

## Anexo 94

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada</b> - Vector de Precios de Productos Derivados para Siefores			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	196	16:00 a 20:00 Hrs.

CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS:						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		AN	2 0	1 2	Identificador de registro Constante "H" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Mercado		AN	2 0	3 4	Constante "DR" Mercado de Derivados <sup>4</sup> .
3	Fecha del Vector		F	8 0	5 12	Fecha de información <sup>3</sup> .
4	Tipo de Valor		AN	4 0	13 16	Clave de tipo de operación. Para Derivados OTC, se tomará el Tipo de Valor según el "Catálogo de Tipos de Valor OTC". Para los Mercados listados se tomará la clasificación preestablecida, o la que determine cada proveedor de Precios <sup>5</sup> .
5	Emisora		AN	7 0	17 23	Para el caso de futuros nacionales, se deberá reportar la clave del contrato asignada por la bolsa en donde cotice. Para el caso de futuros que coticen en mercados internacionales, se deberá reportar el identificador que asigna Bloomberg al tipo de contrato y que forma parte del Ticker. Para derivados distintos a SWAPS y derivados OTC se usará la clave larga de acuerdo a las Reglas para Emisoras del Anexo I correspondiente al subyacente; en caso de que el subyacente no tenga clave larga asociada, el Proveedor de Precios definirá la clave larga a usar. Para derivados OTC donde el subyacente sea una divisa diferente del peso se utilizarán seis caracteres que describa la cotización usando las tres primeras letras para la divisa a entregar y las últimas tres para la divisa a recibir conforme a las Reglas para Emisoras del Anexo I <sup>1</sup> .
6	Serie		AN	6 0	24 29	Para el caso de futuros nacionales, se deberá reportar la clave del vencimiento asignada por la bolsa en donde cotice. Para el caso de futuros que coticen en mercados internacionales, se deberá reportar el identificador que asigna Bloomberg al vencimiento del contrato y que forma parte del Ticker. Serie de la Emisora que otorgue el proveedor de precios. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval <sup>1</sup> .
7	Precio Sucio		N	9 6	30 44	Precio de origen, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
8	Precio Limpio		N	9 6	45 59	Precio de origen, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
9	Delta		N	6 6	60 71	Para el caso de opciones, será la delta de la opción, en otro caso será constante "000000000000" <sup>2</sup> .
10	Volatilidad Implícita		N	3 8	72 82	Para el caso de las opciones, se deberá anotar la Volatilidad con la que se valúa la operación, en otro caso se deberá anotar ceros <sup>2</sup> .
11	ID del Proveedor		AN	6 0	83 88	ID del proveedor de Precios de acuerdo al "Catálogo de Proveedores de Precios" <sup>4</sup> .
12	Días por Vencer		N	6 0	89 94	Son los días que faltan para el vencimiento de la emisión <sup>1</sup> .
13	Tasa de Descuento		N	3 6	95 103	Será constante "000000000" <sup>1</sup> .
14	ISIN		AN	12 0	104 115	Se deberá anotar la clave del ISIN <sup>5</sup> .

## Anexo 94

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS DERIVADOS.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
15	Consecutivo		AN	10	0	116 125	Identificador que le otorgue como consecutivo el proveedor de precios al derivado <sup>8</sup> .
16	Precio Cierre		N	9	6	126 140	Precio de cierre de mercados listados <sup>2</sup> .
17	CUSIP o CINS		AN	9	0	141 149	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS <sup>8</sup> .
18	SEDOL		AN	7	0	150 156	Se deberá anotar la clave del SEDOL <sup>1</sup> .
19	Precio de referencia de la pata a entregar.		N	14	6	157 176	Se deberá anotar el precio de referencia de la pata a entregar para el caso de SWAPS, en otro caso será 00000000000000000000 <sup>2</sup> .
20	Precio de referencia de la pata a recibir.		N	14	6	177 196	Se deberá anotar el precio de referencia de la pata a recibir para el caso de SWAPS, en otro caso será 00000000000000000000 <sup>2</sup> .

### CATALOGO(S)

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

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

## Anexo 94

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lév 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 Tipos de Valor OTC	
Tipo de Valor	Tipo de Instrumento
FWD	Forwards
SWP	Swaps
CALL	Opción de Compra
PUT	Opción de Venta

### ANEXO I

**1. Claves de emisora de Swaps**

En el caso de los Swaps, la emisora se compondrá de la siguiente forma:

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

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

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

**2. Swaps de Tasas:**

Se deberá especificar el tipo de tasas a intercambiar, en primer lugar se pondrá la clave que entregue la SIEFORE y en segundo lugar la clave que reciba. La tasa fija se identificará con la clave de la moneda de origen de la tasa y la tasa variable se identificará con la clave de la tasa.

Las claves para las tasas y monedas serán de 3 caracteres, utilizando la "clave corta" definida en las Reglas para Emisoras.

**3. Swap de Divisas (Cross Currency Swaps) se considera:**

## Anexo 94

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

Se deberá especificar el tipo de tasas a intercambiar, en primer lugar se pondrá la clave que entregue la SIEFORE y en segundo lugar la clave que reciba. La tasa fija se identificará con la clave de la moneda de origen de la tasa y la tasa variable se identificará con la clave de la tasa.

Las claves para las tasas y monedas serán de 3 caracteres, utilizando la "clave corta" definida en las Reglas para Emisoras.

Un ejemplo del uso de las claves se presenta a continuación:

Operación	1	2	3	4	5	6	7	Resultado
Swap tasa fija 8.25 vs CETES (Siefore entrega Cetes y recibe fija 8.25)	1	C	E	T	M	X	P	1CETMXP
Swap TIIE vs Cetes (Siefore entrega TIIE y recibe CETES)	2	T	I	E	C	E	T	2TIECET
Swap MXP 7.28 vs USD 2.00 (Siefore entrega tasa Pesos y recibe tasa Dólares)	3	M	X	P	U	S	D	3MXPUSD
Swap EUR 1.35 vs USD Libor (Siefore entrega tasa EUR y recibe USD Libor)	4	E	U	R	L	U	S	4EURLUS
Swap MXP TIIE vs EUR Libor (Siefore entrega TIIE y recibe EUR Libor)	5	T	I	E	L	E	U	5TIELEU

### Reglas para Emisoras

Descripción	Clave Larga	Clave Corta	Categoría
TIIE 28	TIIE28	TIE	Tasa
TIIE 91	TIIE91	TIE	Tasa
Libor en Dólares	LIUSD	LUS	Tasa
Libor en Euros	LIEUR	LEU	Tasa
Libor en Yenes	LJJPY	LJP	Tasa
Cetes 28	CET28	CET	Tasa
Cetes 91	CET91	CET	Tasa
Cetes 182	CET182	CET	Tasa
Cetes 360	CET360	CET	Tasa

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

Las claves cortas de las tasas libor se conforman de la siguiente manera: la 1ª posición corresponderá a la letra L y las siguientes dos a las dos primeras letras de la moneda a la que corresponda la tasa libor.

