

**FONDOS DE INVERSIÓN**  
**SERIE R03 INVERSIONES EN VALORES**  
**OPERACIONES DE REPORTO Y DE PRÉSTAMO E INSTRUMENTOS**  
**FINANCIEROS DERIVADOS**  
**INSTRUCTIVO DE LLENADO**

**Contenido**

Abreviaciones y definiciones .....	3
Fundamento legal del reporte .....	3
Objetivo de los reportes.....	4
Características generales de los reportes.....	5
Consideraciones generales de los reportes .....	6
Formato de entrega .....	8
<b>R03 B-0321 Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporte (CO-RE) .....</b>	<b>8</b>
Definición del Documento Reporte Diario: .....	15
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	16
<b>R03 B-0322 Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR) .....</b>	<b>17</b>
Definición del Documento Reporte Diario: .....	23
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	24
<b>R03 B-0323 Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE) .....</b>	<b>25</b>
Definición del Documento Reporte Diario: .....	34
<b>R03 E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV) ....</b>	<b>35</b>
Definición del Documento Reporte Diario: .....	48
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	49
<b>R03 J-0311 Cartera de inversión (CO-CA) .....</b>	<b>50</b>
Definición del Documento Reporte Diario: .....	58
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	59
Definición del Documento Reporte Anual: .....	60

<b>R03 J-0312 Provisión de intereses devengados sobre valores (CO-IN)</b> .....	61
Definición del Documento Reporte Diario: .....	68
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	69
<b>R03 J-0313 Control de garantías (CO-GA)</b> .....	70
Definición del Documento Reporte Diario: .....	78
Definición del Documento Reporte Trimestral:.....	79

## Abreviaciones y definiciones

<b>LCNBV</b>	Ley de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.
<b>CNBV o Comisión</b>	Comisión Nacional Bancaria y de Valores.
<b>LFI o Ley</b>	Ley de Fondos de Inversión
<b>CUFI o Disposiciones</b>	Disposiciones de carácter general aplicables a los fondos de inversión y a las personas que les prestan servicios (Circular Única de Fondos de Inversión)
<b>CASFIM</b>	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano.
<b>SITI</b>	Sistema Interinstitucional de Transferencia de Información.

## Fundamento legal del reporte

Los fondos de inversión de renta variable, fondos de inversión en instrumentos de deuda, fondos de inversión de capitales, las sociedades operadoras de fondos de inversión y las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión deberán enviar la información que se solicita en el reporte:

- R03 B-0321 Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporto (CO-RE);
- R03 B-0322 Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR);
- R03 B-0323 Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE);
- R03 E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV);
- R03 J-0311 Cartera de inversión (CO-CA);
- R03 J-0312 Provisión de intereses devengados sobre instrumentos financieros (CO-IN); y
- R03 J-0313 Control de garantías (CO-GA)

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

### 1. Facultades de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV)

**Artículo 4º, fracción V de la LCNBV:** “Expedir normas respecto a la información que deberán proporcionarles periódicamente las entidades.”

### 2. Respeto de los Reportes Regulatorios

**Artículo 79º Bis de la LFI:** “Los fondos de inversión estarán obligados a proporcionar a la Comisión, a sus accionistas y al público en general, la información continua, periódica y la relativa a Eventos Relevantes, a través de los medios de comunicación y en los términos que la citada Comisión determine mediante disposiciones de carácter general.”

### 3. Información a reportar y periodicidad de entrega

**Artículo 80° de la CUF:** “Los fondos de inversión, las sociedades operadoras de fondos de inversión, las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión, las entidades financieras que proporcionen servicios de distribución de acciones de fondos de inversión y las sociedades valuadoras de acciones de fondos de inversión, deberán proporcionar a la Comisión, con la periodicidad establecida en los artículos siguientes, la información financiera que se indica en el Anexo 8 de estas disposiciones, la cual se identifica con las series y tipos de reportes que a continuación se relacionan:”

**Artículo 81° de la CUF:** “Los fondos de inversión, las sociedades operadoras de fondos de inversión, las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión y las sociedades valuadoras de acciones de fondos de inversión presentarán a la Comisión la información a que se refiere el artículo anterior, con la periodicidad que a continuación se indica: ...”

### 4. Medio de entrega

**Artículo 84° de la CUF:** “Los fondos de inversión, las sociedades operadoras de fondos de inversión, las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión y las sociedades valuadoras de acciones de fondos de inversión, salvo disposición expresa en contrario, deberán enviar a la Comisión la información que se menciona en este Título, mediante su transmisión vía electrónica, utilizando el SITI. En caso de que no exista información de algún reporte, las entidades deberán realizar el envío vacío, funcionalidad que está disponible en dicho sistema.

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 o fuera del plazo establecido para ello, se considerará como no cumplida la obligación de su presentación y, en consecuencia, se procederá a la imposición de las sanciones correspondientes.”

### Objetivo de los reportes

El reporte regulatorio **R03 B-0321 Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporto (CO-RE)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar cada una de las operaciones de reporto realizadas por las entidades del sector fondos de inversión.

El reporte regulatorio **R03 B-0322 Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar las operaciones de préstamos de valores que realizan los fondos de inversión con los activos objeto de inversión que integran sus carteras.

El reporte regulatorio **R03 B-0323 Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar las operaciones con derivados realizadas por los fondos de inversión.

El reporte regulatorio **R03 E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar las operaciones de compras y ventas de activos objeto de inversión realizadas por las entidades del sector fondos de inversión.

El reporte regulatorio **R03 J-0311 Cartera de inversión (CO-CA)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar, al cierre del día, el total de activos objeto de inversión que son propiedad de cada una de las entidades del sector de fondos de inversión, con independencia de su fecha de liquidación.

El reporte regulatorio **R03 J-0312 Provisión de intereses devengados sobre instrumentos financieros (CO-IN)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar los intereses devengados por los instrumentos financieros e inversiones adquiridos y realizadas por las entidades del sector fondos de inversión.

El reporte regulatorio **R03 J-0313 Control de garantías (CO-GA)** de la serie R03, tiene como objetivo mostrar los activos objeto de inversión recibidos o entregados en garantías por operaciones de reportos, préstamos de instrumentos financieros y derivados celebradas por las entidades del sector fondos de inversión.

## **Características generales de los reportes**

- 1. R03 B-0321 Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporto (CO-RE).**  
En este reporte se detallan las partes y los elementos que intervienen en las operaciones de reporto celebradas por las entidades del sector fondos de inversión.
- 2. R03 B-0322 Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR).**  
Este reporte refleja los elementos que identifican a las operaciones de préstamo de instrumentos financieros llevadas a cabo por las entidades del sector fondos de inversión.
- 3. R03 B-0323 Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE).**  
Este reporte muestra todos los elementos que intervienen en las operaciones financieras derivadas que pueden celebrar las entidades del sector fondos de inversión.
- 4. R03 E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV).**  
En este reporte se muestran las cantidades y condiciones generales de todas y cada una de las operaciones de compras y ventas de los activos objeto de inversión que realizan las entidades del sector fondos de inversión.

