

INSTRUCTIVO DE LLENADO BOLSAS DE VALORES

Anexo 5

R03 E-0303 INFORMACIÓN ACUMULADA POR CADA VALOR DE LAS OPERACIONES CELEBRADAS CON VALORES DE RENTA VARIABLE

Contenido

Abreviaciones	2
Fundamento legal del reporte	2
Objetivo del reporte	3
Características generales del reporte	3
Consideraciones generales de los reportes	3
Formato de Captura	4
Anexo 5 R03 E-0303 Información acumulada por cada valor de las operaciones celebradas con valores de renta variable	4
Definición del documento	7

Abreviaciones

CNBV o Comisión	Comisión Nacional Bancaria y de Valores
LCNBV	Ley de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores
CUBV	Disposiciones de carácter general aplicables a las Bolsas de Valores (Circular Única de Bolsas de Valores)
DOF	Diario Oficial de la Federación
SITI	Sistema Interinstitucional de Transferencia de Información
SEDI	Sistema electrónico de envío y difusión de información que, a la Bolsa de que se trate, le sea autorizado por la Comisión.

Fundamento legal del reporte

Las Bolsas de valores deberán enviar la información que se solicita en el Anexo 5 de la CUBV:

- Anexo 5 R03 E-0303 Información acumulada por cada valor de las operaciones celebradas con valores de renta variable

El envío de dicha información deberá efectuarse de acuerdo con lo señalado en las siguientes disposiciones legales:

1. Facultades de la CNBV

LCNBV, Artículo 4º, fracción V: “Corresponde a la Comisión expedir normas respecto a la información que deberán proporcionarle periódicamente las entidades.”

2. Información a reportar y Periodicidad de envío

Artículo 23.- Las Bolsas de valores deberán **enviar de forma diaria** a la Comisión a través del SITI la información acumulada, por cada uno de los valores de renta variable, relativa a las operaciones celebradas en su sistema de negociación, así como aquellos negociados en su sistema internacional de cotizaciones de conformidad con el formato señalado en el **Anexo 5** de las disposiciones. Asimismo, estarán obligadas a revelar al público en general a través del SEDI dicha información.

3. Medio de Envío

Las Bolsas de valores deberán enviar a la Comisión la información a que alude el Anexo 5 de las disposiciones, mediante su **transmisión electrónica utilizando el SITI**

La información deberá enviarse una sola vez y se recibirá asumiendo que reúne todas las características requeridas, en virtud de lo cual no podrá ser modificada, generando el SITI un acuse de recibo electrónico.

Una vez recibida la información será revisada y de no reunir la **calidad y características exigibles** o ser presentada de forma incompleta, se considerará como no cumplida la obligación de su presentación

Las Bolsas de valores notificarán mediante envío electrónico a la dirección cesiti@cnbv.gob.mx, el nombre de la persona responsable de proporcionar la información a que se refiere el Anexo 5 de las disposiciones, en la forma que como modelo se señala en el **Anexo 4** de las disposiciones. La referida designación deberá recaer en directivos que se encuentren dentro de las dos jerarquías inferiores a la de director general de la Bolsa de valores, que tengan a su cargo la responsabilidad del manejo de la información. Asimismo, podrán designar como responsables a más de una persona, en función del tipo de información de que se trate.

La designación o sustitución de cualquiera de las personas responsables del envío y calidad de información, deberá notificarse a la Comisión en los términos antes señalados, dentro de los tres días hábiles siguientes al de su designación o sustitución.

Objetivo del reporte

Los datos recabados de las Bolsas de valores serán la fuente de información para que las Casas de Bolsa estén en posibilidad de calcular la probabilidad de ejecución por emisora, en relación con su deber de mejor ejecución.

Asimismo, este reporte será una fuente de información para fines estadísticos y de supervisión de los participantes del mercado de capitales.

Características generales del reporte

La información solicitada a las Bolsas de valores comprende la información acumulada por emisora relativa a las operaciones celebradas en sus sistemas de negociación, así como aquellos negociados en su sistema internacional de cotizaciones.

Consideraciones generales de los reportes

Este instructivo describe las características específicas que deberá reunir la información solicitada en el Anexo antes mencionado y tiene como finalidad proporcionar al usuario la información general de cada uno de los campos que deberán enviar las bolsas de valores. La definición del documento, así como los catálogos correspondientes, se encuentran disponibles y actualizados en línea en el apartado correspondiente dentro del SITI; **el reporte y los catálogos deberán ser consultados y tomados directamente del mencionado sistema para evitar posibles errores de llenado con los consecuentes problemas de validación.**

El presente instructivo es un documento susceptible de mejora constante, por lo que la versión más actualizada será compartida a través del SITI y disponible en el portal de Internet www.gob.mx/cnbv, en la sección: "Acciones y Programas", "Trámites y Servicios", apartado "Sistema Interinstitucional de Transferencia de Información (SITI)", sección "Instructivos de Llenado".