Ejemplos:

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

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

Las claves cortas para TIIE se conforman del texto TIE.

Ejemplos:

## Anexo 94

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

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

Las claves cortas para CETES se conforman del texto CET.

Ejemplos:

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

### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

## Anexo 94

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

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

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

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

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

No. de carácter	Descripción
<b>1</b>	Letra Inicial de Proveedor P = PIP, V = VALMER.
<b>2-3</b>	Clave que identifica el año en el que se dio de alta el Derivado 03 = 2003, 04 = 2004... y así sucesivamente.
<b>4-8</b>	Número consecutivo de la operación, el cual será diferente para cada proveedor; dado que dependerá de las operaciones que sus clientes vayan realizando. Será incrementado en uno cada vez que exista duplicidad en "Tipo de valor", "Emisora" y "Serie".
<b>9-10</b>	Espacios en blanco.

Para el caso de los derivados de Mexder se aplicará el consecutivo de la siguiente forma:

- Si se trata de posiciones nuevas, es decir operaciones concertadas en la fecha de información se considerará el nivel de entrada con la posición, este consecutivo será:

No. de carácter	Descripción
<b>1-5</b>	Parte entera del nivel de entrada.
<b>6-10</b>	Decimales del nivel de entrada.

Ejemplo:

Operación	TV	EMISORA	SERIE	CONSECUTIVO
Futuro del dólar al 11.4625	FD	DEUA	DC12	0001146250
Futuro del bono al 102.555	FB	M10	DC12	0010255500
Futuro del IPC al 40245	FI	IPC	DC12	4024500000
Futuro de la TIIE al 6.48	FB	TE28	DC12	0000648000

- Para el caso de posiciones con más de un día de vigencia o que hayan sido concertadas un día hábil antes de la fecha de información, se considerará el consecutivo estándar; igual que los demás derivados.

## Anexo 94

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

Ejemplo:

Operación	TV	EMISORA	SERIE	CONSECUTIVO
Futuro del dólar al 11.4625	FD	DEUA	DC12	V0000001
Futuro del bono al 102.555	FB	M10	DC12	P0000001
Futuro del bono al 100.354	FB	M10	DC12	P0000002
Futuro de la TIIE al 6.48	FB	TE28	DC12	V0000001

### POLITICAS GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las observaciones 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 una VPN (Red privada Virtual) para cada proveedor de precios.
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de Precios contratado por cada Administradora.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 16:00 a las 20:00 hrs.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte del proveedor a CONSAR se compone de lo siguiente:

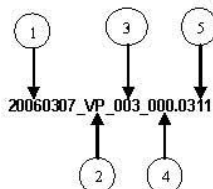
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad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

## Anexo 94

	<b>COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO</b>	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0311	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

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



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

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

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

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

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



















## Anexo 97

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0320 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene información del desglose de instrumentos subyacentes ligados a notas estructuradas.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	164	16:00 a 20:00 Hrs.

### DETALLE(S)

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE INSTRUMENTOS SUBYACENTES LIGADOS A NOTAS ESTRUCTURADAS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Fecha de Información		F	8	0	4	11	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
3	Tipo de Valor		AN	4	0	12	15	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
4	Emisora		AN	7	0	16	22	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
5	Serie		AN	7	0	23	29	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios a la Nota. <sup>4</sup>
6	Consecutivo		AN	10	0	30	39	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios a la Nota. <sup>15</sup>
7	ISIN		AN	12	0	40	51	Se deberá anotar el ISIN que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>12</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	52	60	Se deberá anotar el CUSIP / CINS que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>13</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	61	67	Se deberá anotar el SEDOL que le otorgue el proveedor de precios a la Nota, un cero en otro caso. <sup>14</sup>
10	Serial Subyacente		AN	8	0	68	75	Tres posiciones para el # de subyacente de # de subyacentes, ejemplos: 001de001, 009de012. <sup>4</sup>
11	Tipo de Valor instrumento subyacente		AN	4	0	76	79	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
12	Emisora instrumento subyacente		AN	7	0	80	86	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
13	Serie instrumento subyacente		AN	7	0	87	93	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>4</sup>
14	ISIN del instrumento subyacente		AN	12	0	94	105	Se deberá anotar el ISIN que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>12</sup>
15	CUSIP O CINS del instrumento subyacente		AN	9	0	106	114	Se deberá anotar el CUSIP / CINS que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>13</sup>
16	SEDOL del instrumento subyacente		AN	7	0	115	121	Se deberá anotar el SEDOL que le otorgue el proveedor de precios al instrumento subyacente. <sup>14</sup>
17	Divisa de cotización del instrumento subyacente		N	2	0	122	123	Se registrará el identificador de la divisa de cotización del instrumento subyacente conforme al catálogo de Divisas haciendo referencia al país o forma de cotizar. <sup>16</sup>

## Anexo 97

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0320 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE INSTRUMENTOS SUBYACENTES LIGADOS A NOTAS ESTRUCTURADAS							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
18	Valor unitario a Mercado del instrumento subyacente		N	9	6	124 138	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado del instrumento subyacente a la fecha del reporte <sup>2</sup> .
19	Delta		N	3	3	139 144	Se deberán anotar con signo más o menos el valor de la delta del instrumento subyacente con respecto a un título de la Nota estructurada <sup>2</sup> .
20	Nocional		N	14	6	145 164	Se deberá anotar el valor nocional implícito del instrumento derivado que cubre el índice asociado subyacente de la Nota estructurada <sup>2</sup> .

### CATALOGO(S)

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

## Anexo 97

	FORMATO DEL ARCHIVO :	0320	PROCESO :	FINANCIERO
	FUENTE :	Proveedores de precios	ACTUALIZACIÓN :	

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

<sup>16</sup> El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

## Anexo 97

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0320 <b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	---	---

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

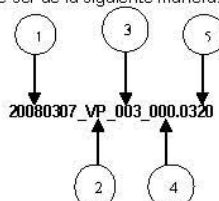
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

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

No.	TIPO DE DATO	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, <b>Constante = "VP"</b>
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta, <b>Constante = "000"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0320</b> .

