

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

Anexo 77

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

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	434 453 Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. ⁵
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	454 467 En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la 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
48	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	560 579 Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵

Anexo 77

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

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
49	Folio para estrategia con derivados	*	N	14	0	580	593	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de forwards se deberá registrar un folio consecutivo definido por la 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	Posición	Observaciones		
				Ent. Dec.	De: A:			
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	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 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
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	Ent.	Dec.	Posición	De:	A:	Observaciones
42	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0		518		537	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En caso contrario reportar vacío. ⁵
43	Folio para estrategia con derivados		N	14	0		538		551	En caso de formar parte de una estrategia con cadenas de futuros se deberá registrar un folio consecutivo definido por la 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	Ent.	Dec.	Posición	De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0		1		3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". ¹
2	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. ¹⁶
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. ¹
27	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	2	0	190 191 Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. ¹
28	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	192 212 Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. ²

Anexo 77

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

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Daño	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 portener 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. ⁹
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.
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. ⁹
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	De:	A:	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 de la opción		N	2	6	534	541	Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes. 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	De:	A:	Observaciones

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		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "310". ¹
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 ₉ o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. ⁵
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. ¹⁵
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. ¹⁵
10	Estatus de operación		N	3	0	60	62	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. ¹
11	Fecha de operación		F	8	0	63	70	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. ³
12	Fecha de inicio		F	8	0	71	78	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha 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

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

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	
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
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. ⁴
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. ¹ 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

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
				Ent.	Dec.	De:	A:	
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
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		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "311". 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	Observaciones	
2	Contraparte		N	8	0	4 11	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. ¹
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. ¹
12	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas		N	1	0	59 59	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo I de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
13	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo II de divisas		N	1	0	60 60	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo II de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
14	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo III de divisas		N	1	0	61 61	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo III de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. ¹
15	Observaciones		AN	592	0	62 653	En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo "Tipo de Neteo", se deberán reportar características especiales relacionadas con la forma en la que se netean las posiciones para el cómputo de consumos de las líneas operativas establecidas en los contratos de derivados. ⁶

Anexo 77

	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
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	534	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	538	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	544	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	550	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	552	090	Siefore Básica de Pensiones	
002	556	090	Siefore Básica de Pensiones	

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

Anexo 77

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

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

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

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

Anexo 77



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

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

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

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

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

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

Catálogo de Tipos de Amortización	
Identificador	Descripción

Catálogo de Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación

Anexo 77

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

0	No amortiza	1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
1	Amortiza pata entrega	4	Clasificadora de Riesgos, S.A. de C.V.	FITCH
2	Amortiza pata recibir	5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
3	Amortiza ambas patas	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
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

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : SIEFORES

ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Calificaciones Homologadas				
Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
BBB (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
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

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314
FUENTE : SIEFORES

PROCESO : FINANCIERO
ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Calificaciones Homologadas

Fitch	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	Identificador
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	080025	Monex Securities Incorporated
013001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	080026	Invex Incorporated
013004	Casa de Bolsa Santander Serfin	080027	GBM International Incorporated
013005	Sotia Inverlat, Casa de Bolsa	080028	Foreign Holdings Ltd.
013006	HSBC Casa de Bolsa	080029	Portfolio Investment Incorporated
013007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	080030	Arka International, Corp.
013010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	080031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
013011	Multivalores Casa de Bolsa	080032	Banorte Asset Management, Inc.
013012	Finamex Casa de Bolsa	080033	Afin International Holdings, Inc.
013013	IXE Casa de Bolsa	080034	Banorte I, LLC.