**5. R03 J-0311 Cartera de inversión (CO-CA).**

El reporte de ésta serie contiene las características de los activos objeto de inversión que conforman la cartera total de la entidad en el período a reportar.

**6. R03 J-0312 Provisión de intereses devengados sobre instrumentos financieros (CO-IN).**

En este reporte se detallan los elementos de los activos objeto de inversión que devengan intereses de las inversiones hechas por las entidades del sector fondos de inversión.

**7. R03 J-0313 Control de garantías (CO-GA).**

Este reporte muestra todas aquellas garantías recibidas y otorgadas en las operaciones de reporte, préstamo y financieras derivadas realizadas por las entidades del sector fondos de inversión.

## **Consideraciones generales de los reportes**

Este instructivo contiene las características de los reportes, y tiene como finalidad proporcionar información relativa a los datos que deberán enviar las entidades del sector fondos de inversión. Sin embargo es importante indicar que, la definición de los documentos y los catálogos correspondientes, se encuentran disponibles y actualizados en línea en los apartados correspondientes dentro del Sistema Interinstitucional de Transferencia de Información (SITI); **por lo que deberán ser consultados y tomados directamente del mencionado sistema para evitar posibles errores de llenado y problemas de validación.**

La información solicitada para cada uno de los reportes aquí incluidos, referente a las características particulares de los valores negociados, de las operaciones realizadas, de las posiciones de la cartera y de las garantías entregadas o recibidas, deberá ser la misma que la reportada por el proveedor de precios contratado por el fondo de que se trate.

Adicionalmente, es importante mencionar que el presente instructivo es un documento susceptible de mejora constante, por lo que la versión más actualizada será hecha del conocimiento de las entidades a través de SITI.

La periodicidad de envío del reporte **Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporte (CO-RE)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda, mientras que para las sociedades operadoras de fondos de inversión y las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

La periodicidad de envío del reporte **Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda.

El envío del reporte **Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda,

mientras que, para los fondos de inversión de capitales, las sociedades operadoras de fondos de inversión y las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

La periodicidad de envío del reporte **Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda, mientras que para los fondos de inversión de capitales, las sociedades operadoras de fondos de inversión, las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión y las sociedades valuadoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

En adición a lo señalado en el párrafo anterior, los fondos de inversión de capitales deberán enviar a la Comisión los reportes E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV) y J-0311 Cartera de inversión (CO-CA) de la Serie R03, a más tardar el quinto día hábil siguiente a la fecha en que hayan celebrado operaciones de compra o venta de activos objeto de inversión.

El envío del reporte **Cartera de inversión (CO-CA)** es diaria y anual para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda, para los fondos de inversión de capitales es trimestral, para las sociedades operadoras de fondos de inversión es trimestral y anual, mientras que para las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

La periodicidad de envío del reporte **Provisión de intereses devengados sobre instrumentos financieros (CO-IN)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda, mientras que, para los fondos de inversión de capitales, las sociedades operadoras de fondos de inversión y las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

El envío del reporte **Control de garantías (CO-GA)** es diaria para los fondos de inversión de renta variable y fondos de inversión en instrumentos de deuda, mientras que para las sociedades operadoras de fondos de inversión y las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión es trimestral.

Resulta conveniente destacar que, en el caso de la información enviada en forma trimestral, el reporte deberá incluir todas las operaciones celebradas durante el período que abarque el trimestre del que se trate.

Los reportes mencionados anteriormente serán enviados en archivos de texto, delimitados por punto y coma “;”.

Los datos que se refieren a saldos, montos e importes, se deben presentar en pesos.

Los datos que se refieran a fecha o período, deberán presentarse con el formato AAAAMMDD (año, mes, día), y en su caso con el formato AAAAMM (año, mes).

Los datos que se refieran a porcentajes y tasas, se deberán presentar en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo %. Ejemplo: si la tasa de interés es del 37.5792812%, deberá anotarse 37.579281.

### Formato de entrega

Los fondos de inversión de renta variable, fondos de inversión en instrumentos de deuda, fondos de inversión de capitales, las sociedades operadoras de fondos de inversión, las sociedades distribuidoras de acciones de fondos de inversión y las sociedades valuadoras de acciones de fondos de inversión llevarán a cabo el envío de la información de los reportes mencionados de acuerdo con las siguientes especificaciones:

### R03 B-0321 Desglose de instrumentos financieros adquiridos en reporto (CO-RE)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección información detallada por operación e instrumento de inversión.*- Contiene los campos necesarios para poder identificar los instrumentos financieros adquiridos en operaciones realizadas por las entidades del sector de fondos de inversión.

El reporte está conformado por **21 (veintiuna)** columnas, las cuales se describen a continuación:

R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN REPORTO (CO-RE)	
Column	Descripción
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<p><b>PERÍODO</b></p> <p>Se refiere al período diario o trimestral de la información que está reportando la entidad.</p>



## R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN REPORTO (CO-RE)

Column	Descripción						
	<p>Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.</p> <p>Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 01 de diciembre de 2022, se capturará: 20221201.</p> <p>En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturará: 202204.</p>						
<b>2</b>	<p><b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b></p> <p>Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.</p> <p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado "Instituciones" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El formato para capturar este campo es #####.</p>						
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>321</b> que se puede obtener del catálogo "Subreportes" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>						
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN E INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>							
<b>4</b>	<p><b>PRÓRROGA</b></p> <p>En ésta columna se debe especificar si la operación es realizada Con prórroga o Sin prórroga.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el "Catálogo de Prórroga de Reportos y Préstamos", el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td style="text-align: center;">Con Prórroga</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td style="text-align: center;">Sin Prórroga</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Con Prórroga	102	Sin Prórroga
CLAVE	DESCRIPCIÓN						
101	Con Prórroga						
102	Sin Prórroga						

## R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN REPORTO (CO-RE)

Column	Descripción
	Las claves del “Catálogo de Prórroga de Reportos y Préstamos” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.
<b>5</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación de reporte.</p>
<b>6</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie proporcionada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación de reporte</p>
<b>7</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>
<b>8</b>	<p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS</b></p> <p>Se refiere al número de títulos en unidades del instrumento que se haya pactado en la operación.</p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>
<b>9</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL Y EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo anterior.</p>
<b>10</b>	<p><b>PRECIO DE ENTRADA</b></p> <p>Corresponde el precio al que haya sido asignado el instrumento de que se trate.</p>

**R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN  
REPORTO (CO-RE)**

Column	Descripción
	<p>Deberá anotarse en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el precio es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>
<p align="center"><b>11</b></p>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA DEL REPORTO</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los instrumentos financieros de que se traten. Así mismo, dicho número deberá corresponder con el reportado en el CO-CA, CO-CV y, en su caso, en el CO-GA.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderán al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de reporto celebrada el 2 de enero de 2022, en la cual la entidad haya participado como reportadora, y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería “102202201020020”, el cual estaría integrado de la siguiente forma: 102, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p> <p>Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.</p>
<p align="center"><b>12</b></p>	<p><b>TIPO DE CONTRAPARTE</b></p> <p>Se debe anotar la clave CASFIM que corresponde a la contraparte con la que se haya pactado la operación.</p> <p>Las claves CASFIM de las contrapartes se encuentran disponibles para su consulta en el SITI, en el “Catálogo de Instituciones”.</p>