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

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



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

**A20080307\_VP\_003\_000.0320**

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

## Anexo 97

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0320	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Proveedores de precios	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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






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

## Anexo 106

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DESCRIPCION DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información de las operaciones de compra-venta, Reporto y Préstamo de Valores realizadas por las Siefores, transferencias de valores y la posición diaria de sus carteras, así como de los valores otorgados en préstamo y en garantía.			
PERIODICIDAD DE ENVIO	PERIODO DE RECEPCION	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISION
DIARIO	DIARIO.	151	08:30 a 10:00 Hrs

### ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Número de caracteres por registro = Constante "151". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0303". <sup>1</sup>
5	Fecha de Operación		F	8 0	16 23	Fecha de la operación que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3 0	24 26	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipo de Entidad anexo. <sup>1</sup>
7	Entidad		N	6 0	27 32	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades de los Custodios de las siefores, anexo. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	119 0	33 151	Vacíos. <sup>6</sup>









### SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	Id Siefore		AN	2 0	4 5	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
3	Folio Siefore		AN	3 0	6 8	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
4	Cuenta Siefore		AN	4 0	9 12	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
5	Número de Cuenta del Cliente		AN	20 0	13 32	Se deberá anotar el número de cliente de la Afore o Siefore según el Catálogo de Números de Cuenta del Cliente conforme al Archivo 0308, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>
6	Espacios en blanco		AN	119 0	33 151	Vacíos. <sup>6</sup>

## Anexo 106

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro
<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

### DETALLE(S)

DETALLE 1: MOVIMIENTOS DE VALORES DEL DÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent.	Dec.	Posición	Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3			1 3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Entradas/Salidas		AN	1	0		4 4	Es la clave de la operación realizada (valores recibidos "E" o entregados "S" por la Siefore). <sup>5</sup>
3	Tipo de Movimiento		AN	1	0		5 5	Es la clave que indica el tipo de movimiento realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7	0		6 12	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
5	Serie		AN	7	0		13 19	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
6	Tipo de Valor		AN	4	0		20 23	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
7	Cupón		N	4	0		24 27	Número del cupón vigente de la Emisora. <sup>1, 10</sup>
8	Monto de Liquidación		N	11	6		28 44	Total de liquidación de la operación en su caso. <sup>2</sup>
9	Tasa		N	3	6		45 53	Tasa pactada en la operación. <sup>2</sup>
10	Plazo		N	4	0		54 57	El número de días entre la fecha de la información y la fecha de vencimiento del instrumento o la operación de Reporto o Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
11	Id Contraparte		AN	2	0		58 59	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
12	Folio Contraparte		AN	3	0		60 62	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
13	Cuenta Contraparte		AN	4	0		63 66	Se deberá llenar con un CERO justificado a la izquierda y espacios. <sup>5</sup>
14	Títulos operados		N	15	0		67 81	Total de títulos entregados o recibidos por la Siefore en la operación. <sup>1</sup>
15	Divisa		N	2	0		82 83	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisas anexo. <sup>1</sup>
16	Código ISIN		AN	12	0		84 95	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
17	CUSIP O CINS		AN	9	0		96 104	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
18	SEDOL		AN	7	0		105 111	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
19	Número de Cuenta de la Contraparte		AN	20	0		112 131	Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>
20	Número de Cuenta del Beneficiario		AN	20	0		132 151	Se deberá anotar el número de Cuenta del Beneficiario que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309, únicamente para ser llenado por Custodios. <sup>5</sup>

DETALLE 2: POSICIÓN DE VALORES EN CARTERA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent.	Dec.	Posición	Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0		1 3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7	0		4 10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7	0		11 17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4	0		18 21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Cupón		N	4	0		22 25	Número del cupón vigente de la Emisora. <sup>1, 10</sup>
6	Posición Inicial		N	20	0		26 45	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
7	Posición Actual		N	20	0		46 65	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
8	Código ISIN		AN	12	0		66 77	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
9	CUSIP O CINS		AN	9	0		78 86	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
10	SEDOL		AN	7	0		87 93	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>

## Anexo 106

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 2: POSICIÓN DE VALORES EN CARTERA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
11	Espacios en Blanco		AN	58	0	94	151	Vacios <sup>6</sup>

DETALLE 3: POSICIÓN DE VALORES OTORGADOS EN PRÉSTAMO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7	0	4	10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7	0	11	17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4	0	18	21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Posición Inicial		N	20	0	22	41	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
6	Posición Actual		N	20	0	42	61	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
7	Código ISIN		AN	12	0	62	73	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	74	82	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	83	89	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
10	Espacios en Blanco		AN	62	0	90	151	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 4: POSICIÓN DE VALORES OTORGADOS EN GARANTÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "304". <sup>1</sup>
2	Emisora		AN	7	0	4	10	Clave de la Emisora asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
3	Serie		AN	7	0	11	17	Clave de la Serie asignada al activo. <sup>5, 10</sup>
4	Tipo de Valor		AN	4	0	18	21	Clave de Tipo de Valor del instrumento. <sup>5, 10</sup>
5	Posición Inicial		N	20	0	22	41	Es la cantidad de títulos iniciales en cartera de la emisión (Debe coincidir con la Posición Actual del día anterior). <sup>1</sup>
6	Posición Actual		N	20	0	42	61	Es la cantidad de títulos finales disponibles en cartera de la emisión. <sup>1</sup>
7	Código ISIN		AN	12	0	62	73	Se deberá anotar el código ISIN del activo. <sup>1</sup>
8	CUSIP O CINS		AN	9	0	74	82	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo. <sup>8</sup>
9	SEDOL		AN	7	0	83	89	Se deberá anotar el código SEDOL del activo. <sup>9</sup>
10	Espacios en Blanco		AN	62	0	90	151	Vacios. <sup>6</sup>

DETALLE 5: MOVIMIENTOS DE EFECTIVO DEL DÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305". <sup>1</sup>
2	Entradas/Salidas		AN	1	0	4	4	Es la clave de la operación realizada "E" para Depósitos recibidos y "S" para Retiros de la Siefiore. <sup>5</sup>
3	Tipo de Movimiento de Efectivo		AN	1	0	5	5	Es la clave que indica el tipo de movimiento de efectivo realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento de Efectivo. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7	0	6	12	Es la clave de la Emisora del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
5	Serie		AN	7	0	13	19	Es la clave de la Serie del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
6	Tipo de Valor		AN	4	0	20	23	Es la clave de Tipo de Valor del instrumento que originó el movimiento de efectivo. <sup>5, 10</sup>
7	Monto		N	11	6	24	40	Monto del movimiento en efectivo. <sup>2</sup>



## Anexo 106

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 5: MOVIMIENTOS DE EFECTIVO DEL DÍA						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones
8	Divisa		N	2	0 41 42	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisas anexo. <sup>1</sup>
9	Código ISIN		AN	12	0 43 54	Se deberá anotar el código ISIN del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>1</sup>
10	CUSIP O CINS		AN	9	0 55 63	Se deberá anotar el código CUSIP o el CINS del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>8</sup>
11	SEDOL		AN	7	0 64 70	Se deberá anotar el código SEDOL del activo que originó el movimiento de efectivo. <sup>9</sup>
12	Número de Cuenta de la Contraparte		AN	20	0 71 90	Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309. <sup>5</sup>
13	Número de Cuenta del Beneficiario		AN	20	0 91 110	Se deberá anotar el número de Cuenta de la Contraparte que tiene registrado el Custodio según el Catálogo de Números de Cuenta de Contrapartes y Beneficiarios conforme al Archivo 0309. <sup>5</sup>
14	Espacios en Blanco		AN	41	0 111 151	Vacios. <sup>6</sup>