Anexo 77

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción
013015	Interacciones Casa de Bolsa
013018	Casa de Bolsa Arka
013019	Value Casa de Bolsa
013020	AdInver Casa de Bolsa
013021	Monex Casa de Bolsa
013026	Vector Casa de Bolsa
013027	Casa de Bolsa Banorte
013032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa
013040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa
013041	Invex Casa de Bolsa
013104	ING Baring (México) Casa de Bolsa
013105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa
013106	Deutsche Securities Casa de Bolsa
013109	J.P. Morgan Casa de Bolsa
013114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
013117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa
013118	Casa de Bolsa Credit Suisse México
013119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa
013120	UBS Casa de Bolsa
013121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
013122	Base Internacional Casa de Bolsa
013123	Barclays Capital Casa de Bolsa
013124	Interam Casa de Bolsa
013125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
013126	Bull Tick Casa de Bolsa
013127	Masari Casa de Bolsa, S.A.
013129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
013130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
016031	Monex Divisas, S.A. de C.V.
080037	Invex Internacional, S.A.
080038	Invex Worldwide, S.A.
080041	Inbursa International, Inc.
080042	Inbursa Securities, Inc.
080043	IXE Holdings, Inc.
082004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
082006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
082008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
082009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
082010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
082011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
082012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
082013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
082014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
082016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
082025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
082027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
082028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
082030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
082031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán
082035	Conifa Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
082037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
082039	Bancreer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
082042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
082043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
082044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
082048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
082049	Bancomer Sucursal en Houston
082050	Banamex Oficina de Representación en Londres,

Anexo 77

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción
	Inglaterra
016035	Central de Divisas Casa de Cambio
016040	Consultoría Internacional Casa de Cambio
016041	Casa de Cambio Tiber
016044	Eurofímex, Casa de Cambio
016067	Masari, Casa de Cambio
016240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio
016408	B y B Casa de Cambio
016419	Finamex Casa de Cambio
016507	Casa de Cambio Tamibe
016533	Casa de Cambio Majapara
016587	Sterling Casa de Cambio
016629	Money Tron Casa de Cambio
016712	Intercom Casa de Cambio
016714	Order Express Casa de Cambio
016715	Prodira, Casa de Cambio
016717	Imperial Casa de Cambio
016718	Divisas San Jorge Casa de Cambio
016719	Unica Casa de Cambio
025001	Bolsa Mexicana de Valores
025002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores
025007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados
025013	Contraparte Central de Valores de México
025014	Flujos por pago de cupón o dividendo
037006	Banco Nacional de Comercio Exterior
037009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos
037019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada
037135	Nacional Financiera
037166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros
037168	Sociedad Hipotecaria Federal
040002	Banco Nacional de México
040012	BBVA Bancomer
040014	Banco Santander
040017	BBVA Bancomer Servicios
040021	HSBC México
040022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero
700000	Otros Bancos Extranjeros
701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
701001	Abasis
701002	American Express (Extranjero)
701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
701005	Bank Of America (Extranjero)
701006	Bank Boston Na (Extranjero)
701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
701008	Bank Of New York (Extranjero)
701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
701010	Bank One (Extranjero)
701011	BNP Paribas (Extranjero)
701012	Barclays Bank (Extranjero)
701013	Bear Stearns (Extranjero)
701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
701016	Citi National Bank (Extranjero)
701017	Citibank (Extranjero)
701018	Comerica Bank (Extranjero)
701019	Commerzbank (Extranjero)
701020	Controladora Prosa
701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
701022	Credit Suisse (Extranjero)
701023	Den Danske Bank (Extranjero)
701024	Deutsche Bank (Extranjero)
701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
701026	Fortis Bank (Extranjero)
701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
701030	Indosuez International (Extranjero)
701031	ING Bank (Extranjero)
701032	J.P. Morgan (Extranjero)
701033	Lehman Brothers (Extranjero)

