

Anexo 77

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

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
19	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	109	111	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. ¹
20	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	112	114	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. ¹
21	Número de cupones a entregar		N	3	0	115	117	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. ¹
22	Número de cupones a recibir		N	3	0	118	120	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. ¹
23	Valor notional		N	14	6	121	140	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). ²
24	Valor notional 2		N	14	6	141	160	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). ²
25	Tipo de cambio pactado		N	12	6	161	178	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. ²
26	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	179	184	En caso de que las divisas asociadas a los notacionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al notional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al notional a recibir, según el catálogo de divisas. En caso contrario, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones la divisa asociada a ambos notacionales. ⁵
27	Divisa del notional a entregar		N	3	0	185	187	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Divisa del notional a recibir		N	3	0	188	190	Se registrará el identificador de la divisa asociada al notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. ¹
29	Divisa de Liquidación		N	2	0	191	192	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que entregará la Siefore. ¹
30	Subyacente a entregar		AN	18	0	193	210	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
31	Subyacente a recibir		AN	18	0	211	228	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
32	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	229	234	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas. ⁵
33	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	235	240	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas. ⁵
34	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	241	256	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. ²

Anexo 77

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

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

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

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

Anexo 77

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
61	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	599 618	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
62	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	619 632	Se deberá reportar ceros de manera constante. ¹
63	Espacios en blanco		AN	21	0	633 653	Vacíos. ⁶

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305" . ¹
2	ISIN		AN	12	0	4 15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16 24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
4	Sedol		AN	7	0	25 31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo Valor		AN	4	0	32 35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Serie		AN	6	0	43 48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	49 58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁶
9	Tipo de Cupón		N	1	0	59 59	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. ¹
10	Numero de Cupón		N	3	0	60 62	Comenzando con el cupón vigente. ¹
11	Fecha Inicio		F	8	0	63 70	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. ³
12	Fecha Final		F	8	0	71 78	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. ³
13	Días de cupón		N	3	0	79 81	Días de cupón. ¹
14	Monto de referencia para amortizar		N	14	6	82 101	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor nominal. ²
15	Nocional		N	14	6	102 121	Se deberá anotar el monto del valor nominal del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. ²
16	Subyacente		AN	18	0	122 139	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
17	Sobretasa		N	3	2	140 144	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. ²
18	Observaciones Características Especiales	⁰	AN	50	0	145 194	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵

Anexo 77

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

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

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

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MINIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS.

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

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

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS Y APORTACIONES INICIALES MINIMAS PARA EL CASO DE DERIVADOS LISTADOS.

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

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

Anexo 77

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

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

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "307". ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4 4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5 16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17 25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26 32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33 36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37 43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
8	Serie		AN	6	0	44 49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60 62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹

Anexo 77

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

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

Anexo 77

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

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. ⁵
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	214 214	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega.
27	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	215 218	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
28	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	219 225	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. ⁵
29	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	226 231	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	232 240	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. ²
31	Medio de Concertación		N	1	0	241 241	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
32	Contraparte		N	8	0	242 249	Identificador de la Contraparte en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	250 269	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
34	Calificadora primera	Contraparte	N	3	0	270 272	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
35	Calificación primera	contraparte	N	4	0	273 276	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso contrario reportar ceros. ¹
36	Calificadora segunda	Contraparte	N	3	0	277 279	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
37	Calificación segunda	contraparte	N	4	0	280 283	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En caso contrario reportar ceros. ¹

Anexo 77

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

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	284 433	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	434 453	Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	454 467	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. ¹
41	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	468 475	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
42	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	476 495	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Socio Operador		N	8	0	496 503	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar ceros. ¹
44	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	504 523	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
45	Socio Liquidador		N	8	0	524 531	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹
46	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	532 551	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En caso contrario reportar vacío. ⁵
47	Cámara de Compensación		N	8	0	552 559	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso contrario reportar con ceros. ¹

Anexo 77

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent.	Dec.	Posición	De:	A:	Observaciones
48	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0		560	579		Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
49	Folio para estrategia con derivados		N	14	0		580	593		En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
50	Espacios en blanco		AN	60	0		594	653		Vacios. ⁶

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent.	Dec.	Posición	De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0		1	3		Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "308" . ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0		4	4		Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0		5	16		Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
4	Cusip o Cins		AN	9	0		17	25		Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
5	Sedol		AN	7	0		26	32		Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0		33	36		Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0		37	43		Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
8	Serie		AN	6	0		44	49		Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0		50	59		Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0		60	62		Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Tipo de Operación		N	3	0		63	65		Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. ¹
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0		66	73		Se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. ¹
13	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0		74	93		En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵

Anexo 77

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

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

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

Anexo 77

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
42	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	518	537	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	538	551	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico para todos los instrumentos que forman parte de la estrategia. En caso de disminuir o aumentar la posición en la estrategia se deberá generar un nuevo folio. No se podrá agregar o eliminar instrumentos en la estrategia con derivados. En tal caso formarán parte de una nueva estrategia con derivados. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. ¹
44	Espacios en blanco		AN	102	0	552	653	Vacios. ⁶

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". ¹
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ¹⁵
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60	62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	63	70	En caso de que la posición se encuentre listada en una Bolsa de Derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para esta Bolsa de Derivados. En caso contrario reportar ceros. ¹
12	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	71	90	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En caso contrario reportar vacío. ⁵
13	Tipo de opción		N	3	0	91	93	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. ¹

Anexo 77

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

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
14	Subclase de opción		N	3	0	94	96	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. ¹
15	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	97	97	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. ⁵
16	Subyacente		AN	18	0	98	115	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. ⁵
17	Divisa de Liquidación		N	2	0	116	117	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la Siefore, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. ¹
18	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	118	120	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. ¹
19	Plazo de referencia		N	4	0	121	124	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. ¹
20	Fecha de la operación		F	8	0	125	132	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
21	Fecha de inicio		F	8	0	133	140	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. ³
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	141	148	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. ³
23	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	149	156	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. ³
24	Tipo de operación		N	3	0	157	159	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. ¹
25	Tamaño del contrato		N	14	2	160	175	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. ²
26	Número de contratos		N	14	0	176	189	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. ²
27	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0	190	191	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	192	212	Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²

Anexo 77

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

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

Anexo 77

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

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

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

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310" . ¹

Anexo 77

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

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. ⁵
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁶
10	Estatus de operación		N	3	0	60	62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Fecha de operación		F	8	0	63	70	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
12	Fecha de inicio		F	8	0	71	78	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha y valor o no. ³
13	Tipo de Posición		N	1	0	79	79	En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una Bolsa de Derivados, y en la cual, la posición en relación al precio publicado en vector por el Proveedor de Precios sea corta, se deberá reportar 2. Se deberá reportar 1 en otro caso. ¹
14	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	80	82	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. ¹
15	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	83	85	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. ¹
16	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	86	89	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. ¹
17	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	90	93	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. ¹
18	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	94	96	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. ¹
19	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	97	99	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón, este campo debe ser con signo y dos cifras. ¹
20	Número de cupones a entregar		N	3	0	100	102	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar en la operación. ¹
21	Número de cupones a recibir		N	3	0	103	105	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir en la operación. ¹
22	Valor notional		N	14	6	106	125	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). ²
23	Valor notional 2		N	14	6	126	145	Se deberá anotar el monto del valor notional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). ²
24	Tipo de cambio pactado		N	12	6	146	163	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. ²
25	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	164	169	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para notacionales, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir según el catálogo de divisas. En caso de que ambas divisas sean iguales se deberá registrar las tres primeras posiciones. ⁵
26	Divisa del notional a entregar		N	2	0	170	171	Se registrará el identificador de la divisa del notional a entregar conforme al catálogo de Divisas. ¹
27	Divisa del notional a recibir		N	2	0	172	173	Se registrará el identificador de la divisa del notional a recibir conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	174	175	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que recibirá la Siefore. ¹

Anexo 77

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

Anexo 77

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

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
44	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	298	317	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En caso contrario reportar vacío. ⁵
45	Contraparte		N	8	0	318	325	Identificador de la Contraparte en caso de que el swap se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. ¹
46	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	326	345	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En caso contrario reportar vacío. ⁵
47	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	346	348	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
48	Calificación contraparte primera		N	4	0	349	352	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
49	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	353	355	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En caso contrario reportar ceros. ¹
50	Calificación contraparte segunda		N	4	0	356	359	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
51	Medio de Concertación		N	1	0	360	360	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. ¹
52	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	361	380	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
53	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	381	394	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
54	Observaciones características especiales	y	AN	117	0	395	511	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. ⁵

Anexo 77

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

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

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

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

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

Anexo 77

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

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

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

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

CATALOGO(S)