### CATALOGO(S)

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

Catálogo de Entidades (Custodios)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
14002	BANAMEX CUSTODIA
146300	STATE STREET BANK
140012	BANCOMER CUSTODIO
140014	SANTANDER CUSTODIO
146310	BANK OF NEW YORK

\* La CONSAR otorgará la clave de custodio respectiva

## Anexo 106



Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro

**FORMATO DEL ARCHIVO :** 0303

**PROCESO :** FINANCIERO

**FUENTE :** Custodios Internacionales de las SIEFORES

**ACTUALIZACIÓN :**

Catálogo de Tipo de Movimiento	
Identificador	Descripción
R	Operación de Reporto
T	Traspaso sin liquidación
V	Operación de compra o venta
P	Préstamos de Valores
G	Garantías entregadas
D	Derechos en especie

Catálogo de Tipo de Movimiento de Efectivo	
Identificador	Descripción
R	Operación de Reporto
D	Operación de Compra o Venta
C	Pago de cupón
A	Amortización
V	Pago de dividendos
H	Pago de derechos
P	Préstamo de Valores

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

## Anexo 106

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303 <b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Catálogo de Divisa		
Identificador	Descripción	Clave
32	Nuevo Sol Peruano	PEN
33	Dólar de Singapur	SGD
99	Otras Divisas	OTR

### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:  
 DD = día  
 MM = mes  
 AAAA = año

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

DD = día  
 MM = mes  
 AAAA = año

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

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

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

<sup>7</sup> 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 o no existe, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

<sup>8</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada o no existe, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

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

## Anexo 106

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0303	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

<sup>10</sup> Estos campos serán considerados opcionales sólo si se llenó alguno de los campos de código ISIN o CUSIP o SEDOL, de lo contrario se llenarán los espacios vacíos con un CERO justificado a la izquierda y espacios.

### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

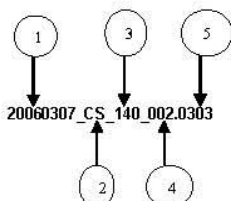
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/> o en su caso mediante FTP.
- Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios de las Siefors.
- El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 08:30 a las 10:00 hrs.
- 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.
 Será obligatorio contar con por lo menos uno de ellos.
- El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Custodios a CONSAR se compone de lo siguiente:

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. <b>Constante = "CS"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0303</b> .

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

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



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

**A20060307\_CS\_140\_002.0303**

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

## Anexo 107

	COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO			
	<table style="width: 100%; border: none;"> <tr> <td style="width: 33%;">FORMATO DEL ARCHIVO : 0308</td> <td style="width: 33%;">PROCESO : FINANCIERO</td> </tr> <tr> <td>FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES</td> <td>ACTUALIZACIÓN :</td> </tr> </table>	FORMATO DEL ARCHIVO : 0308	PROCESO : FINANCIERO	FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES
FORMATO DEL ARCHIVO : 0308	PROCESO : FINANCIERO			
FUENTE : Custodios Internacionales de las SIEFORES	ACTUALIZACIÓN :			

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene la información del Catálogo de Números de Cuenta del Cliente según los Custodios Internacionales de las Siefiores			
PERIODICIDAD DE ENVIO	PERIODO DE RECEPCION	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISION
DIARIO	DIARIO.	092	08:30 a 10:00 Hrs

### ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5 0	4 8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3 0	9 11	Es el número de caracteres por registro = constante "092". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4 0	12 15	Es el identificador de archivo (para control del sistema)= Constante "0308". <sup>1</sup>
5	Fecha de Proceso		F	8 0	16 23	Es la fecha de envío de la información a CONSAR. <sup>3</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3 0	24 26	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información = Constante "019". <sup>1</sup>
7	Entidad		N	6 0	27 32	Clave de la Entidad que reporta la información de acuerdo al Catálogo de Entidades que establezca la CONSAR. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	60 0	33 92	Vacios. <sup>6</sup>

### DETALLE(S)

DETALLE 1: CATÁLOGO DE NUMEROS DE CUENTA DEL CUENTE						
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3 0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Número de cuenta del cliente		AN	20 0	4 23	Será el número de cuenta de cliente que la Afore o Siefiore tenga con el Custodio. <sup>6</sup>
3	Clave de Siefiore		AN	9 0	24 32	Se deberá anotar la clave de la Afore o Siefiore según el Catálogo de Claves de Afores y Siefiores. <sup>5</sup>
4	Nombre del cliente		AN	60 0	33 92	Se deberá anotar la razón social del Cliente. <sup>5</sup>

### CATALOGO(S)

Catálogo de Entidades (Custodios)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
140002	BANAMEX CUSTODIA
146300	STATE STREET BANK
140012	BANCOMER CUSTODIO
140014	SANTANDER CUSTODIO
146310	BANK OF NEW YORK