El Anexo deberá ser enviado en archivo de texto o csv, delimitado por punto y coma.

Todas las columnas que se describen en el Formato de captura **deberán entregarse por cada emisora** que cotice en la Bolsa de valores de que se trate en la fecha que se reporta.

Los datos que se refieren a **importes** se deben presentar en pesos redondeado a 2 decimales.

Los datos que se refieren a **fecha** deberán presentarse con el formato AAAAMMDD (año, mes, día) a reserva que se indique otro formato en la columna del reporte.

Ninguna columna especificada en este instructivo aceptará nulos, vacíos, ni espacios en blanco, así como ningún tipo de abreviaciones como NA, ND, etc.

Formato de Captura

Las Bolsas de valores llevarán a cabo el envío de la información de acuerdo con las especificaciones que se detallan a continuación.

Anexo 5 R03 E-0303 Información acumulada por cada valor de las operaciones celebradas con valores de renta variable

A partir de la entrada en vigor del presente reporte, las columnas que se solicitan son de carácter obligatorio, por lo que no se podrá omitir la información solicitada a menos que se mencione lo contrario de manera expresa en este instructivo.

Este reporte se encuentra dividido en 3 secciones:

1. **Sección identificador del Reporte.** - En esta sección se registran los campos generales como el periodo, la clave de la Bolsa de valores, así como la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar la información por periodo y entidad que está reportando.
2. **Sección datos de la emisora.** - En esta sección se registran los campos para identificar el valor de renta variable de la información que se está reportando
3. **Sección identificador de la operación.** - Esta sección contiene la información acumulada de las operaciones celebradas con valores de renta variable en los sistemas de negociación de la Bolsa de valores de que se trate, así como aquellas celebradas en su sistema internacional de cotizaciones.

El reporte está integrado por **diecinueve (19)** columnas, con las siguientes especificaciones:

ANEXO 5 R03 E-0303 INFORMACIÓN ACUMULADA POR CADA VALOR DE LAS OPERACIONES CELEBRADAS CON VALORES DE RENTA VARIABLE	
Columna	Descripción
I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE	
1	<p>PERIODO</p> <p>Se refiere a la fecha del día hábil que la Bolsa de Valores está reportando la información. Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del contenido del archivo que envía la Bolsa de Valores.</p> <p>El formato para capturar este campo es AAAAMMDD.</p>
2	<p>BOLSA DE VALORES</p> <p>Se refiere a la clave CASFIM de la Bolsa de Valores que está reportando la información. Dicha clave consta de seis dígitos y deberá seleccionarse del catálogo "Instituciones".</p> <p>Las claves del catálogo "Instituciones" se encuentran disponibles para su consulta en el SITI</p>
3	<p>REPORTE</p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave "303" que se obtiene del catálogo "Subreportes CC".</p>

ANEXO 5 R03 E-0303 INFORMACIÓN ACUMULADA POR CADA VALOR DE LAS OPERACIONES CELEBRADAS CON VALORES DE RENTA VARIABLE	
Columna	Descripción
II. SECCIÓN DATOS DE LA EMISORA	
4	<p>TIPO DE VALOR</p> <p>La clave de tipo valor de la emisora que se reporta será de acuerdo al catálogo que publique el S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V. Dicha clave deberá de tomarse del catálogo "Tipo Valor Indeval" que se encuentra disponible para su consulta en el SITI.</p> <p>En caso de que una clave del Catálogo de Indeval no se encuentre en el SITI, deberá de solicitarse mediante correo a la dirección de calidadinfo@cnbv.gob.mx</p>
5	<p>EMISORA</p> <p>Se refiere al <i>ticker</i> de la Emisora que se reporta.</p>
6	<p>SERIE</p> <p>Se refiere a la serie que corresponde a la Emisora que se reporta.</p>
III. SECCIÓN IDENTIFICADOR DE LA OPERACION	
7	<p>NÚMERO DE MENSAJES RECIBIDOS</p> <p>Número de mensajes totales por emisora que recibió la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta. Se deberá incluir el total de mensajes de órdenes, modificaciones y cancelaciones.</p>
8	<p>NÚMERO DE ÓRDENES DE COMPRA RECIBIDAS</p> <p>Número de órdenes de compra totales por emisora que recibió la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta</p>
9	<p>NÚMERO DE ÓRDENES DE VENTA RECIBIDAS</p> <p>Número de órdenes de venta totales por emisora que recibió la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>
10	<p>NÚMERO DE HECHOS REGISTRADOS</p> <p>Número total de los hechos registrados por emisora en la Bolsa de valores, durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta. Este campo deberá considerar los hechos derivados tanto de posturas pasivas como posturas activas.</p>
11	<p>IMPORTE DIARIO OPERADO</p> <p>Importe agregado total por emisora de los hechos registrados en la Bolsa de valores, durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p> <p>Este dato se capturará con 2 decimales</p>