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

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

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Abreviación	Descripción
002	530	001	XXI BANORTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	534	001	PROFUTURO (SB1)	Siefore Básica Uno
002	578	001	PENSIONISSSTE (SB1)	Siefore Básica Uno
002	530	002	XXI BANORTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	534	002	PROFUTURO (SB2)	Siefore Básica Dos
002	578	002	PENSIONISSSTE (SB2)	Siefore Básica Dos
002	530	003	XXI BANORTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	534	003	PROFUTURO (SB3)	Siefore Básica Tres
002	578	003	PENSIONISSSTE (SB3)	Siefore Básica Tres
002	530	004	XXI BANORTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	534	004	PROFUTURO (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	578	004	PENSIONISSSTE (SB4)	Siefore Básica Cuatro
002	530	005	XXI BANORTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	534	005	PROFUTURO (SB5)	Siefore Básica Cinco
002	578	005	PENSIONISSSTE (SB5)	Siefore Básica Cinco
003	334	001	PROFUTURO (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
003	364	001	METLIFE (AC1)	Siefore Aportaciones Complementarias Uno
004	430	001	XXI BANORTE (PS1)	Siefore Previsión Social Uno
004	430	002	XXI BANORTE (PS2)	Siefore Previsión Social Dos
004	430	003	XXI BANORTE (PS3)	Siefore Previsión Social Tres
004	430	004	XXI BANORTE (PS4)	Siefore Previsión Social Cuatro
004	430	005	XXI BANORTE (PS5)	Siefore Previsión Social Cinco
004	430	006	XXI BANORTE (PS6)	Siefore Previsión Social Seis
004	430	007	XXI BANORTE (PS7)	Siefore Previsión Social Siete
004	430	008	XXI BANORTE (PS8)	Siefore Previsión Social Ocho
004	430	009	XXI BANORTE (PS9)	Siefore Previsión Social Nueve
004	430	010	XXI BANORTE (PS10)	Siefore Previsión Social Diez
004	430	011	XXI BANORTE (PS11)	Siefore Previsión Social Once
004	430	012	XXI BANORTE (PS12)	Siefore Previsión Social Doce
004	430	013	XXI BANORTE (PS13)	Siefore Previsión Social Trece
017	634	001	PROFUTURO (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	644	001	SURA (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	001	BANAMEX (AV 1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno
017	652	002	BANAMEX (AV 2)	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos
017	630	001	XXI BANORTE (AV1)	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno

Catálogo Aperturas y Cierres

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

Catálogo de Divisa

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi Chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	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).

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

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

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

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

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

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

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

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

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local				
AAA (mex)	Aaa.mx	mxAAA	HR AAA	1000
AA+ (mex)	Aa1.mx	mxAA+	HR AA+	1001

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
AA (mex)	Aa2.mx	mxAA	HR AA	1002
AA- (mex)	Aa3.mx	mxAA-	HR AA-	1003
A+ (mex)	A1.mx	mxA+	HR A+	1004
A (mex)	A2.mx	mxA	HR A	1005
A- (mex)	A3.mx	mxA-	HR A-	1006
BBB+ (mex)	Baa1.mx	mxBBB+	HR BBB+	1007
BBB (mex)	Baa2.mx	mxBBB	HR BBB	1008
BBB- (mex)	Baa3.mx	mxBBB-	HR BBB-	1009
BB+ (mex)	Ba1.mx	mxBB+	HR BB+	1010
BB (mex)	Ba2.mx	mxBB	HR BB	1011
BB- (mex)	Ba3.mx	mxBB-	HR BB-	1012
B+ (mex)	B1.mx	mxB+	HR B+	1013
B (mex)	B2.mx	mxB	HR B	1014
B- (mex)	B3.mx	mxB-	HR B-	1015
CCC+ (mex)	Caa1.mx	mxCCC+	HR C+	1016
CCC (mex)	Caa2.mx	mxCCC		1017
CCC- (mex)	Caa3.mx	mxCCC-		1018
CC (mex)	Ca.mx	mxCC	HR C	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-	1020
D (mex)		mxD	HR D	1021
Calificaciones Corto Plazo en Escala Local				
F1+ (mex)	MX-1	mxA-1+	HR+1	1022
F1 (mex)	MX-2	mxA-1	HR1	1023
F2 (mex)	MX-3	mxA-2	HR2	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	1025
B (mex)	MX-4	mxB	HR4	1026
C (mex)		mxC	HR5	1027
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global				
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)	1032
A	A2	A	HR A (G)	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)	1034

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

Catálogo de Tipo de Garantía	
Identificador	Descripción
1	Garantía otorgada por la SIEFORE en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados
2	Garantía recibida por la SIEFORE en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
002001	Banco de México	080020	Valores Finamex International Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080021	Finamex Securities Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080022	Valores Finamex Limited