\* La CONSAR otorgará la clave de custodio respectiva

## Anexo 107

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro



**FORMATO DEL ARCHIVO :** 0308

**PROCESO :** FINANCIERO

**FUENTE :** Custodios Internacionales de las SIEFORES

**ACTUALIZACIÓN :**

### Catálogo de Claves de Afores y Siefores

Clave de Siefore	Descripción	Clave de Siefore	Descripción
002556090	AZTECA, Siefore Básica Pensiones	002578090	PENSIONISSSTE, Siefore Básica de Pensiones
002556001	AZTECA, Siefore Básica 1	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 1
002556002	AZTECA, Siefore Básica 2	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 2
002556003	AZTECA, Siefore Básica 3	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 3
002556004	AZTECA, Siefore Básica 4	002578001	PENSIONISSSTE, Siefore Básica 4
002552090	BANAMEX, Siefore Básica Pensiones	002538090	PRINCIPAL, Siefore Básica Pensiones
002552001	BANAMEX, Siefore Básica 1	002538001	PRINCIPAL, Siefore Básica 1
002552002	BANAMEX, Siefore Básica 2	002538002	PRINCIPAL, Siefore Básica 2
002552003	BANAMEX, Siefore Básica 3	002538003	PRINCIPAL, Siefore Básica 3
002552004	BANAMEX, Siefore Básica 4	002538004	PRINCIPAL, Siefore Básica 4
017652001	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1		
017652002	BANAMEX, Siefore de Aportaciones Voluntarias 2		
002568090	COPPEL, Siefore Básica Pensiones	002534090	PROFUTURO, Siefore Básica Pensiones
002568001	COPPEL, Siefore Básica 1	003334001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Complementarias 1
002568002	COPPEL, Siefore Básica 2	002534001	PROFUTURO, Siefore Básica 1
002568003	COPPEL, Siefore Básica 3	002534002	PROFUTURO, Siefore Básica 2
002568004	COPPEL, Siefore Básica 4	002534003	PROFUTURO, Siefore Básica 3
		002534004	PROFUTURO, Siefore Básica 4
		017634001	PROFUTURO, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002550090	INBURSA, Siefore Básica Pensiones		
002550001	INBURSA, Siefore Básica 1	002530090	XXI BANORTE, Siefore Básica Pensiones
002550002	INBURSA, Siefore Básica 2	002530001	XXI BANORTE, Siefore Básica 1
002550003	INBURSA, Siefore Básica 3	002530002	XXI BANORTE, Siefore Básica 2
002550004	INBURSA, Siefore Básica 4	002530003	XXI BANORTE, Siefore Básica 3
		002530004	XXI BANORTE, Siefore Básica 4
002544090	SURA, Siefore Básica Pensiones		
002544001	SURA, Siefore Básica 1	017630001	XXI BANORTE, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1
002544002	SURA, Siefore Básica 2	004430001	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 1
002544003	SURA, Siefore Básica 3	004430002	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 2
002544004	SURA, Siefore Básica 4	004430003	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 3
017644001	SURA, Siefore de Aportaciones Voluntarias 1	004430004	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 4
017644002	SURA, Siefore de Aportaciones Voluntarias 2	004430005	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 5
017644003	SURA, Siefore de Aportaciones Voluntarias 3	004430006	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 6
		004430007	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 7
002562090	INVERCAP, Siefore Básica de Pensiones	004430008	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 8
002562001	INVERCAP, Siefore Básica 1	004430009	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 9
002562002	INVERCAP, Siefore Básica 2	004430010	XXI BANORTE, Siefore de Previsión Social 10
002562003	INVERCAP, Siefore Básica 3		
002562004	INVERCAP, Siefore Básica 4		
003364001	METLIFE, Siefore de Aportaciones Complementarias 1		
002564090	METLIFE, Siefore Básica Pensiones		
002564001	METLIFE, Siefore Básica 1		
002564002	METLIFE, Siefore Básica 2		
002564003	METLIFE, Siefore Básica 3		
002564004	METLIFE, Siefore Básica 4		

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

## Anexo 107

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0308	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

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

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

DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

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

DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

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

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

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

### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del portal: <https://www.consar.gob.mx/custodios/upload/>
- II. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Custodios.
- III. El horario de transmisión de la información a CONSAR será de las 08:30 a las 10:00 hrs.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Custodios a CONSAR se compone de lo siguiente;

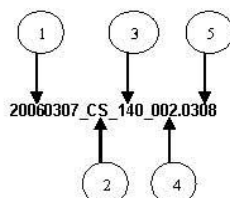
No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento, <b>Constante = "CS"</b>
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
4	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que se reporta.
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0308</b> .

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

## Anexo 107

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0308	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> Custodios Internacionales de las SIEFORES	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad Banamex Custodio (140002) estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

**A20060307\_CS\_140\_002.0308**

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



## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

### ENCABEZADO

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

### SUBENCABEZADO

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


## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

### DETALLE(S)

#### DETALLE 1: CARTERA DE VALORES.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Ent.	Dec.	Posición	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0		1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0		4 5	Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión conforme al "Catálogo de Tipo de Inversión" <sup>1</sup> .
3	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0		6 15	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
4	ISIN		AN	12	0		16 27	Se deberá anotar la clave del ISIN del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>7</sup> .
5	CUSIP O CINS		AN	9	0		28 36	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>8</sup> .
6	SEDOL		AN	7	0		37 43	Se deberá anotar la clave del SEDOL del activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada <sup>9</sup> .
7	Ticker Bloomberg		AN	20	0		44 63	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al activo en directo, colateral de la operación de reporto o valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista <sup>10</sup> .
8	Ticker Reuters		AN	20	0		64 83	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al activo en directo, colateral de la operación de reporto o el valor en préstamo o garantía entregada reportada en caso de que exista <sup>11</sup> .
9	Clase de Activo		N	2	0		84 85	Se deberá anotar el identificador de la clase de activo reportado según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" <sup>1</sup> .
10	País de origen		N	2	0		86 87	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al "Catálogo de Países" <sup>1</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
11	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	88 97	Los identificadores reportados en este campo se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo denominado "ID Emisor/Contraparte". En caso de reportar instrumentos de deuda, estructuras vinculadas a subyacentes o acciones se deberá anotar el identificador correspondiente al emisor del instrumento. En caso de reportar vehículos, se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador del mismo. En el caso de reportar operaciones de reporto, préstamo de valores o garantías entregadas, se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte <sup>1</sup> .
12	Primera Calificación		N	4	0	98 101	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la calificación mínima, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
13	Segunda Calificación		N	4	0	102 105	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la segunda calificación más baja, conforme al "Catálogo de Calificaciones Homologadas", emitida para el instrumento por alguna de las Agencias Calificadoras que se encuentran en el "Catálogo de Agencias Calificadoras". Esta deberá estar de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
14	Primera Calificadora		N	2	0	106 107	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Primera Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras". Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
15	Segunda calificadora		N	2	0	108 109	En caso de que se trate de un instrumento de deuda, se deberá anotar el identificador de la Agencia Calificadora que asignó la calificación que se reporta en el campo "Segunda Calificación" de acuerdo al "Catálogo de Agencias Calificadoras". Llenar con ceros en otro caso <sup>1</sup> .
16	Fecha de Emisión		F	8	0	110 117	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se deberá indicar la fecha de emisión. En caso de que se reporten operaciones de reporto o préstamo de valores se deberá indicar la fecha de concertación de la operación. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
17	Fecha de Vencimiento		F	8	0	118 125	En caso de que se reporten instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes indicar la fecha de vencimiento. En caso de que reporten operaciones de reporto y préstamo de valores indicar la fecha de vencimiento de las operaciones. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
18	Plazo Cupón		N	4	0	126 129	En caso de tratarse de instrumentos de deuda con cupones, indicar el plazo del cupón en días. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .

## Anexo 111


	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
19	Tasas o sobretasas		N	2	6	130 137	En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones a tasa fija, se deberá indicar el nivel de la tasa cupón. En caso de estar reportando instrumentos de deuda con cupones flotantes se deberá indicar el nivel de la sobretasa del cupón. En caso de estar reportando operaciones de reporte, indicar la tasa pactada. Finalmente, en caso de estar reportando valores en préstamo, se deberá indicar la tasa premio pactada en la operación. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
20	Divisa de Cotización		N	2	0	138 139	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del activo según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
21	Divisa de liquidación		N	2	0	140 141	Se anotará el identificador de la divisa de liquidación del instrumento o de la operación que se reporte, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
22	Cantidad de Títulos		N	12	0	142 153	Se deberá reportar el número de títulos o acciones que conforman la posición del Mandato <sup>1</sup> .
23	Valor a Mercado		N	12	2	154 167	En este campo se deberá reportar el valor total a mercado de la posición en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
24	Valor Nominal		N	8	2	168 177	Para activos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes se indicará el Valor Nominal en la divisa de cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
25	Títulos en Circulación		N	8	0	178 185	En el caso de instrumentos de deuda y estructuras vinculadas a subyacentes, se deberá reportar el número de títulos que se encuentran en circulación en la fecha en que se reporta la información. En otro caso llenar con ceros <sup>1</sup> .
26	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	186 195	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". Para el caso de activos a través de los cuales se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -En caso de tratarse de una acción, el identificador que se definió para la acción. -En el caso de vehículos que repliquen Índices, se deberá anotar el identificador del Índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>1</sup> .
27	Protección Inflacionaria		N	1	0	196 196	Se deberá anotar 1 si el o los flujos del instrumento están denominados en Unidades de Inversión (UDIs) o en moneda nacional cuyos intereses garanticen un rendimiento mayor o igual a la variación de las Unidades de Inversión (UDIs) o del Índice Nacional de Precios al Consumidor (INPC). Se deberá anotar 0 en otro caso <sup>1</sup> .
28	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	197 197	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 1: CARTERA DE VALORES							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
29	Aviso de Recomposición		N	1	0	198 198	Este campo se utilizará para indicar el tipo de recomposición al que la posición será sometida en caso de que con la misma se incurra en algún tipo de violación al Régimen de Inversión conforme a las disposiciones y lineamientos emitidos por la Comisión. Se deberá indicar si la posición a la fecha de reporte de información no está sujeta a ningún tipo de recomposición, si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición y se mantendrá la inversión de recursos en ella, o si se encuentra sujeta a un proceso de recomposición y se planea deshacer la posición. Para este fin, se deberá anotar el identificador correspondiente al estatus vigente de la posición reportada y que se define en el "Catálogo Aviso de Recomposición".
30	Descriptivo		AN	100	0	199 298	Se deberá anotar una breve descripción del activo <sup>1</sup> .
31	Espacios vacíos		AN	121	0	299 419	Vacios <sup>2</sup> .

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4 13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>1</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento reportado <sup>1</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26 34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento reportado <sup>2</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento reportado <sup>2</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42 61	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento reportado en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62 81	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento reportado en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de operación		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del forward <sup>4</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98 113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y denominado en la divisa en que se pacte <sup>5</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128 147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .
13	Plazo de Referencia		N	4	0	148 151	En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152 152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
15	Entrega Física o Diferenciales		AN	1	0	153 153	Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D" cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega" <sup>4</sup> .
16	Clase de Activo		N	2	0	154 155	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" correspondiente al subyacente <sup>1</sup> .

## Anexo 111


	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
17	Ticker Bloomberg Subyacente		AN	20	0	156 175	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver <sup>10</sup> .
18	Ticker Reuters Subyacente		AN	20	0	176 195	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver <sup>11</sup> .
19	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	196 205	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberá anotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso. -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
20	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	8	0	206 213	Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	214 223	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
22	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	224 233	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
23	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	234 235	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>11</sup> .
24	Divisa del tamaño del contrato		N	2	0	236 237	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>11</sup> .
25	Divisa de Liquidación		N	2	0	238 239	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas" <sup>11</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
26	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	240 245	En caso de que el forward tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga. En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>1</sup> .
27	Valor a Mercado		N	12	2	246 259	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
28	Monto expuesto		N	12	2	260 273	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
29	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	274 274	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
30	Descriptivo		AN	100	0	275 374	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
31	Espacios en blanco		AN	45	0	375 419	Vacios <sup>5</sup> .

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
				Ent. Dec.	De: A:		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1 3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "303" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4 13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14 25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26 34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35 41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42 61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62 81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Fecha de Operación		F	8	0	82 89	Se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el futuro <sup>3</sup> .
9	Fecha de Vencimiento		F	8	0	90 97	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del futuro <sup>3</sup> .
10	Tamaño del Contrato		N	14	2	98 113	Se deberá anotar el tamaño del contrato en valor absoluto y en la divisa en que se pacte <sup>2</sup> .
11	Número de Contratos		N	14	0	114 127	Se deberá anotar el número de contratos abiertos en valor absoluto <sup>1</sup> .
12	Precio o Tasa Pactada		N	14	6	128 147	Se deberá anotar el precio o tasa al que se pactó la operación <sup>2</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Posición	Observaciones
13	Plazo de Referencia		N	4	0	148 151	En caso de que el derivado tenga como subyacente un componente de renta fija, se deberá anotar el plazo en días de la tasa que se pactó o el plazo del cupón estándar del bono. En otro caso se deberá llenar con ceros <sup>1</sup> .
14	Tipo de Operación		N	1	0	152 152	Anotar 1 si la posición es larga o 2 si la posición es corta <sup>1</sup> .
15	Entrega Física o Diferenciales		AN	1	0	153 153	Se deberá anotar "F" cuando al vencimiento del contrato se realice una entrega física del subyacente, y "D" cuando el contrato se liquide por diferenciales, de acuerdo al "Catálogo de Tipo de Entrega" <sup>4</sup> .
16	Clase de Activo		N	2	0	154 155	Se deberá anotar el identificador según el "Catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada" correspondiente al subyacente <sup>1</sup> .
17	Ticker Bloomberg Subyacente		AN	20	0	156 175	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Bloomberg al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Bloomberg al cheapest to deliver <sup>10</sup> .
18	Ticker Reuters Subyacente		AN	20	0	176 195	En caso de que exista, se deberá reportar el Ticker que asigna Reuters al Subyacente. En caso de que se tenga una canasta de subyacentes, reportar el Ticker que asigna Reuters al cheapest to deliver <sup>11</sup> .
19	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías		AN	10	0	196 205	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde se reportarán en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que a través del activo subyacente se tome exposición a Renta Variable o Mercancías se deberá anotar lo siguiente: -Si el subyacente es una acción o un índice, se deberá anotar el identificador definido para la acción o el índice según sea el caso. -Si el subyacente es un vehículo que replica índices, se deberá anotar el identificador correspondiente al índice que replica el vehículo. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
20	Fecha de Vencimiento del Subyacente		F	8	0	206 213	Anotar la fecha de vencimiento del activo subyacente o del cheapest to deliver (en caso de tener una canasta de subyacentes) cuando exista. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
21	ID Bolsa de Derivados		AN	8	0	214 221	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados en la cual fue adquirida la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
22	Divisa de cotización del subyacente		N	2	0	222 223	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
23	Divisa del tamaño del contrato		N	2	0	224 225	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato, conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
24	Divisa de Liquidación		N	2	0	226 227	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación diaria del contrato según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .



## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

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

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 4 CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición		Observaciones
26	Divisa de Cotización del Subyacente		N	2	0	253 254	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del subyacente o cheapest to deliver conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
27	Divisa del Tamaño del Contrato		N	2	0	255 256	Se deberá anotar el identificador de la divisa asociada al tamaño de contrato conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
28	Divisa de Liquidación		N	2	0	257 258	Se deberá anotar el identificador de la divisa de liquidación al vencimiento del contrato si se liquida por diferenciales, o el identificador de la divisa en la que se encuentra denominado el subyacente si al vencimiento se realiza la entrega del mismo, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
29	Estructura de las Divisas del Precio o Tasa pactada		AN	6	0	259 264	En caso de que la opción tenga como subyacente algún tipo de cambio, se deberá anotar en las tres primeras posiciones el identificador denominado "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene una posición corta y en las siguientes 3 posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa sobre la que se tiene posición larga. En otro caso, solo se deberá anotar en las 3 primeras posiciones el identificador del campo "Descripción" del "Catálogo de Divisas" correspondiente a la divisa en la que está denominado el subyacente o el cheapest to deliver cuando aplique. Para este campo se deberá asumir siempre una posición larga sobre el derivado <sup>4</sup> .
30	Valor a Mercado		N	12	2	265 278	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
31	Monto expuesto		N	12	2	279 292	En este campo se debe anotar la exposición delta de la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>6</sup> .
32	Delta		N	3	8	293 303	Se deberá reportar la delta de la opción y con la cual se lleva a cabo el cálculo de la Exposición Delta <sup>7</sup> .
33	Indicador para cobertura de divisas		N	1	0	304 304	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso <sup>1</sup> .
34	Descriptivo		AN	100	0	305 404	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
35	Espacios vacíos		AN	15	0	405 419	Vacíos <sup>5</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

**DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent.	Dec.	Posición De:	A:	Observaciones
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "305" <sup>1</sup> .
2	Identificador del Instrumento del Mandato		AN	10	0	4	13	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada posición de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>4</sup> .
3	ISIN		AN	12	0	14	25	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>7</sup> .
4	CUSIP O CINS		AN	9	0	26	34	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>8</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	35	41	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>9</sup> .
6	Ticker Bloomberg		AN	20	0	42	61	Se deberá anotar el Ticker que Bloomberg asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>10</sup> .
7	Ticker Reuters		AN	20	0	62	81	Se deberá anotar el Ticker que Reuters asigna al instrumento que se reporta en caso de que exista <sup>11</sup> .
8	Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Entregar		AN	20	0	82	101	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .
9	Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Entregar		AN	20	0	102	121	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a entregar en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
10	Ticker Bloomberg del subyacente de los flujos a Recibir		AN	20	0	122	141	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Bloomberg al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>10</sup> .
11	Ticker Reuters del subyacente de los flujos a Recibir		AN	20	0	142	161	Se deberá anotar, en caso de que exista, el Ticker que asigna Reuters al activo o indicador al cuál están asociados los flujos a recibir en el swap si estos son variables <sup>11</sup> .
12	Fecha de Operación		F	8	0	162	169	En caso de reportar derivados estandarizados, se deberá anotar la fecha de la última operación concertada sobre el swap. En caso de reportar derivados OTC, se deberá anotar la fecha de concertación de la operación <sup>3</sup> .
13	Fecha de Vencimiento Flujos a Entregar		F	8	0	170	177	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a entregar en el swap <sup>3</sup> .
14	Fecha de Vencimiento Flujos a Recibir		F	8	0	178	185	Anotar la fecha en que finalizan los flujos a recibir en el swap <sup>3</sup> .
15	Valor Ncional Flujos a Entregar		N	12	2	186	199	Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a entregar en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
16	Valor Ncional Flujos a Recibir		N	12	2	200	213	Anotar el valor nocional en valor absoluto de los flujos a recibir en el swap en la divisa en la que se pacte <sup>2</sup> .
17	Plazo de flujos a entregar		N	3	0	214	216	Anotar el plazo en días de los flujos a entregar <sup>1</sup> .
18	Plazo de flujos a recibir		N	3	0	217	219	Anotar el plazo en días de los flujos a recibir <sup>1</sup> .
19	Intercambio de Nacionales a Vencimiento		N	1	0	220	220	Anotar 1 si se pacta entrega de nacionales al vencimiento de la operación. Anotar cero en otro caso <sup>1</sup> .
20	Tipo de flujos a Entregar		N	1	0	221	221	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 1 <sup>1</sup> .
21	Tipo de flujos a Recibir		N	1	0	222	222	En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar 0. En caso de tratarse de una estructura de flujos variables se deberá anotar 1 <sup>1</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