**R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN  
REPORTO (CO-RE)**

Column	Descripción
13	<p><b>DÍAS POR VENCER DEL REPORTO</b></p> <p>Indicar el número de días al vencimiento de la operación, contados a partir del día hábil siguiente a la fecha del reporte. Este plazo deberá ser consistente con el reportado en el CO-CA.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
14	<p><b>PLAZO TOTAL DEL REPORTO</b></p> <p>Se deberá anotar el número de días pactado de la operación, sin decimales y sin comas.</p> <p>Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
15	<p><b>TASA PREMIO</b></p> <p>Registrar la tasa premio pactada de la operación.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>
16	<p><b>PRECIO DE SALIDA</b></p> <p>Registrar el precio de salida del instrumento reportado, calculado como la suma del precio de entrada más el premio que corresponda para la tasa y plazo pactado.</p> <p>Se deberá anotar en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el precio es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>
17	<p><b>VALOR RAZONABLE DEL TÍTULO REPORTADO</b></p> <p>Registrar el valor razonable del título, que haya sido determinado con la información proporcionada por el proveedor de precios contratado por la entidad de que se trate, incluyendo en su caso, los intereses devengados no cobrados.</p> <p>Se deberá anotar en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el precio es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>

## R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN REPORTO (CO-RE)

Column	Descripción										
<b>18</b>	<p><b>TIPO DE INVERSIÓN (REPORTADO/REPORTADOR)</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Figura de Contraparte”, que se utiliza para operaciones de reporto y de préstamo, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td style="text-align: center;">Reportador</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td style="text-align: center;">Reportado</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td style="text-align: center;">Prestamista</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td style="text-align: center;">Prestatario</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Figura de Contraparte” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Reportador	102	Reportado	103	Prestamista	104	Prestatario
CLAVE	DESCRIPCIÓN										
101	Reportador										
102	Reportado										
103	Prestamista										
104	Prestatario										
<b>19</b>	<p><b>CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA CONTRAPARTE</b></p> <p>Registrar la calificación que la operadora asigne a la Contraparte de la operación del reporto, conforme a sus políticas internas.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el “Catálogo de Calificación de la Contraparte FI” el cual se encuentra disponible para su consulta en el SITI.</p>										
<b>20</b>	<p><b>TASA DE MERCADO DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Reportar la tasa de valuación proporcionada por el proveedor de precios contratado por la entidad de que se trate y que permita determinar el “Valor razonable del título reportado”.</p> <p>Deberá reportarse expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>										
<b>21</b>	<p><b>MONEDA EN LA QUE SE PACTA LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado “Catálogo de Monedas Países CC”, con la que fue concertado el premio de la operación.</p>										

**R03 B-0321 DESGLOSE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS ADQUIRIDOS EN  
REPORTO (CO-RE)**

<b>Column</b>	<b>Descripción</b>
	<p>Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Monedas Países CC” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN E INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>				
4	PRÓRROGA	Numérico	3	0
5	EMISORA	Alfanumérico	7	0
6	SERIE	Alfanumérico	10	0
7	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
8	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
9	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	PRECIO DE ENTRADA	Numérico	16	6
11	NÚMERO DE REFERENCIA DEL REPORTE	Numérico	15	0
12	TIPO DE CONTRAPARTE	Alfanumérico	6	0
13	DÍAS POR VENCER DEL REPORTE	Numérico	6	0
14	PLAZO TOTAL DEL REPORTE	Numérico	6	0
15	TASA PREMIO	Numérico	16	6
16	PRECIO DE SALIDA	Numérico	16	6
17	VALOR RAZONABLE DEL TÍTULO REPORTADO	Numérico	16	6
18	TIPO DE INVERSIÓN (REPORTADO/REPORTADOR)	Numérico	3	0
19	CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
20	TASA DE MERCADO DE LA OPERACIÓN	Numérico	16	6
21	MONEDA EN LA QUE SE PACTA LA OPERACIÓN	Numérico	4	0

## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN E INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>				
4	PRÓRROGA	Numérico	3	0
5	EMISORA	Alfanumérico	7	0
6	SERIE	Alfanumérico	10	0
7	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
8	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
9	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	PRECIO DE ENTRADA	Numérico	16	6
11	NÚMERO DE REFERENCIA DEL REPORTO	Numérico	15	0
12	TIPO DE CONTRAPARTE	Alfanumérico	6	0
13	DÍAS POR VENCER DEL REPORTO	Numérico	6	0
14	PLAZO TOTAL DEL REPORTO	Numérico	6	0
15	TASA PREMIO	Numérico	16	6
16	PRECIO DE SALIDA	Numérico	16	6
17	VALOR RAZONABLE DEL TÍTULO REPORTADO	Numérico	16	6
18	TIPO DE INVERSIÓN (REPORTADO/REPORTADOR)	Numérico	3	0
19	CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
20	TASA DE MERCADO DE LA OPERACIÓN	Numérico	16	6
21	MONEDA EN LA QUE SE PACTA LA OPERACIÓN	Numérico	4	0



## R03 B-0322 Préstamo de instrumentos financieros (CO-PR)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección valores prestados por el fondo de inversión.*- Contiene los campos necesarios para poder identificar los valores objeto de la operación.

El reporte está conformado por **21 (veintiuna)** columnas, las cuales se describen a continuación:

<b>R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<p><b>PERÍODO</b></p> <p>Se refiere al período diario o trimestral de la información que está reportando la entidad.</p> <p>Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.</p> <p>Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 01 de diciembre de 2022, se capturará: 20221201.</p> <p>En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturará: 202204.</p>
<b>2</b>	<p><b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b></p> <p>Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.</p> <p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado "Instituciones" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p>

<b>R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	El formato para capturar este campo es #####.
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>322</b> que se puede obtener del catálogo "Subreportes" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>
<b>II. SECCIÓN VALORES PRESTADOS POR EL FONDO DE INVERSIÓN</b>	
<b>4</b>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTE, PRÉSTAMO, DERIVADO</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los valores de que se traten. Así mismo, dicho número deberá corresponder con el reportado en el CO-CA, CO-CV y, en su caso, en el CO-GA.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del "Catálogo de Tipo de Inversión FI", los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderán al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de préstamo celebrada el 2 de enero de 2022, en la cual la entidad haya participado como prestamista, y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería "105202201020020", el cual estaría integrado de la siguiente forma: 105, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p> <p>Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.</p>
<b>5</b>	<p><b>PRÓRROGA</b></p> <p>En ésta columna se debe especificar si la operación es realizada Con prórroga o Sin prórroga.</p> <p>Se aplicarán las opciones que contiene el "Catálogo de Prórroga de Reportos y Préstamos". Las opciones son las siguientes:</p>

