51	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 375 388	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
52	Observaciones y características especiales		AN	117	0 389 505	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>
53	Socio Operador		N	8	0 506 513	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
54	Socio Liquidador		N	8	0 514 521	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
55	Folio para estrategia con derivados		N	14	0 522 535	Se deberá reportar ceros de manera constante. <sup>1</sup>
56	Espacios en blanco		AN	30	0 536 565	Vacios. <sup>6</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
				Ent. Dec.	De: A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0 1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0 4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0 16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0 25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0 32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporciona el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0 36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporciona el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0 43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0 49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
9	Tipo de Cupón		N	1	0 59 59	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. <sup>1</sup>
10	Numero de Cupón		N	3	0 60 62	Comenzando con el cupón vigente. <sup>1</sup>
11	Fecha Inicio		F	8	0 63 70	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. <sup>3</sup>
12	Fecha Final		F	8	0 71 78	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. <sup>3</sup>
13	Días de cupón		N	3	0 79 81	Días de cupón. <sup>1</sup>
14	Monto de referencia para amortizar		N	14	6 82 101	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor notional. <sup>2</sup>
15	Nocional		N	14	6 102 121	Se deberá anotar el monto del valor notional del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. <sup>2</sup>

## Anexo 77

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

**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	
16	Subyacente		AN	18	0	122 139	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie de un bien en específico si éste existe cotizando en el mercado, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
17	Sobretasa		N	3	2	140 144	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. <sup>2</sup>
18	Observaciones Características Especiales <sup>0</sup>		AN	50	0	145 194	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
19	Fecha Inicial de Vigencia del cupón		F	8	0	195 202	Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
20	Fecha Final de Vigencia del cupón		F	8	0	203 210	Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
21	Espacios en blanco		AN	355	0	211 565	Vacios. <sup>6</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306". <sup>1</sup>
2	Tipo Garantía		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el identificador de la garantía que corresponda según el catálogo de Tipo de Garantía. <sup>1</sup>
3	ISIN de la Garantía		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
4	Cusip o Cins de la Garantía		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
5	Sedol de la Garantía		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
6	Tipo de Valor de la Garantía		AN	4	0	33	36	Se deberá anotar la Clave del Tipo de Valor según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
7	Emisora de la Garantía		AN	7	0	37	43	Se deberá anotar la Emisora según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
8	Serie de la Garantía		AN	7	0	44	50	Se deberá anotar la serie según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
9	Consecutivo de la Garantía		AN	10	0	51	60	Indicador consecutivo del instrumento según la clasificación de instrumentos de la BMV. Si es efectivo o Threshold se llenará con ceros. <sup>5</sup>
10	Contraparte de la Garantía		N	8	0	61	68	Identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones	
11	Número de títulos		N	14	0	69	82	Se deberá anotar el número de títulos respecto de la garantía recibida o entregada, en el caso de efectivo o Threshold se solicitará 1 título. <sup>1</sup>
12	Valor Unitario a Mercado		N	9	6	83	97	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
13	Valor de mercado en pesos de la garantía		N	14	6	98	117	Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado con respecto a los precios del proveedor de precios y en su caso al tipo de cambio fix vigente a la fecha de envío, en el caso de efectivo en pesos, se anotará únicamente el monto dejado en garantía. En caso de Threshold se deberá enviar cero. <sup>1</sup>
14	Intereses Devengados		N	14	2	118	133	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
15	Threshold		N	9	0	134	142	Se deberá anotar el monto umbral establecido por la contraparte en la moneda pactada en caso de Threshold, cero en otro caso. <sup>1</sup>
16	Divisa del Threshold		N	2	0	143	144	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas en caso de Threshold, "1" en otro caso. <sup>1</sup>
17	Manejo Garantías Instrumentos		N	1	0	145	145	Se deberá registrar 1 si el contrato ISDA prevé manejo de garantías con instrumentos financieros. De lo contrario se deberá reportar con ceros. <sup>1</sup>
18	Espacios en blanco		AN	420	0	146	565	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent. Dec.	Posición	De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. 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 la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>6</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0	60	62	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFÓRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
11	Tipo de Operación		N	3	0 63 65	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1- Largo 2- Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
12	Subyacente		AN	18	0 66 83	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotiche en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
13	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 84 86	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del activo subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
14	Divisa de Liquidación		N	2	0 87 88	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
15	Plazo de referencia		N	4	0 89 92	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. <sup>1</sup>
16	Fecha de operación		F	8	0 93 100	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
17	Fecha de inicio		F	8	0 101 108	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
18	Fecha de Vencimiento		F	8	0 109 116	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
19	Tamaño del contrato		N	14	2 117 132	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
20	Número de contratos		N	14	0 133 146	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
21	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 147 149	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7 150 170	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
23	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7 171 191	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
24	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2 192 207	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFCRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	208 213	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	214 214	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
27	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	215 218	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
28	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	219 225	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
29	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	226 231	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	232 240	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>4</sup>
31	Medio de Concertación		N	1	0	241 241	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico. 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
32	Contraparte		N	8	0	242 249	Se registrará el Identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	250 269	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
34	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	270 272	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación primera	contraparte	N	4	0	273 276	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
36	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	277 279	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	280 283	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	284 433	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	434 453	Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 454 467	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
41	Socio Operador		N	8	0 468 475	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
42	Socio Liquidador		N	8	0 476 483	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
43	Folio para estrategia con derivados		N	14	0 484 497	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
44	Espacios en blanco		AN	68	0 498 565	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
				Ent. Dec.	De: A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0 1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "308". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0 4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. 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 la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0 26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0 33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0 37 43	Clave de la Emisora del instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0 44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato asmmdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0 50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0 60 62	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación) Anexo 1