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314
FUENTE : SIEFORES

PROCESO : FINANCIERO
ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040030	Banco del Bajío	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
040032	Ixe Banco	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
040036	Banco Inbursa	701037	National Westminster Bank (Natvest) (Extranjero)
040037	Banco Interacciones	701038	Republic National Bank (Extranjero)
040042	Banca Mifel	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
040044	Scotiabank Inverlat	701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
040058	Banco Regional de Monterrey	701041	Societe Generale (Extranjero)
040059	Banco Invex	701042	Solomon Brothers (Extranjero)
040060	Bansi	701043	Standard Bank London (Extranjero)
040062	Banca Afirme	701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
040072	Banco Mercantil del Norte	701045	Swiss Bank Volkbank (Extranjero)
040102	The Royal Bank of Scotland México	701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
040103	American Express Bank (México)	701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
040106	Bank of America México	701048	Union Bank (Extranjero)
040108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)	701049	Westdeutsche Landeszbank Girozentrale (Extranjero)
040110	Banco J.P. Morgan	701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
040112	Banco Monex	701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
040113	Banco Ve por Más	701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
040116	ING Bank (México)	701053	NYSE (New York Stock Exchange)
040124	Deutsche Bank México	701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
040126	Banco Credit Suisse México	701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
040127	Banco Azteca	701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
040128	Banco Autofin México	701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
040129	Barclays Bank México	701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
040130	Banco Compartamos	701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
040131	Banco Ahorro Famsa	701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
040132	Banco Multiva	701275	Asigna, Compensación y Liquidación
040133	Banco Actinver	701276	Chicago Board of Trade
040134	Banco Wal-Mart de México Adelante	701277	Credit Agricole Corp
040136	Banco Regional	701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
040137	BanCoppel	801150	Bank Morgan Stanley Ag
040138	Banco Amigo	801151	Smith Barney / Cgm Inc.
040139	UBS Bank México	801152	Citi Bank N.A. New York Officers
040140	Banco Fáci	801153	Pershing Inc.
040141	Volkswagen Bank	801154	Calyon Financial Inc.
040142	El Banco Deuno	801155	Morgan Stanley And Co. International Limited

Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



FORMATO DEL ARCHIVO : 0314
FUENTE : SIEFORES

PROCESO : FINANCIERO
ACTUALIZACIÓN :

Catálogo de Contrapartes

Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
040143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple	801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
040144	The Bank of New York Mellon (México)	801157	Segregación de Instrumentos
040145	Banco Base	801158	Segregación Inversa de Instrumentos
046048	Citibank (Banamex USA)	801159	Reclasificaciones
047005	Morgan Stanley and Company Limited	801160	Acciones Propias
076000	Otros Operadores	801161	Cortes Transversales
076001	Derfin	801162	Bank West
076008	Stock & Price	801163	Bcpbank Canada
076010	Scotia Inverlat Derivados	801164	Bridgewater Bank
076014	García Macías, Aráneda y Asociados GAMAA Derivados	801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
076018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)	801166	Canadian Tire Bank
076022	Darka	801167	Canadian Western Bank
076029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados	801168	Citizens Bank Of Canada
076043	Timber Hill LLC.	801169	Cs Alterra Bank
076044	Enlace Derivados	801170	Dundee Bank Of Canada
076048	Intercan Derivados	801171	First Nations Bank Of Canada
079001	Bancomer Holding-Islas Caimán	801172	General Bank Of Canada
079003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.	801173	Laurentian Bank Of Canada
079004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.	801174	Manulife Bank Of Canada
079005	Intemex Holding, S.A.-Luxemburgo	801175	National Bank Of Greece (Canada)
079006	Euro-American Capital Corporation Limited-Islas Caimán	801176	Pacific & Western Bank Of Canada
079009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.	801177	Wachovia Bank N.A.
079010	California Commeros Bank-California, E.U.A.	801178	Wells Fargo Bank N.A.
079012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda	801179	Us Bank N.A.
079013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda	801180	Suntrust Bank
079014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán	801181	Hsbc Bank Usa N.A.
079015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.	801182	Fia Card Svc N.A.
079016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán	801183	Regions Bank
079017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán	801184	National City Bank
079018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán	801185	Branch Bkg & TC
079022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801186	State Street B&TC
079023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.	801187	Countrywide Bank N.A.
079024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.	801188	Pnc Bank N.A.
079025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.	801189	Keybank N.A.