## R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)

Columnna	Descripción														
	<table border="1" style="margin: auto; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr style="background-color: #cccccc;"> <th style="width: 15%;">CLAVE</th> <th style="width: 85%;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>Con Prórroga</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>Sin Prórroga</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Prórroga de Reportos y Préstamos” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Con Prórroga	102	Sin Prórroga								
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	Con Prórroga														
102	Sin Prórroga														
<b>6</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación de préstamo.</p>														
<b>7</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie proporcionada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación de préstamo.</p>														
<b>8</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>														
<b>9</b>	<p><b>BURSÁTILIDAD DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>El grado de Bursátilidad de las acciones deberá identificarse con la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Índice de Bursátilidad”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin: auto; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr style="background-color: #cccccc;"> <th style="width: 15%;">CLAVE</th> <th style="width: 85%;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>BURSÁTILIDAD ALTA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>BURSÁTILIDAD MEDIA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>BURSÁTILIDAD BAJA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>BURSÁTILIDAD MÍNIMA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>BURSÁTILIDAD NULA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>NO APLICA</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Índice de Bursátilidad” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BURSÁTILIDAD ALTA	102	BURSÁTILIDAD MEDIA	103	BURSÁTILIDAD BAJA	104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA	105	BURSÁTILIDAD NULA	106	NO APLICA
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	BURSÁTILIDAD ALTA														
102	BURSÁTILIDAD MEDIA														
103	BURSÁTILIDAD BAJA														
104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA														
105	BURSÁTILIDAD NULA														
106	NO APLICA														

<b>R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	El responsable de enviar ésta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.
<b>10</b>	<p><b>CALIFICACIÓN DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>Se anotará la clave que corresponda a la calificación vigente asignada por la Institución Calificadora de Valores a la emisión o serie del instrumento, conforme al “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda”.</p> <p>La clave 101 No aplica, se utilizará únicamente en los instrumentos que no tengan la obligación de estar calificados.</p> <p>En caso de que el instrumento cuente con calificaciones emitidas por distintas calificadoras, deberá registrarse la que represente mayor riesgo.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
<b>11</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo anterior.</p>
<b>12</b>	<p><b>TÍTULOS OBJETO DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se refiere al número de títulos del instrumento que se haya pactado en la operación.</p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>
<b>13</b>	<p><b>PRECIO AL QUE SE PACTÓ EL PRÉSTAMO</b></p> <p>En su caso, corresponderá al precio al que haya sido pactado el instrumento de que se trate.</p>

<b>R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Se deberá anotar en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el precio es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.
<b>14</b>	<p><b>PLAZO DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se deberá anotar el número de días pactado de la operación.</p> <p>Se deberá anotar en días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
<b>15</b>	<p><b>CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave CASFIM que corresponde a la contraparte con la que se haya pactado la operación.</p> <p>Las claves CASFIM de las contrapartes se encuentran disponibles para su consulta en el SITI, en el "Catálogo de Instituciones".</p>
<b>16</b>	<p><b>PREMIO</b></p> <p>Se deberá registrar el monto del premio, correspondiente al total de la operación.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>17</b>	<p><b>FECHA DE INICIO DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la fecha en que la entidad celebró la operación.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>
<b>18</b>	<p><b>FECHA DE VENCIMIENTO DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la fecha en que llega a su vencimiento la operación.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>
<b>19</b>	<p><b>NÚMERO DE PRÓRROGA</b></p> <p>Se debe registrar el número de prórroga en orden ascendente.</p> <p>Se deberá anotar sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>

**R03 B-0322 PRÉSTAMO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS (CO-PR)**

Columna	Descripción														
<p><b>20</b></p>	<p><b>CALIFICACIÓN DE LA CONTRAPARTE</b></p> <p>Registrar la calificación que la operadora asigne a la Contraparte de la operación del préstamo, conforme a sus políticas internas.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el “Catálogo de Calificación de la Contraparte FI” el cual se encuentra disponible para su consulta en el SITI.</p>														
<p><b>21</b></p>	<p><b>CLAVE CALIFICADORA</b></p> <p>Se deberá anotar la clave correspondiente de la Institución Calificadora de Valores que otorga la calificación a la contraparte de la operación.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Claves Calificadoras”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="542 1003 1279 1268"> <thead> <tr> <th>CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>025003</td> <td>Fitch México, S.A. de C.V.</td> </tr> <tr> <td>025006</td> <td>Standard and Poors, S.A. de C.V.</td> </tr> <tr> <td>025014</td> <td>HR Ratings de México, S.A. de C.V.</td> </tr> <tr> <td>025015</td> <td>Moody's de México, S.A. de C.V.</td> </tr> <tr> <td>025016</td> <td>Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.</td> </tr> <tr> <td>025017</td> <td>A.M. Best América Latina, S.A. de C.V.</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Claves Calificadoras” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	025003	Fitch México, S.A. de C.V.	025006	Standard and Poors, S.A. de C.V.	025014	HR Ratings de México, S.A. de C.V.	025015	Moody's de México, S.A. de C.V.	025016	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	025017	A.M. Best América Latina, S.A. de C.V.
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
025003	Fitch México, S.A. de C.V.														
025006	Standard and Poors, S.A. de C.V.														
025014	HR Ratings de México, S.A. de C.V.														
025015	Moody's de México, S.A. de C.V.														
025016	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.														
025017	A.M. Best América Latina, S.A. de C.V.														

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN VALORES PRESTADOS POR EL FONDO DE INVERSIÓN</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
5	PRÓRROGA	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	BURSATILIDAD DEL INSTRUMENTO	Numérico	3	0
10	CALIFICACIÓN DEL INSTRUMENTO	Numérico	3	0
11	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
12	TÍTULOS OBJETO DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
13	PRECIO AL QUE SE PACTÓ EL PRÉSTAMO	Numérico	16	6
14	PLAZO DE LA OPERACIÓN	Numérico	6	0
15	TIPO CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN	Alfanumérico	6	0
16	PREMIO	Numérico	21	0
17	FECHA DE INICIO DE LA OPERACIÓN	Fecha	8	0
18	FECHA DE VENCIMIENTO DE LA OPERACIÓN	Fecha	8	0
19	NÚMERO DE PRÓRROGA	Numérico	6	0
20	CALIFICACIÓN DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
21	CLAVE CALIFICADORA	Alfanumérico	6	0

## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN VALORES PRESTADOS POR EL FONDO DE INVERSIÓN</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
5	PRÓRROGA	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	BURSATILIDAD DEL INSTRUMENTO	Numérico	3	0
10	CALIFICACIÓN DEL INSTRUMENTO	Numérico	3	0
11	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
12	TÍTULOS OBJETO DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
13	PRECIO AL QUE SE PACTÓ EL PRÉSTAMO	Numérico	16	6
14	PLAZO DE LA OPERACIÓN	Numérico	6	0
15	TIPO CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN	Alfanumérico	6	0
16	PREMIO	Numérico	21	0
17	FECHA DE INICIO DE LA OPERACIÓN	Fecha	8	0
18	FECHA DE VENCIMIENTO DE LA OPERACIÓN	Fecha	8	0
19	NÚMERO DE PRÓRROGA	Numérico	6	0
20	CALIFICACIÓN DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
21	CLAVE CALIFICADORA	Alfanumérico	6	0



## R03 B-0323 Operaciones con instrumentos financieros derivados (CO-DE)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección información detallada.*- Contiene los campos necesarios para poder identificar las operaciones con instrumentos financieros derivados realizadas por las entidades.