## Anexo 77

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
11	Tipo de Operación		N	3	0 63 65	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0 66 73	Se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes. <sup>1</sup>
13	Subyacente		AN	18	0 74 91	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 definían el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
14	Divisa de Liquidación		N	2	0 92 93	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
15	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0 94 96	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del activo subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
16	Plazo de referencia		N	4	0 97 100	En caso de que el Future 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. <sup>1</sup>
17	Fecha de operación		F	8	0 101 108	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
18	Fecha de inicio		F	8	0 109 116	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>
19	Fecha de Vencimiento		F	8	0 117 124	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
20	Tamaño del contrato		N	14	2 125 140	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
21	Número de contratos		N	14	0 141 154	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
22	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0 155 157	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
23	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7 158 178	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>
24	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7 179 199	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>
25	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2 200 215	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>

## Anexo 77

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

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS)							
Id	Concepto	Data	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
26	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	216 221	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>
27	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	222 222	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
28	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	223 226	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>
29	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	227 233	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>
30	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	234 239	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>
31	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	240 248	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>1</sup>
32	Observaciones y características especiales		AN	150	0	249 398	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>
33	Medio de Concertación		N	1	0	399 399	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1= Telefónico. <sup>1</sup> 2= Electrónico. <sup>1</sup>
34	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	400 419	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
35	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	420 433	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
36	Socio Operador		N	8	0	434 441	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
37	Socio Liquidador		N	8	0	442 449	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>

## Anexo 77

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
38	Folio para estrategia con derivados	🔑	N	14	0	450 463	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
39	Espacios en blanco		AN	102	0	464 565	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 la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol	🔑	AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor	🔑	AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora	🔑	AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie	🔑	AN	6	0	44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>5</sup>
9	Consecutivo	🔑	AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo 1
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	63 70	En el caso que la opción se realice en una Bolsa de Derivados se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados donde se operó el instrumento derivado conforme al Identificador del catálogo de contrapartes, en caso contrario, se llenará con ceros. <sup>1</sup>
12	Tipo de opción		N	3	0	71 73	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
13	Subclase de opción		N	3	0	74 76	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
14	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	77 77	"F" cuando la naturaleza del contrato sea por entrega física y "D" cuando la naturaleza sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
15	Subyacente		AN	18	0 78 95	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del Subyacente si éste existe cotizando en el mercado, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres de alguno de los tres aspectos que definirán el nombre del subyacente se dejarán los espacios en blanco entre campo y campo para iniciar enseguida el otro campo. Para el caso de Derivados sobre Vehículos referenciados a índices Accionarios, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al vehículo. En caso de que el subyacente no cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>2</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0 96 97	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 98 100	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del activo subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia a la forma de cotizar. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia		N	4	0 101 104	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 tono. <sup>1</sup>
19	Fecha de la operación		F	8	0 105 112	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>1</sup>
20	Fecha de inicio		F	8	0 113 120	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
21	Fecha de Vencimiento		F	8	0 121 128	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
22	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0 129 136	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3</sup>
23	Tipo de operación		N	3	0 137 139	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>
24	Tamaño del contrato		N	14	2 140 155	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
25	Número de contratos		N	14	0 156 169	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
26	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0 170 171	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7 172 192	Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
28	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7 193 213	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>
29	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2 214 229	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>
30	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6 230 244	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
31	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6 245 259	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	6 260 274	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
33	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	275 280	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 a 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	281 300	Se deberá anotar el monto de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
35	Contraparte		N	8	0	301 308	Identificador de la Contraparte en caso de que la opción se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
36	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	309 328	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
37	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	329 331	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>
38	Calificación contraparte primera		N	4	0	332 335	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
39	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	336 338	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>
40	Calificación contraparte segunda		N	4	0	339 342	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
41	Observaciones y características especiales		AN	150	0	343 492	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	493 493	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	494 513	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
44	Delta calculada con fines de cobertura		N	2	6	514 521	Delta calculada por el área de inversiones y riesgos con fines de cobertura. <sup>2</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

**DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
45	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 522 535	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
46	Socio Operador		N	8	0 536 543	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
47	Socio Liquidador		N	8	0 544 551	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Folio para estrategia con derivados		N	14	0 552 565	Se deberá reportar ceros de manera constante. <sup>1</sup>

**DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0 1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". <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 la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0 26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0 33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0 37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0 44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que coticen en un mercado organizado. <sup>5</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0 50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>5</sup>
10	Estatus de operación		N	3	0 60 62	Se registrará el Identificador 1, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo 1
11	Fecha de operación		F	8	0 63 70	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
12	Fecha de inicio		F	8	0 71 78	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. <sup>3</sup>
13	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0 79 81	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. <sup>1</sup>
14	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0 82 84	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. <sup>1</sup>
15	Plazo de referencia a entregar		N	4	0 85 88	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. <sup>1</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFCRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
16	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	89 92	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. <sup>1</sup>
17	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	93 95	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>
18	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	96 98	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. <sup>1</sup>
19	Número de cupones a entregar		N	3	0	99 101	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. <sup>1</sup>
20	Número de cupones a recibir		N	3	0	102 104	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. <sup>1</sup>
21	Valor notional		N	14	6	105 124	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). <sup>2</sup>
22	Valor notional 2		N	14	6	125 144	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). <sup>2</sup>
23	Tipo de cambio pactado		N	12	6	145 162	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
24	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	163 168	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para notacionales, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir según el catálogo de divisas. En caso de que ambas divisas sean iguales se deberá registrar las tres primeras posiciones. <sup>5</sup>
25	Divisa del notional a entregar		N	2	0	169 170	Se registrará el identificador de la divisa del notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Divisa del notional a recibir		N	2	0	171 172	Se registrará el identificador de la divisa del notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
27	Divisa de Liquidación		N	2	0	173 174	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
28	Subyacente a entregar		AN	18	0	175 192	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 cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
29	Subyacente a recibir		AN	18	0	193 210	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 cotice en el mercado, se utilizará el catálogo de Tipo de Valor, Emisora y Serie de subyacentes de derivados que presente el proveedor de precios. <sup>5</sup>
30	Divisa del subyacente a entregar		AN	3	0	211 213	Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
31	Divisa del subyacente a recibir		AN	3	0	214 216	Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
32	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	217 232	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>
33	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	233 248	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación. <sup>2</sup>

## Anexo 77

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

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
34	Sobretasa a entregar		N	3	249 253	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
35	Sobretasa a recibir		N	3	254 258	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. <sup>2</sup>
36	Tipo tasa a entregar		N	3	259 261	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
37	Tipo tasa a recibir		N	3	262 264	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. <sup>1</sup>
38	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	265 274	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
39	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	275 284	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa. <sup>5</sup>
40	Amortiza Capital		N	1	285 285	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
41	Tipo de intercambios		N	3	286 288	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
42	Contraparte		N	8	289 296	Se registrará el Identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
43	Nombre corto de la contraparte		AN	20	297 316	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. <sup>5</sup>
44	Calificadora Contraparte primera		N	3	317 319	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>
45	Calificación contraparte primera		N	4	320 323	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esa deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
46	Calificadora Contraparte segunda		N	3	324 326	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>
47	Calificación contraparte segunda		N	4	327 330	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esa deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
48	Medio de Concertación		N	1	331 331	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1= Telefónico 2= Electrónico. <sup>1</sup>
49	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	332 351	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
50	Folio para cobertura de divisas		N	14	0 352 365	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la administradora. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
51	Observaciones características especiales	y	AN	117	0 366 482	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>2</sup>
52	Socio Operador		N	8	0 483 490	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Operador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
53	Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición		N	14	7 491 511	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
54	Monto Neto liquidado al cierre de la posición		N	14	2 512 527	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>
55	Socio Liquidador		N	8	0 528 535	En el caso de ser un derivado listado se deberá anotar el identificador del Socio Liquidador siempre que éste exista, a través del cual se realizó la operación conforme al catálogo de contrapartes, en caso contrario reportar con ceros. <sup>1</sup>
56	Folio para estrategia con derivados		N	14	0 536 549	Se deberá reportar ceros de manera constante. <sup>1</sup>
57	Espacios en blanco		AN	16	0 550 565	Vacios. <sup>6</sup>

### CATALOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL

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

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)	
Clave de Entidad	Descripción
654	BANCOMER

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

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

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

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFÓRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

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

## Anexo 77

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

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

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

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

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

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

Catálogo de Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Clasificadora de Riesgos, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México SA. de C.V.	HR Ratings

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

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

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>				
AAA (mex)	Aaamx	mxAAA	HR AAA	1000
AA+ (mex)	Aa1mx	mxAA+	HR AA+	1001
AA (mex)	Aa2mx	mxAA	HR AA	1002
AA- (mex)	Aa3mx	mxAA-	HR AA-	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	1009
BB+ (mex)	Ba1mx	mxBB+	HR BB+	1010
BB (mex)	Ba2mx	mxBB	HR BB	1011
BB- (mex)	Ba3mx	mxBB-	HR BB-	1012
B+ (mex)	B1.mx	mxB+	HR B+	1013
B (mex)	B2.mx	mxB	HR B	1014
B- (mex)	B3.mx	mxB-	HR B-	1015
CCC+ (mex)	Caal.mx	mxCCC+	HR C+	1016
CCC (mex)	Caa2.mx	mxCCC		1017
CCC- (mex)	Caa3.mx	mxCCC-		1018
CC (mex)	Ca.rmx	mxCC	HR C	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-	1020

## Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
D (mex)		mxD	HR D	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>				
F1+ (mex)	MX-1	mxA-1+	HR+1	1022
F1 (mex)	MX-2	mxA-1	HR1	1023
F2 (mex)	MX-3	mxA-2	HR2	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	1025
B (mex)	MX-4	mxB	HR4	1026
C (mex)		mxC	HR5	1027
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>				
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)	1032
A	A2	A	HR A (G)	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)	1041
B	B2	B	HR B (G)	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)	1044
CCC	Caa2	CCC		1045
CCC-	Caa3	CCC-		1046
CC	Ca	CC	HR C (G)	1047
C	C	C	HR C- (G)	1048
D	D	D	HR D (G)	1049
<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

## Anexo 77

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
B			HR4 (G)	1054
C			HR5 (G)	1055

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

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080020	Valores Finamex International Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080021	Finamex Securities Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080022	Valores Finamex Limited
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080023	Interacciones Global Incorporated
013006	HSBC Casa de Bolsa	080024	Inter-Financial Services, Limited
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080025	Monex Securities Incorporated
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finamex Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013013	IXE Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080030	Akka International, Cop.
013018	Casa de Bolsa Akka	080031	BBVA Bancomer Asst Management, Inc.
013019	Value Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013020	Adinver Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013021	Monex Casa de Bolsa	080034	Banorte I, LLC.
013026	Vector Casa de Bolsa	080037	Invex International, S.A.
013027	Casa de Bolsa Banorte	080038	Invex Worldwide, S.A.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013041	Invex Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana,

## Anexo 77

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
			Cuba.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013120	UBS Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013121	Prtego Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013124	Intercom Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	Bull Tick Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	082035	Confía Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	082037	Creml Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofimec, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	082049	Bancomer Sucursal en Houston
016408	By B Casa de Cambio	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016419	Finanex Casa de Cambio	700000	Otros Bancos Extranjeros
016507	Casa de Cambio Tambe	701000	ABN Amro Bank (Estranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701001	Abasis
016587	Sterling Casa de Cambio	701002	American Express (Estranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Estranjero)

## Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



**FORMATO DEL ARCHIVO :** 0314  
**FUENTE :** SIEFÓRES

**PROCESO :** FINANCIERO  
**ACTUALIZACIÓN :**

### Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
016712	Intercan Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016719	Unica Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701010	Bank One (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701011	Banque Paribas (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701013	Bear Stearns (Extranjero)
025014	Fujos por pago de cupón odividendo	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701017	Citibank (Extranjero)
037135	Nacional Financiera	701018	Comerica Bank (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701019	Commerzbank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Invex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca Afime	701037	National Westminster Bank (Natvest) (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040106	Bank of America México	701041	Societe Generale (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701042	Solomon Brothers (Extranjero)