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	080023	Interacciones Global Incorporated
013006	HSBC Casa de Bolsa	080024	Inter-Financial Services, Limited
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080025	Monex Securities Incorporated
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080026	Invex Incorporated
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080027	GBM International Incorporated
013012	Finamex Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013013	IXE Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013015	Interacciones Casa de Bolsa	080030	Arka International, Corp.
013018	Casa de Bolsa Arka	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013019	Value Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013020	Actinver Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013021	Monex Casa de Bolsa	080034	Banorte I, LLC.
013026	Vector Casa de Bolsa	080037	Invex International, S.A.
013027	Casa de Bolsa Banorte	080038	Invex Worldwide, S.A.
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	080041	Inbursa International, Inc.
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	080042	Inbursa Securities, Inc.
013041	Invex Casa de Bolsa	080043	IXE Holdings, Inc.
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
013120	UBS Casa de Bolsa	082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
013121	Protego Casa de Bolsa	082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
013122	Base Internacional Casa de Bolsa	082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa	082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
013124	Intercam Casa de Bolsa	082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
013125	Vanguardia Casa de Bolsa	082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
013126	BullTick Casa de Bolsa	082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	082035	Confía Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	082037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016035	Central de Divisas Casa de Cambio	082039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
016041	Casa de Cambio Tiber	082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
016044	Eurofimes, Casa de Cambio	082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
016067	Masari, Casa de Cambio	082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	082049	Bancomer Sucursal en Houston
016408	B y B Casa de Cambio	082050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
016419	Finamex Casa de Cambio	700000	Otros Bancos Extranjeros
016507	Casa de Cambio Tamibe	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
016533	Casa de Cambio Majapara	701001	Abasis
016587	Sterling Casa de Cambio	701002	American Express (Extranjero)
016629	Money Tron Casa de Cambio	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
016712	Intercam Casa de Cambio	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
016714	Order Express Casa de Cambio	701005	Bank Of America (Extranjero)
016715	Prodira, Casa de Cambio	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
016717	Imperial Casa de Cambio	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio	701008	Bank Of New York (Extranjero)
016719	Unica Casa de Cambio	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
025001	Bolsa Mexicana de Valores	701010	Bank One (Extranjero)
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores	701011	BNP Paribas (Extranjero)
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados	701012	Barclays Bank (Extranjero)
025013	Contraparte Central de Valores de México	701013	Bear Stearns (Extranjero)
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos	701016	Citi National Bank (Extranjero)
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada	701017	Citibank (Extranjero)

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
037135	Nacional Financiera	701018	Comerica Bank (Extranjero)
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros	701019	Commerzbank (Extranjero)
037168	Sociedad Hipotecaria Federal	701020	Controladora Prosa
040002	Banco Nacional de México	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
040012	BBVA Bancomer	701022	Credit Suisse (Extranjero)
040014	Banco Santander	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
040017	BBVA Bancomer Servicios	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
040021	HSBC México	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero	701026	Fortis Bank (Extranjero)
040030	Banco del Bajío	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
040037	Banco Interacciones	701030	Indosuez International (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701031	ING Bank (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
040059	Banco Irvex	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040060	Bansi	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040106	Bank of America México	701041	Societe Generale (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040110	Banco J.P. Morgan	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040112	Banco Monex	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040113	Banco Ve por Más	701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
040116	ING Bank (México)	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040124	Deutsche Bank México	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040126	Banco Credit Suisse México	701048	Union Bank (Extranjero)
040127	Banco Azteca	701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
040128	Banco Autofin México	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040129	Barclays Bank México	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040130	Banco Compartamos	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040131	Banco Ahorro Famsa	701053	NYSE (New York Stock Exchange)

Anexo 77



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040132	Banco Multiva	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040133	Banco Actinver	701059	Chicago Board Options Exchange – Chicago
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	701060	Mid America Commodity Exchange – Chicago
040136	Banco Regional	701061	Commodity Exchange Incorporated – New York
040137	BanCoppel	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040138	Banco Amigo	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040139	UBS Bank México	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040140	Banco Fácil	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040141	Volkswagen Bank	701276	Chicago Board of Trade
040142	El Banco Deuno	701277	Credit Agricole Corp
040143	Consultoría Internacional Banco	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040145	Banco Base	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
046048	Citibank (Banamex USA)	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801153	Pershing Inc.
076000	Otros Operadores	801154	Calyon Financial Inc.
076001	Derfin	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
076008	Stock & Price	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
076010	Scotia Inverlat Derivados	801157	Segregación de Instrumentos
076014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801159	Reclasificaciones
076022	Darka	801160	Acciones Propias
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801161	Cortes Transversales
076043	Timber Hill LLC.	801162	Bank West
076044	Enlace Derivados	801163	Bcpbank Canada
076048	Intercam Derivados	801164	Bridgewater Bank
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801166	Canadian Tire Bank
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801167	Canadian Western Bank
079005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo	801168	Citizens Bank Of Canada
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801169	Cs Alterna Bank
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801170	Dundee Bank Of Canada

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

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

Anexo 77

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

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

Anexo 77

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

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

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

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

POLITICAS GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

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

POLITICAS ESPECIFICAS DEL PROCESO

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuáles serán conforme a la Clave de Entidad Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFORES.

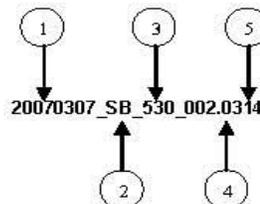
Anexo 77

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

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

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

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



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

20070307_SB_530_002.0314.gpg

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

A20070307_SB_530_002.0314

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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