El reporte está conformado por **29 (veintinueve)** columnas, las cuales se describen a continuación:

<b>R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CO-DE)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<b>PERÍODO</b> Se refiere al período diario de la información que está reportando la entidad. Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad. Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 01 de diciembre de 2022, se capturará: 20221201.
<b>2</b>	<b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b> Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada. Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado "Instituciones" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo. El formato para capturar este campo es #####.

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CO-DE)**

Columna	Descripción
3	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>323</b> que se puede obtener del catálogo “Subreportes” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA</b>	
4	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los valores de que se traten. Así mismo, dicho número deberá corresponder con el reportado en el CO-CA, CO-CV y, en su caso, en el CO-GA.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderán al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de derivados celebrada el 2 de enero de 2022 y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería “106202201020020”, el cual estaría integrado de la siguiente forma: 106, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p> <p>Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.</p>
5	<p><b>TIPO DE DERIVADO</b></p> <p>Se refiere al tipo de operaciones derivadas, previstas en las Reglas para la realización de operaciones derivadas (las Reglas), emitidas por el Banco de México.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Derivado SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p>

## R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CO-DE)

Columna	Descripción																
	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>OPERACIONES A FUTURO</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>OPERACIONES DE OPCIÓN</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>OPERACIONES DE INTERCAMBIO (SWAPS)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>OPERACIONES ESTRUCTURADAS</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARDS)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">107</td> <td>OPERACIONES CON PAQUETES</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Tipo de Derivado SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>El Catálogo anterior, no autoriza a las entidades a realizar operaciones derivadas diferentes a las previstas en las Reglas ni a las que estuvieran sujetas por parte de la Comisión.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	OPERACIONES A FUTURO	102	OPERACIONES DE OPCIÓN	103	OPERACIONES DE INTERCAMBIO (SWAPS)	104	OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO	105	OPERACIONES ESTRUCTURADAS	106	OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARDS)	107	OPERACIONES CON PAQUETES
CLAVE	DESCRIPCIÓN																
101	OPERACIONES A FUTURO																
102	OPERACIONES DE OPCIÓN																
103	OPERACIONES DE INTERCAMBIO (SWAPS)																
104	OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO																
105	OPERACIONES ESTRUCTURADAS																
106	OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARDS)																
107	OPERACIONES CON PAQUETES																
<b>6</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación.</p>																
<b>7</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie proporcionada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación.</p>																
<b>8</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>																
<b>9</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p>																

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

Columna	Descripción												
	En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo anterior.												
<b>10</b>	<p><b>MERCADO DE CONCERTACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Mercado SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>101</td> <td>BOLSA MEXICANA DE VALORES</td> </tr> <tr> <td>102</td> <td>MEXDER</td> </tr> <tr> <td>103</td> <td>BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES DE LA UNIÓN EUROPEA, DE LA ORGANIZACIÓN PARA LA COOPERACIÓN Y EL DESARROLLO ECONÓMICO (OCDE)</td> </tr> <tr> <td>104</td> <td>BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES CUYAS AUTORIDADES FINANCIERAS SEAN MIEMBROS DESIGNADOS PARA CONFORMAR EL CONSEJO DE LA ORGANIZACIÓN INTERNACIONAL DE COMISIONES DE VALORES</td> </tr> <tr> <td>105</td> <td>MERCADO EXTRABURSÁTIL</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Tipo de Mercado SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BOLSA MEXICANA DE VALORES	102	MEXDER	103	BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES DE LA UNIÓN EUROPEA, DE LA ORGANIZACIÓN PARA LA COOPERACIÓN Y EL DESARROLLO ECONÓMICO (OCDE)	104	BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES CUYAS AUTORIDADES FINANCIERAS SEAN MIEMBROS DESIGNADOS PARA CONFORMAR EL CONSEJO DE LA ORGANIZACIÓN INTERNACIONAL DE COMISIONES DE VALORES	105	MERCADO EXTRABURSÁTIL
CLAVE	DESCRIPCIÓN												
101	BOLSA MEXICANA DE VALORES												
102	MEXDER												
103	BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES DE LA UNIÓN EUROPEA, DE LA ORGANIZACIÓN PARA LA COOPERACIÓN Y EL DESARROLLO ECONÓMICO (OCDE)												
104	BOLSAS DE DERIVADOS ESTABLECIDAS EN PAÍSES CUYAS AUTORIDADES FINANCIERAS SEAN MIEMBROS DESIGNADOS PARA CONFORMAR EL CONSEJO DE LA ORGANIZACIÓN INTERNACIONAL DE COMISIONES DE VALORES												
105	MERCADO EXTRABURSÁTIL												
<b>11</b>	<p><b>CONTRAPARTE</b></p> <p>Se debe anotar la clave CASFIM que corresponda a la contraparte con la que se haya pactado la operación.</p> <p>Las claves CASFIM de las contrapartes se encuentran disponibles para su consulta en el SITI, en el “Catálogo de Instituciones”.</p>												
<b>12</b>	<p><b>TIPO DE CONTRATO (COMPRA O VENTA)</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Contrato SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>101</td> <td>CALL</td> </tr> <tr> <td>102</td> <td>PUT</td> </tr> <tr> <td>103</td> <td>FLUJOS RECIBIDOS</td> </tr> <tr> <td>104</td> <td>FLUJOS ENTREGADOS</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	CALL	102	PUT	103	FLUJOS RECIBIDOS	104	FLUJOS ENTREGADOS		
CLAVE	DESCRIPCIÓN												
101	CALL												
102	PUT												
103	FLUJOS RECIBIDOS												
104	FLUJOS ENTREGADOS												