Anexo 77

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

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
079026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp	801190	Lasalle Bank N.A.
079027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.	801191	North Fork Bank
079028	BBVA Bancomer USA	801192	Manufacturers & Traders Tc
079029	Dinero Express	801193	Bank Of The West
079030	Banorte USA Corporation	801194	Fifth Third Bank
079031	INB Financial Corp.	801195	Northern TC
079032	INB Delaware Corporation	801196	Goldman Sachs Paris
079033	Inter Nacional Bank	801197	Citigroup Global Markets, INC
080000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras	801198	Jefferies Group, LLC
080001	Acci Securities Incorporated	801199	UBS Securities, LLC
080004	Afin Securities International Limited	801200	Evercore, LLC
080005	Arka Securities Incorporated	801201	GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney)
080008	BBVA Bancomer Securities International Inc.	801202	Santander USA
080009	BBVA Bancomer Holdings Corporation	801203	CME Clearing
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.	900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
080020	Valores Finamex International Incorporated	900004	Pioneer Investment Management Ltd.
080021	Finamex Securities Incorporated	910000	Otras Bolsas de Derivados
080022	Valores Finamex Limited	920000	Otros Socios Operadores
080023	Interacciones Global Incorporated	930000	Otros Socios Liquidadores
080024	Inter-Financial Services, Limited	940000	Otras Cámaras de Compensación

VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

Anexo 77

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

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.

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.

Anexo 77

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

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

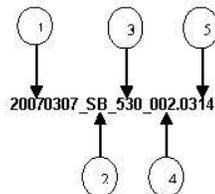
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- 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. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefiores Básicas, Siefiores de Aportaciones Voluntarias, Siefiores de Aportaciones Complementarias y Siefiores de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

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

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

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



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

20070307_SB_530_002.0314.gpg

Con este nombre es con el que deberá de transmitirse a 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:

Anexo 77

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

A20070307_SB_530_002.0314

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

Anexo 078

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

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

ENCABEZADO

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

DETALLE(S)

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTEO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301" . ¹
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. ⁵

Anexo 078

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

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
6	Emisora		AN	7	0	36 42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. ⁵
7	Serie		AN	7	0	43 49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
8	Consecutivo		AN	10	0	50 59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵
9	Plazo Total de la Operación de Reporto		N	6	0	60 65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Reporto. ¹
10	Plazo Actual del Reporto		N	6	0	66 71	El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. ¹
11	Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto		N	12	0	72 83	Número de títulos de los valores recibidos como colateral de la operación en Reporto (unidades). ¹
12	Costo total de adquisición del Reporto		N	14	2	84 99	Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. ²
13	Tasa Premio		N	3	3	100 105	Tasa Premio pactada del Reporto. ²
14	Precio Pactado		N	9	6	106 120	Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. ²
15	Importe pactado de cada operación		N	14	2	121 136	El valor total de la operación en Reporto al vencimiento, equivalente al costo total de adquisición más el premio pactado. ²
16	Premio devengado		N	14	2	137 152	Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. ²
17	Valor razonable		N	14	2	153 168	Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte. ²
18	Tipo de garantía pactada		N	2	0	169 170	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores ¹
19	Tasa de mercado		N	3	3	171 176	Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. ²
20	Divisa		N	2	0	177 178	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas ¹ .
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	179 180	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. ¹
22	Tipo de cambio pactado		N	9	6	181 195	Tipo de cambio pactado ² , en el reporte para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. ⁹
23	Contraparte		N	6	0	196 201	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. ¹
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	202 221	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵

Anexo 078

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

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTEO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
25	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	222	224	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera		N	4	0	225	228	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
27	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	229	231	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
28	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda		N	4	0	232	235	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
29	Folio de operación		N	12	0	236	247	Se deberá anotar un folio único por cada operación de reporte definido por la Siefore, el cual está asociado al folio del colateral de la operación en su caso. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Colateral recibido por concepto de operaciones en reporte y garantías recibidas por concepto de préstamos de valores). En caso de no recibir sobrecolateral llenar con ceros. ¹
30	Espacios en blanco		AN	96	0	248	343	Vacios. ⁶