DETALLE 5: CONTIENE LA INFORMACIÓN DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS)							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	
22	Tipo de cambio pactado		N	12	6	223 240	Se deberá anotar el tipo de cambio que se pactó para el caso de swaps con nocionales en distinta divisa. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
23	Tasa de Flujos a Entregar		N	3	4	241 247	En caso de que la estructura de flujos a entregar sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
24	Tasa de Flujos a Recibir		N	3	4	248 254	En caso de que la estructura de flujos a recibir sea una estructura de flujos fijos, se deberá anotar el valor de la tasa pactada. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
25	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Entregar		AN	10	0	255 264	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que los flujos a entregar estén ligados a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
26	ID toma de exposición a Renta Variable o Mercancías en Flujos a Recibir		AN	10	0	265 274	Los identificadores de este campo deberán ser definidos en el "Detalle 1" del formato de transmisión 0331, en donde deberán ser reportado en el campo "ID elemento de exposición a Renta Variable o Mercancías". En caso de que los flujos a recibir estén ligados a algún subyacente de Renta Variable o Mercancía, se deberá reportar el indicador asociado a dicho subyacente. En otro caso dejar vacío <sup>4</sup> .
27	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	275 284	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la operación o bolsa de derivados con la cual se abrió la posición. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
28	ID Bolsa de Derivados		AN	10	0	285 294	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la Bolsa de Derivados a la que pertenece la cámara de compensación a través de la cual se llevará a cabo la liquidación del derivado en caso de que aplique, de otra manera dejar vacío. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>4</sup> .
29	Divisa flujos a entregar		N	2	0	295 296	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
30	Divisa flujos a recibir		N	2	0	297 298	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que estén denominados los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisa" <sup>1</sup> .
31	Divisa nacional a entregar		N	2	0	299 300	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nacional de los flujos a entregar conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
32	Divisa nacional a recibir		N	2	0	301 302	Se deberá anotar el identificador de la divisa en la que esté denominado el nacional de los flujos a recibir conforme al "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
33	Divisa de Liquidación		N	2	0	303 304	Se deberá reportar el identificador de la divisa de con la que se estarán liquidando los flujos, según el "Catálogo de Divisas" <sup>1</sup> .
34	Valor a mercado.		N	12	2	305 318	En este campo se debe anotar el valor total a mercado la posición que se reporta en pesos mexicanos <sup>5</sup> .
35	Indicador para cobertura de divisas.		N	1	0	319 319	Se deberá anotar: - 1 en caso de que la posición forme parte de una estructura de cobertura de acuerdo a los términos que se establezcan con las Administradoras. - 0 en otro caso. <sup>1</sup>
36	Descriptivo		AN	100	0	320 419	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud Ent. Dec.	Posición De: A:	Observaciones		
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306" <sup>1</sup> .
2	Tipo de Operación asociada a la Garantía.		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el tipo de operación que origino la recepción de las Garantías según el catálogo de "Tipo de Operación asociada a la Garantía" <sup>1</sup> .
3	Identificador de posición de Garantía Recibida		AN	10	0	5	14	Se reportará un identificador el cual deberá ser único para cada garantía de cada Mandato. Este identificador no se reutilizará por otra posición distinta por lo que no deberá repetirse en el resto de los detalles de este formato y deberá mantenerse sin cambios para cada posición a lo largo del tiempo <sup>1</sup> .
4	Identificador de operación del Mandato asociado a la garantía		AN	10	0	15	24	En caso de que la garantía se reciba por una operación de préstamo de valor o reporte, se deberá anotar el "Identificador del Instrumento del Mandato" que se reporta en el "Detalle 1" del presente formato correspondiente a la operación a la que se asocia la garantía <sup>1</sup> .
5	ISIN		AN	12	0	25	36	Se deberá anotar la clave del ISIN del instrumento que se recibe como garantía <sup>1</sup> .
6	CUSIP O CINS		AN	9	0	37	45	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del instrumento que se recibe como garantía <sup>2</sup> .
7	SEDOL		AN	7	0	46	52	Se deberá anotar la clave del SEDOL del instrumento que se recibe como garantía <sup>2</sup> .
8	Ticker Bloomberg		AN	20	0	53	72	Se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al instrumento que se recibe en garantía <sup>2</sup> .
9	Ticker Reuters		AN	20	0	73	92	Se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al instrumento que se recibe en garantía <sup>11</sup> .
10	Clase de Activo		N	2	0	93	94	Se deberá anotar el identificador de la clase del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Clase de Activo de la inversión tercerizada" <sup>1</sup> .
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	95	106	Se deberá reportar el número de títulos recibidos en garantía <sup>1</sup> .
12	Precio limpio		N	12	2	107	120	En este campo se debe anotar el valor total a mercado de las garantías reportadas a precio y en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
13	Intereses devengados		N	12	2	121	134	En este campo se deberán anotar los intereses devengados de las garantías reportadas en pesos mexicanos <sup>2</sup> .
14	ID Emisor/Contraparte		AN	10	0	135	144	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la contraparte de la cual se reciben las garantías. Estos identificadores se deberán definir en el "Detalle 4" del formato de transmisión 0331, en el campo "ID Emisor/Contraparte" <sup>14</sup> .
15	Divisa de Cotización		N	2	0	145	146	Se deberá anotar el identificador de la divisa de cotización del activo recibido en garantía según el "Catálogo de Divisas" <sup>14</sup> .
16	Valor Nominal		N	8	2	147	156	En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar el Valor Nominal en la Divisa de Cotización del instrumento. En otro caso llenar con ceros <sup>2</sup> .
17	Fecha de Vencimiento		F	8	0	157	164	En caso de reportar instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de vencimiento del instrumento que se reporta. En otro caso anotar 19000101 <sup>3</sup> .

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

**DETALLE 6: CONTIENE LA INFORMACION DE LAS GARANTIAS RECIBIDAS POR OPERACIONES DE REPORTE, PRESTAMO DE VALORES E INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones		
18	Fecha de Emisión		F	8	0	165	172	En caso de estar reportando instrumentos de deuda o estructuras vinculadas a subyacentes recibidos en garantía, se deberá anotar la fecha de emisión del instrumento que se reporta. En otro caso indicar 19000101 <sup>3</sup> .
19	Descriptivo		AN	100	0	173	272	Se deberá anotar una breve descripción del activo. <sup>4</sup>
20	Espacios vacíos		AN	147	0	273	419	Vacios <sup>5</sup> .

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

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

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

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

### CATALOGO(S)

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

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)	
---	--



## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

Clave de Entidad	Descripción
334	PROFUTURO
364	METLIFE

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	
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	Más Pensión Siefore Básica 1, S.A. de C.V.

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
			Básica Uno	
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.

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

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

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
			Voluntarias Uno	
017	652	002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore Banamex de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

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

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

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

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

## Anexo 111

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	24	Eslovaquia
2	Australia	25	Eslovenia
3	Austria	26	Estonia
4	Bélgica	27	Hungría
5	Canadá	28	Letonia
6	Dinamarca	29	Lituania
7	España	30	Malta
8	Estados Unidos de Norteamérica	31	República Checa
9	Finlandia	32	Suecia
10	Francia	33	Brasil
11	Grecia	34	China
12	Países Bajos (Holanda)	35	India

## Anexo 111

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>
---	--	---

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
13	Hong Kong	36	Otro
14	Irlanda	37	Rumanía
15	Italia	38	Noruega
16	Japón	39	Chile
17	Luxemburgo	40	Israel
18	México	41	Bulgaria
19	Polonia	42	Colombia
20	Portugal	43	Corea del Sur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	44	Islandia
22	Suiza	45	Perú
23	Chipre	46	Singapur

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

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

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

## Anexo 111

	FORMATO DEL ARCHIVO : 0330	PROCESO : FINANCIERO
	FUENTE : CUSTODIOS	ACTUALIZACIÓN :

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

### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CER0 para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

<sup>3</sup> Fechas. El formato para fecha deberá ser de 8 caracteres numéricos = "AAAAMMDD" donde:  
DD = día  
MM = mes  
AAAA = año

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

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

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

La 1ª posición de la izquierda se usará para indicar el signo de la cantidad, se anotará un CER0 para cantidades positivas y se anotará el signo "-" para cantidades negativas.

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

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

## Anexo 111

	Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro	
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330 <b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO <b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<sup>8</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

<sup>9</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

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

### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

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

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

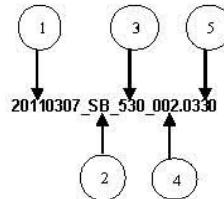


## Anexo 111

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro		
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b> 0330	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b> CUSTODIOS	<b>ACTUALIZACIÓN :</b>

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

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



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

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

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

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

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