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

Columna	Descripción																				
	Las claves del "Catálogo Tipo de Contrato SI" se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.																				
<b>13</b>	<p><b>TAMAÑO DEL CONTRATO</b></p> <p>Número de unidades del Subyacente que ampara cada uno de los contratos operados multiplicado por el precio pactado.</p> <p>Se deberá anotar el monto del contrato en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>																				
<b>14</b>	<p><b>NÚMERO DE CONTRATOS</b></p> <p>Total de contratos operados.</p> <p>Se deberá anotar el número sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>																				
<b>15</b>	<p><b>SUBYACENTE</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el "Catálogo Tipo de Subyacente SI", el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>101</td> <td>ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES EXTRANJERA.</td> </tr> <tr> <td>102</td> <td>ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES MEXICANA.</td> </tr> <tr> <td>103</td> <td>ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS NACIONALES</td> </tr> <tr> <td>104</td> <td>ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS EXTRANJERAS</td> </tr> <tr> <td>105</td> <td>MONEDA NACIONAL, UDIS Y DIVISAS</td> </tr> <tr> <td>106</td> <td>ÍNDICES DE PRECIOS REFERIDOS A LA INFLACIÓN</td> </tr> <tr> <td>107</td> <td>TASAS DE INTERÉS NOMINALES, REALES O SOBRETASAS, TASAS REFERIDAS A CUALQUIER TÍTULO DE DEUDA E ÍNDICES CON BASE EN DICHAS TASAS</td> </tr> <tr> <td>108</td> <td>PRÉSTAMOS Y CRÉDITOS</td> </tr> <tr> <td>109</td> <td>ORO Y PLATA</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES EXTRANJERA.	102	ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES MEXICANA.	103	ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS NACIONALES	104	ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS EXTRANJERAS	105	MONEDA NACIONAL, UDIS Y DIVISAS	106	ÍNDICES DE PRECIOS REFERIDOS A LA INFLACIÓN	107	TASAS DE INTERÉS NOMINALES, REALES O SOBRETASAS, TASAS REFERIDAS A CUALQUIER TÍTULO DE DEUDA E ÍNDICES CON BASE EN DICHAS TASAS	108	PRÉSTAMOS Y CRÉDITOS	109	ORO Y PLATA
CLAVE	DESCRIPCIÓN																				
101	ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES EXTRANJERA.																				
102	ACCIONES, UN GRUPO O CANASTA DE ACCIONES, O TÍTULOS REFERENCIADOS A ACCIONES, COTIZADAS EN UNA BOLSA DE VALORES MEXICANA.																				
103	ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS NACIONALES																				
104	ÍNDICES DE PRECIOS SOBRE ACCIONES COTIZADAS EN BOLSAS EXTRANJERAS																				
105	MONEDA NACIONAL, UDIS Y DIVISAS																				
106	ÍNDICES DE PRECIOS REFERIDOS A LA INFLACIÓN																				
107	TASAS DE INTERÉS NOMINALES, REALES O SOBRETASAS, TASAS REFERIDAS A CUALQUIER TÍTULO DE DEUDA E ÍNDICES CON BASE EN DICHAS TASAS																				
108	PRÉSTAMOS Y CRÉDITOS																				
109	ORO Y PLATA																				

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

Columna	Descripción												
	<table border="1"> <tr> <td data-bbox="391 285 548 390">110</td> <td data-bbox="548 285 1455 390">MAÍZ, TRIGO, SOYA, AZÚCAR, ARROZ, SORGO, ALGODÓN, AVENA, CAFÉ, JUGO DE NARANJA, CACAO, CEBADA, LECHE, CANOLA, ACEITE DE SOYA Y PASTA DE SOYA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="391 390 548 432">111</td> <td data-bbox="548 390 1455 432">CARNE DE PUERCO, GANADO PORCINO Y GANADO BOVINO</td> </tr> <tr> <td data-bbox="391 432 548 506">112</td> <td data-bbox="548 432 1455 506">GAS NATURAL, COMBUSTIBLE PARA CALEFACCIÓN, GASÓLEO, GASOLINA Y PETRÓLEO CRUDO</td> </tr> <tr> <td data-bbox="391 506 548 548">113</td> <td data-bbox="548 506 1455 548">ALUMINIO, COBRE, NÍQUEL, PLATINO, PLOMO Y ZINC</td> </tr> <tr> <td data-bbox="391 548 548 653">114</td> <td data-bbox="548 548 1455 653">OPERACIONES A FUTURO, OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARD), OPERACIONES DE OPCIÓN, OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO Y OPERACIONES DE INTERCAMBIO</td> </tr> <tr> <td data-bbox="391 653 548 695">115</td> <td data-bbox="548 653 1455 695">OTROS</td> </tr> </table> <p data-bbox="391 737 1455 873">El catálogo anterior, no autoriza a las entidades a realizar operaciones derivadas con Subyacentes diferentes a los previstos en las Reglas o en los prospectos de información de los fondos de inversión de que se trate, ni a las que estuvieran sujetas a autorización por parte de la Comisión.</p> <p data-bbox="391 915 1455 989">Las claves del “Catálogo Tipo de Subyacente SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	110	MAÍZ, TRIGO, SOYA, AZÚCAR, ARROZ, SORGO, ALGODÓN, AVENA, CAFÉ, JUGO DE NARANJA, CACAO, CEBADA, LECHE, CANOLA, ACEITE DE SOYA Y PASTA DE SOYA	111	CARNE DE PUERCO, GANADO PORCINO Y GANADO BOVINO	112	GAS NATURAL, COMBUSTIBLE PARA CALEFACCIÓN, GASÓLEO, GASOLINA Y PETRÓLEO CRUDO	113	ALUMINIO, COBRE, NÍQUEL, PLATINO, PLOMO Y ZINC	114	OPERACIONES A FUTURO, OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARD), OPERACIONES DE OPCIÓN, OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO Y OPERACIONES DE INTERCAMBIO	115	OTROS
110	MAÍZ, TRIGO, SOYA, AZÚCAR, ARROZ, SORGO, ALGODÓN, AVENA, CAFÉ, JUGO DE NARANJA, CACAO, CEBADA, LECHE, CANOLA, ACEITE DE SOYA Y PASTA DE SOYA												
111	CARNE DE PUERCO, GANADO PORCINO Y GANADO BOVINO												
112	GAS NATURAL, COMBUSTIBLE PARA CALEFACCIÓN, GASÓLEO, GASOLINA Y PETRÓLEO CRUDO												
113	ALUMINIO, COBRE, NÍQUEL, PLATINO, PLOMO Y ZINC												
114	OPERACIONES A FUTURO, OPERACIONES ADELANTADAS (FORWARD), OPERACIONES DE OPCIÓN, OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO Y OPERACIONES DE INTERCAMBIO												
115	OTROS												
16	<p data-bbox="391 1041 927 1062"><b>OBJETIVO AL REALIZAR EL DERIVADO</b></p> <p data-bbox="391 1104 1455 1178">Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Objeto Derivado SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="711 1209 1130 1325"> <thead> <tr> <th data-bbox="716 1209 865 1251">CLAVE</th> <th data-bbox="865 1209 1125 1251">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="716 1251 865 1283">101</td> <td data-bbox="865 1251 1125 1283">COBERTURA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="716 1283 865 1325">102</td> <td data-bbox="865 1283 1125 1325">ESPECULACION</td> </tr> </tbody> </table> <p data-bbox="391 1367 1455 1440">Las claves del “Catálogo Tipo de Objeto Derivado SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	COBERTURA	102	ESPECULACION						
CLAVE	DESCRIPCIÓN												
101	COBERTURA												
102	ESPECULACION												
17	<p data-bbox="391 1482 610 1503"><b>TASA PACTADA</b></p> <p data-bbox="391 1545 902 1577">Aplica a swaps o permutas financieras.</p> <p data-bbox="391 1629 1455 1724">La tasa de interés pactada deberá reportarse en porcentaje expresada en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>												