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

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones	
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 12 para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones tercerizadas. ¹
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. ¹
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. ¹
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹²
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹³
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. ¹⁴
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. ⁵
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIV. ⁵
11	Serie		AN	7	0	52	58	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
12	Consecutivo	*	AN	10	0	59 68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros. ¹⁵
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69 76	Fecha de Liquidación de la operación. ³
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77 88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. ¹
15	Costo unitario		N	9	6	89 103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104 118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que la posición no cuente con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Monto total a liquidar		N	14	2	119 134	Monto total a liquidar en la operación en pesos. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". ²
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135 140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141 146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
20	Divisa		N	2	0	147 148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. ¹
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149 163	Tipo de cambio ⁹ promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
22	País de adquisición		N	2	0	164 165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
23	Contraparte		N	6	0	166 171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13: -En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación -En caso de flujos por dividendos o pagos de cupón se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes. -En otro caso se deberá llenar con ceros. ¹
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	172 191	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵
25	Hora de concertación de la operación		N	4	0	192 195	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros. ¹⁰
26	Banco de Trabajo		N	1	0	196 196	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. ¹
27	Medio de concertación		N	1	0	197 197	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación. ¹
28	Sistema de concertación		N	2	0	198 199	En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 – No aplica 1 – MEI 2 – SIPO 3 – VAR 4 – MEIPresval 5 – Corros Monex 99 – OTRO. ¹
29	Tipo de postura		N	1	0	200 200	Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 1 – Agresor 2 – Agredido. Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
30	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	201 203 Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros. ¹
31	Observaciones		AN	20	0	204 223 Se deberán reportar características especiales que no se incorporen en la información del presente detalle para las operaciones de compra y venta que se realicen en el día. ⁵
32	Compra en mercado primario		N	1	0	224 224 En caso de reportar compras realizadas en mercado primario anotar 1. En otro caso se deberá anotar 0. ¹
33	Espacios en blanco		AN	119	0	225 343 Vacíos. ⁶

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

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36 39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. ⁵
8	Emisora		AN	7	0	40 46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. ⁵
9	Serie		AN	7	0	47 53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
10	Consecutivo		AN	10	0	54 63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. ¹⁵
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64 75	Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. ¹
12	Costo promedio unitario en pesos de Adquisición		N	9	6	76 90	En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
13	Costo Total de Adquisición		N	14	2	91 106	De acuerdo al Catálogo de Tipos de inversión: -Si se indica "1" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner el costo total de la operación del reporte sin incluir el premio. -Si se indica "0, 6, 7, 11" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner costo total de adquisición. Este costo debe ser igual a la cantidad de títulos por el costo promedio unitario. -En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". ²