## Anexo 77

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040110	Banco J.P. Morgan	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040112	Banco Monex	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040113	Banco Ve por Más	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040116	ING Bank (México)	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701048	Union Bank (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701049	Westdeutsche Landesbank Girozentrale (Extranjero)
040128	Banco Autofin México	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040129	Barclays Bank México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040130	Banco Compartamos	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapore Stock Exchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelarte	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity Exchange Incorporated – New York
040137	BanCoppel	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040138	Banco Amigo	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancoentro) de Costa Rica (Extranjero)
040139	UBS Bank México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040140	Banco Fáci		
040141	Volkswagen Bank	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040142	El Banco Deuno	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040143	Consultoría Internacional Banco	801152	Citi Bank N.A. New York Offices
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801153	Pershing Inc.
040145	Banco Base	801154	Calyon Financial Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076000	Otros Operadores	801157	Segregación de Instrumentos
076001	Derfin	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076008	Stock & Price	801159	Reclasificaciones
076010	Sotia Inverlat Derivados	801160	Acciones Propias
076014	García Madias, Araneda y Asociados GAMA Derivados	801161	Cortes Transversales
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Seraf)	801162	Bank West
076022	Darka	801163	Bcpbank Canada
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801164	Bridgewater Bank
076043	Timber Hill LLC.	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce

## Anexo 77

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
076044	Enlace Derivados	801166	Canadian Tire Bank
076048	Intercam Derivados	801167	Canadian Western Bank
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801168	Citizens Bank Of Canada
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801169	Cs Alterna Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada
079005	Interrex Holding, S.A.- Luxemburgo	801171	First Nations Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited.-Islas Caimán	801172	General Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801173	Laurentian Bank Of Canada
079010	California Commerce Bank.-California, E.U.A.	801174	Manulife Bank Of Canada
079012	Banamex-Adical Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079013	Banamex-Adical International Fund Plc.- República de Irlanda	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079014	Serfin International Bank and Trust – Islas Caimán	801177	Wachovia Bank N.A.
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079016	BI. Financial Holdings Ltd.-Islas Caimán	801179	Us Bank N.A.
079017	BI. Bank and Trust.- Islas Caimán	801180	Surtrust Bank
079018	BI. Remittances Company.-Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801183	Regions Bank
079024	CITX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801184	National City Bank
079025	Nacional Financiera S.N.C. Natinsa Holdings Corp.	801185	Branch Bkg & TC
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801186	State Street B&TC
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801187	Countrywide Bank N.A.
079028	BBVA Bancomer USA	801188	Pnc Bank N.A.
079029	Dinero Express	801189	Keybank N.A.
079030	Banorte USA Corporation	801190	Lasalle Bank N.A.
079031	INB Financial Corp.	801191	North Fork Bank
079032	INB Delaware Corporation	801192	Manufacturers & Traders Tc
079033	Inter Nacional Bank	801193	Bank Of The West
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801194	Fifth Third Bank
080001	Axci Securities Incorporated	801195	Northern TC
080004	Ain Securities International Limited	801196	Goldman Sachs Paris
080005	Aika Securities Incorporated	900000	Otros mandatarios
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.		
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation		
080013	Vectormex Incorporated		
080014	Vectormex Global Advisors Incorporated		
080015	Vectormex International Incorporated		

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFÓRES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
080019	Valores Finamex Corporation, Inc.		

### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

<sup>2</sup> Dato numérico con decimal (cantidades monetarias). Debe estar justificado a la derecha; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con ceros. Se omiten signo de pesos, comas y puntos decimales. Si la cantidad es negativa el signo ocupará la 1ª posición de la izquierda, para el caso de ser positivo indicar la 1ª posición será 0.

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

## Anexo 77

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

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.

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

### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

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

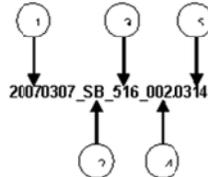
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo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

## Anexo 77

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0314 <b>FUENTE :</b> SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

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



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

**20070307\_SB\_516\_0020314.gpg**

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

**A20070307\_SB\_516\_0020314**

**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 reglas de envío a CONSAR para producción serán:

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