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>18</b>	<b>SOBRE TASA PACTADA</b>  En su caso, aplica a swaps o permutas financieras.  Se refiere a la tasa de interés adicional que se hubiera pactado en la operación.  La sobretasa de interés pactada deberá reportarse en porcentaje expresada en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.
<b>19</b>	<b>TASA RENDIMIENTO ESTRUCTURADO</b>  La tasa pactada en el contrato deberá reportarse en porcentaje expresada en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.
<b>20</b>	<b>ÍNDICE PACTADO</b>  Aplica a operaciones cuyo subyacente sea un índice.  El índice pactado deberá reportarse en unidades, sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 236,569, se deberá reportar 236569.
<b>21</b>	<b>MONEDA</b>  Se deberá anotar la clave de la moneda de cotización que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado "Catálogo de Monedas Países CC", con la que fue concertada la operación.  Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.  Las claves del "Catálogo de Monedas Países CC" se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.
<b>22</b>	<b>FECHA INICIO CONTRATO</b>  Se deberá anotar la fecha en que la entidad celebró la operación.  El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).

**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

Columna	Descripción						
<p><b>23</b></p>	<p><b>FECHA VENCIMIENTO CONTRATO</b></p> <p>Se deberá anotar la fecha en que llega a su vencimiento la operación.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>						
<p><b>24</b></p>	<p><b>ENTREGA FÍSICA O DIFERENCIALES</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Entrega Física o Diferenciales”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="646 663 1198 779"> <thead> <tr> <th data-bbox="646 663 802 705">CLAVE</th> <th data-bbox="802 663 1198 705">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="646 705 802 737">101</td> <td data-bbox="802 705 1198 737">Entrega Física</td> </tr> <tr> <td data-bbox="646 737 802 779">102</td> <td data-bbox="802 737 1198 779">Entrega por Diferenciales</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Entrega Física o Diferenciales” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Entrega Física	102	Entrega por Diferenciales
CLAVE	DESCRIPCIÓN						
101	Entrega Física						
102	Entrega por Diferenciales						
<p><b>25</b></p>	<p><b>PRECIO PACTADO</b></p> <p>Se refiere al precio del ejercicio.</p> <p>Se deberá anotar el precio, tasa, puntos o cantidad al que se haya contraído el derecho o la obligación de liquidar el activo subyacente.</p> <p>Deberá reportar a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el precio es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>						
<p><b>26</b></p>	<p><b>VALOR RAZONABLE</b></p> <p>Se deberá anotar el precio proporcionado por el proveedor de precios para el día de la valuación.</p> <p>Deberá anotar el monto redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>						
<p><b>27</b></p>	<p><b>TIPO DE VALOR DEL SUBYACENTE</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>						



**R03 B-0323 OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (CODE)**

Columna	Descripción
	<p>En caso de que el subyacente no cuente con clave de tipo de valor determinado por el proveedor de precios, se deberá reportar la clave NA.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
28	<p><b>MONEDA DEL SUBYACENTE</b></p> <p>Se deberá anotar la clave de la moneda en que haya sido emitido el subyacente de la operación.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado “Catálogo de Monedas Países CC”, con la que fue concertada la operación.</p> <p>Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Monedas Países CC” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
29	<p><b>TASA RECIBIDA</b></p> <p>Aplica a operaciones de intercambios (swaps).</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>I. SECCIÓN IFORMACIÓN DETALLADA</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA	Numérico	15	0
5	TIPO DE DERIVADO	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABE)	Alfanumérico	14	0
10	MERCADO DE CONCERTACIÓN	Numérico	3	0
11	TIPO DE CONTRAPARTE	Alfanumérico	6	0
12	TIPO DE CONTRATO (COMPRA O VENTA)	Numérico	3	0
13	TAMAÑO DEL CONTRATO	Numérico	21	0
14	NÚMERO DE CONTRATOS	Numérico	21	0
15	SUBYACENTE	Numérico	3	0
16	OBJETIVO AL REALIZAR EL DERIVADO	Numérico	3	0
17	TASA PACTADA	Numérico	16	6
18	SOBRE TASA PACTADA	Numérico	16	6
19	TASA RENDIMIENTO ESTRUCTURADO	Numérico	16	6
20	ÍNDICE PACTADO	Numérico	21	0
21	MONEDA	Numérico	4	0
22	FECHA INICIO CONTRATO	Fecha	8	0
23	FECHA VENCIMIENTO CONTRATO	Fecha	8	0
24	ENTREGA FÍSICA O DIFERENCIALES	Numérico	3	0
25	PRECIO PACTADO	Numérico	16	6
26	VALOR RAZONABLE	Numérico	21	0
27	TIPO DE VALOR DEL SUBYACENTE	Alfanumérico	4	0
28	MONEDA DEL SUBYACENTE	Numérico	4	0
29	TASA RECIBIDA	Numérico	16	6

### R03 E-0351 Operaciones de compra-venta de activos objeto de inversión (CO-CV)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección información detallada por operación y activo objeto de inversión.*- Contiene los campos necesarios para poder identificar las operaciones realizadas por las entidades.

El reporte está conformado por **35 (treinta y cinco)** columnas, las cuales se describen a continuación:

<b>R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<b>PERÍODO</b>  Se refiere al período mensual o trimestral de la información que está reportando la entidad.  Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.  Cuando se trate de periodo mensual se capturará el año seguido del mes, por ejemplo, si se desea enviar la información del mes de enero de 2022, el dato a capturar será: 202201, si se refiere al mes de diciembre de 2022, se capturará: 202212.  En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturará: 202204.
<b>2</b>	<b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b>  Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.