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107 121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122 137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro". ²
16	Intereses Devengados		N	14	2	138 153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. ²
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154 159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
18	País de origen		N	2	0	160 161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario. ¹
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162 164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169 171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172 175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176 178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179 182 Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183 185 Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186 189 Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. ¹
27	Tipo de derecho o modificación accionaria		N	2	0	190 191 Se deberá anotar el identificador del tipo de derecho o modificación accionaria decretado según el Catálogo de Tipo de Derechos. Solamente en el caso de acciones, vehículos, Fibras o CKD, de lo contrario llenar con ceros. ¹
28	Fecha en que se decreta el derecho o modificación accionaria		F	8	0	192 199 Si se ha decretado algún tipo de derecho o modificación accionaria a la fecha del reporte que no haya sido liquidado/ejercido, se deberá anotar la fecha en que se decretó. Solamente en el caso de acciones o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. ³
29	Proporción de la modificación accionaria		N	6	6	200 211 En caso de reportarse algún Tipo de derecho o modificación accionaria en el Id 27, indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones o vehículos (reportar el factor que se multiplica por cada título: #Títulos nuevos / #Títulos anteriores). ²
30	Ejercicio del derecho o modificación accionaria		N	1	0	212 212 En caso de ejercerse en la fecha de información el derecho o modificación accionaria se deberá anotar "1" si no "0". ¹
31	Monto del Derecho		N	14	2	213 228 Si el tipo de derecho decretado es pago en efectivo se deberá anotar el monto decretado de pago por unidad accionaria o por título del vehículo. ²
32	Valor Nominal Actualizado		N	14	6	229 248 Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos). Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen). En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
33	Títulos en circulación		N	14	0	249 262 Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
34	Valor Nominal Inicial		N	14	6	263	282	Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0 (Denominado en moneda de origen). En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
35	Títulos en Circulación Inicial		N	14	0	283	296	Se refiere al número inicial de títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. ¹
36	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	297	310	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o bidireccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la Siefore. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. ¹
37	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	311	313	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. ¹
38	Aviso de Recomposición		N	1	0	314	314	Se deberá anotar el identificador con fome al catálogo de Aviso de Recomposición. ¹
39	Índice de Mandato		N	3	8	315	325	Para el caso de inversiones tercerizadas, se deberá reportar el índice del mandato (truncado a 8 decimales) construido con base 1, afectado por la rentabilidad en pesos diaria del Mandato. En otro caso llenar con ceros. ²
40	Observaciones		AN	18	0	326	343	Si el tipo de derecho o modificación accionaria es "8" se deberá especificar el nombre anterior de la emisora. Si el tipo de derecho o modificación accionaria es "10" se deberá especificar el instrumento anterior utilizando el formato de Tipo Valor, Emisora y Serie respetando la longitud de dichos indicadores de 4, 7 y 7 respectivamente, los espacios en blanco deberán de ir a la izquierda dejando en blanco los que no se ocupen y sin espacios intermedios. ⁵

DETALLE 4: DETERMINACION DEL PRECIO DE LA ACCION Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". ¹

Anexo 078

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

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

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTIAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRESTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De: A:	Observaciones	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". ¹
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 8 para Garantías recibidas por operaciones de Reporto, 10 para Garantías recibidas por Préstamo de Valores. ¹
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. ¹
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. ¹²
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. ¹³
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. ¹⁴
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. ⁵
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. ⁵

Anexo 078

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

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTIAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRESTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSION							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
9	Serie	🔑	AN	7	0	47 53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. ¹⁵
10	Consecutivo	🔑	AN	10	0	54 63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. ¹⁵
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64 75	Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). ¹
12	Costo unitario original en pesos		N	9	6	76 90	En este campo se debe poner el costo unitario original al que se recibió. ²
13	Costo Total Original		N	14	2	91 106	Se debe poner el costo total original al que se recibió la posición en garantía. Este valor debe ser igual al costo unitario original por el número de títulos. ²
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107 121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. ²
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122 137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. ²
16	Intereses Devengados		N	14	2	138 153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. ²
17	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154 159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión. ¹
18	País de origen		N	2	0	160 161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. ¹
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162 164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165 168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169 171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172 175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹

Anexo 078

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

DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRÉSTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
27	Contraparte		N	6	0	190	195	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes ¹ .
28	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	196	215	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. ⁵
29	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	216	218	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
30	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	219	222	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
31	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	223	225	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. ¹
32	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	226	229	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. ¹
33	Folio de operación		N	12	0	230	241	Se deberá anotar el folio asociado a la operación de reporte o préstamo de valores definido por la Siefore, el cual deberá ser el mismo reportado en los detalle 1 (Desglose de Valores en Reporto) y 6 (Desglose de valores en préstamo) respectivamente ¹ .
34	Espacios en blanco		AN	102	0	242	343	Vacios ⁶ .

Anexo 078

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

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