ANEXO 5 R03 E-0303 INFORMACIÓN ACUMULADA POR CADA VALOR DE LAS OPERACIONES CELEBRADAS CON VALORES DE RENTA VARIABLE	
Columna	Descripción
12	<p>NÚMERO DE ÓRDENES QUE FUERON CANCELADAS</p> <p>Número de mensajes totales por cada emisora que recibió la Bolsa de valores para cancelar una postura durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>
13	<p>NÚMERO DE ÓRDENES QUE FUERON MODIFICADAS DURANTE EL DÍA</p> <p>Número de órdenes por emisora que recibió la Bolsa de valores para modificar una postura existente durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>
14	<p>IMPORTE PROMEDIO POR OPERACIÓN QUE SE NEGOCIÓ EN EL DÍA</p> <p>Importe promedio por emisora de las operaciones o hechos registrados durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p> <p>Este dato se capturará con 2 decimales</p>
15	<p>VOLUMEN PROMEDIO POR OPERACIÓN QUE SE NEGOCIÓ EN EL DÍA</p> <p>Volumen promedio por emisora de las operaciones o hechos registrados durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>
16	<p>IMPORTE PROMEDIO POR ORDEN DE COMPRA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA</p> <p>Importe promedio de las órdenes de compra por emisora enviadas a la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p> <p>Este dato se capturará con 2 decimales</p>
17	<p>VOLUMEN PROMEDIO POR ORDEN DE COMPRA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA</p> <p>Volumen promedio de las órdenes de compra por emisora enviadas a la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>
18	<p>IMPORTE PROMEDIO POR ORDEN DE VENTA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA</p> <p>Importe promedio por emisora de las órdenes de venta enviadas a la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p> <p>Este dato se capturará con 2 decimales</p>
19	<p>VOLUMEN PROMEDIO POR ORDEN DE VENTA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA</p> <p>Volumen promedio de las órdenes de venta enviadas a la Bolsa de valores durante el horario de negociación, respecto del día hábil que se reporta.</p>

Definición del documento

ANEXO 5				
R03 E-0303 INFORMACIÓN ACUMULADA POR CADA VALOR DE LAS OPERACIONES CELEBRADAS CON VALORES DE RENTA VARIABLE				
ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD MÁXIMA	DECIMALES
I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE				
1	PERIODO	Numérico	8	0
2	BOLSA DE VALORES	Numérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	3	0
II. SECCIÓN DATOS DE LA EMISORA				
4	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
5	EMISORA	Alfanumérico	8	0
6	SERIE	Alfanumérico	6	0
III. SECCIÓN IDENTIFICADOR DE LA OPERACIÓN				
7	NÚMERO DE MENSAJES RECIBIDOS	Numérico	12	0
8	NÚMERO DE ÓRDENES DE COMPRA RECIBIDAS	Numérico	12	0
9	NÚMERO DE ÓRDENES DE VENTA RECIBIDAS	Numérico	12	0
10	NÚMERO DE HECHOS REGISTRADOS	Numérico	15	0
11	IMPORTE DIARIO OPERADO	Numérico	15	2
12	NÚMERO DE ÓRDENES QUE FUERON CANCELADAS	Numérico	12	0
13	NÚMERO DE ÓRDENES QUE FUERON MODIFICADAS DURANTE EL DÍA	Numérico	12	0
14	IMPORTE PROMEDIO POR OPERACIÓN QUE SE NEGOCIÓ EN EL DÍA	Numérico	15	2
15	VOLÚMEN PROMEDIO POR OPERACIÓN QUE SE NEGOCIÓ EN EL DÍA	Numérico	12	0
16	IMPORTE PROMEDIO POR ÓRDEN DE COMPRA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA	Numérico	15	2
17	VOLÚMEN PROMEDIO POR ÓRDEN DE COMPRA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA	Numérico	12	0
18	IMPORTE PROMEDIO POR ÓRDEN DE VENTA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA	Numérico	15	2
19	VOLÚMEN PROMEDIO POR ÓRDEN DE VENTA QUE SE RECIBIÓ EN EL DÍA	Numérico	12	0