## R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)

Columna	Descripción										
	<p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado “Instituciones” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El formato para capturar este campo es #####.</p>										
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>351</b> que se puede obtener del catálogo “Subreportes” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>										
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN Y ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN</b>											
<b>4</b>	<p><b>TIPO DE OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Operación SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>COMPRAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>ENTRADAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>VENTAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>SALIDAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Tipo de Operación SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>Todas las operaciones deberán presentarse en orden cronológico. Asimismo, de conformidad con las disposiciones aplicables, se deberán registrar en la fecha de operación, independientemente de la fecha de su liquidación.</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Las operaciones que deberán registrarse como <b>Compra de instrumentos financieros</b> son las siguientes: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Operaciones en Directo, incluyendo el ejercicio de derechos de preferencia otorgados por acciones.</li> <li>• Operaciones de Reporto, actuando como reportador y al inicio del reporto.</li> <li>• Operaciones de Reporto, actuando como reportado, al vencimiento del reporto.</li> </ul> </li> </ol>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	COMPRAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS	102	ENTRADAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS	103	VENTAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS	104	SALIDAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS
CLAVE	DESCRIPCIÓN										
101	COMPRAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS										
102	ENTRADAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS										
103	VENTAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS										
104	SALIDAS DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS										

## R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)

Columna	Descripción
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Operaciones de Préstamo de instrumentos financieros, actuando como prestataria, al inicio del préstamo.</li> <li>• Operaciones de Préstamo de instrumentos financieros, actuando como prestamista al vencimiento del préstamo.</li> <li>• Operaciones e instrumentos financieros derivados en las que la entidad asuma una posición larga.</li> <li>• Primas recibidas por la venta de opciones.</li> <li>• Depósitos en cuentas de cheques, con independencia de la divisa en que haya sido efectuada.</li> </ul> <p>2. Respecto de las operaciones de <b>Entrada de instrumentos financieros</b> se deberán registrar:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Devolución de valores dados en garantía.</li> <li>• Devolución de aportaciones iniciales mínimas y aportaciones extraordinarias, por operaciones con derivados.</li> <li>• Dividendos en especie.</li> <li>• Títulos recibidos por canje (e. g. actualización de la Emisión o Serie o reestructura de la emisión o serie, fusiones, escisiones, splits)</li> <li>• Depósito de intereses por cuentas de cheques, con independencia de la divisa en que haya sido efectuada.</li> </ul> <p>3. Respecto de las operaciones de <b>Venta de instrumentos financieros</b> se deberán registrar:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Operaciones en Directo.</li> <li>• Operaciones de Reporto, actuando como reportador, al vencimiento del reporto.</li> <li>• Operaciones de Reporto, actuando como reportado, al inicio del reporto.</li> <li>• Operaciones de Préstamo de instrumentos financieros, actuando como prestataria, al vencimiento del préstamo.</li> <li>• Operaciones de Préstamo de instrumentos financieros, actuando como prestamista, al inicio del préstamo.</li> <li>• Operaciones en instrumentos financieros derivados en las cuales la entidad asuma una posición corta.</li> <li>• Primas pagadas por compra de opciones.</li> <li>• Retiros a cuentas de cheques, con independencia de la divisa en que haya sido efectuada.</li> </ul> <p>4. Respecto de las operaciones de <b>Salida de instrumentos financieros</b> se deberán registrar:</p>

## R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)

Columna	Descripción																						
	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Pago de aportaciones iniciales mínimas y aportaciones extraordinarias, por operaciones con derivados.</li> <li>• Títulos entregados por canje (e. g. actualización de la Emisión o Serie o reestructura de la emisión o serie, fusiones, escisiones, splits inversos).</li> <li>• Comisiones pagadas al banco por cuenta de cheques en pesos, dólares, euros o cualquier otra divisa por conceptos de manejo de cuenta o incumplimiento de saldo mínimo.</li> </ul>																						
<b>5</b>	<p><b>TIPO DE INVERSIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>Inversión en Directo</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>Operación de reporto actuando como reportador</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>Operación de reporto actuando como reportado</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>Inversiones en instrumentos financieros derivados</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">107</td> <td>Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">108</td> <td>Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">109</td> <td>Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">110</td> <td>Garantías en valores por operaciones de reporto</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Tipo de Inversión FI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Inversión en Directo	102	Operación de reporto actuando como reportador	103	Operación de reporto actuando como reportado	104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como	105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como	106	Inversiones en instrumentos financieros derivados	107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)	108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros	109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos	110	Garantías en valores por operaciones de reporto
CLAVE	DESCRIPCIÓN																						
101	Inversión en Directo																						
102	Operación de reporto actuando como reportador																						
103	Operación de reporto actuando como reportado																						
104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como																						
105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como																						
106	Inversiones en instrumentos financieros derivados																						
107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)																						
108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros																						
109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos																						
110	Garantías en valores por operaciones de reporto																						
<b>6</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda a la operación.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, registrar la clave de la Institución Bancaria de acuerdo con el Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).</p>																						

<b>R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>7</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie proporcionada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión al que corresponda la operación.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, anotar los últimos siete números de la cuenta.</p>
<b>8</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>
<b>9</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo anterior.</p>
<b>10</b>	<p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS</b></p> <p>Se refiere al número de títulos del instrumento que se haya pactado en la operación.</p> <p>En el caso de operaciones que representan salida de efectivo, este campo corresponderá el importe que haya entrado o salido (chequeras en cualquier divisa o aportaciones iniciales mínimas)</p> <p>Se deberá anotar el número sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
<b>11</b>	<p><b>COSTO UNITARIO (SIN INTERESES)</b></p>

**R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)**

Columna	Descripción																				
	<p>Se deberá anotar el costo unitario (al que se adquirió o vendió el instrumento) en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el costo es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p> <p>En los casos de instrumentos de deuda que paguen intereses periódicos, se deberá reportar el precio sin intereses.</p> <p>En los casos de operaciones en cuentas de cheques en divisa diferente al peso, se deberá registrar el tipo de cambio pactado en la operación.</p>																				
<p align="center"><b>12</b></p>	<p><b>INTERESES DEVENGADOS</b></p> <p>Intereses que se han generado entre la fecha de inicio del cupón o de la inversión hasta la fecha en que se reporta la operación.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>																				
<p align="center"><b>13</b></p>	<p><b>TIPO DE LIQUIDACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Liquidación”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="617 1134 1206 1514"> <thead> <tr> <th>CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>101</td> <td>Mismo día</td> </tr> <tr> <td>102</td> <td>24 Horas (1 día hábil)</td> </tr> <tr> <td>103</td> <td>48 Horas (2 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>104</td> <td>72 Horas (3 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>105</td> <td>96 Horas (4 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>106</td> <td>120 Horas (5 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>107</td> <td>144 Horas (6 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>108</td> <td>168 Horas (7 días hábiles)</td> </tr> <tr> <td>109</td> <td>192 Horas (8 días hábiles)</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Tipo de Liquidación” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Mismo día	102	24 Horas (1 día hábil)	103	48 Horas (2 días hábiles)	104	72 Horas (3 días hábiles)	105	96 Horas (4 días hábiles)	106	120 Horas (5 días hábiles)	107	144 Horas (6 días hábiles)	108	168 Horas (7 días hábiles)	109	192 Horas (8 días hábiles)
CLAVE	DESCRIPCIÓN																				
101	Mismo día																				
102	24 Horas (1 día hábil)																				
103	48 Horas (2 días hábiles)																				
104	72 Horas (3 días hábiles)																				
105	96 Horas (4 días hábiles)																				
106	120 Horas (5 días hábiles)																				
107	144 Horas (6 días hábiles)																				
108	168 Horas (7 días hábiles)																				
109	192 Horas (8 días hábiles)																				
<p align="center"><b>14</b></p>	<p><b>TASA AL VALUAR</b></p> <p>Reportar:</p> <p>En el caso de inversiones en cuentas de cheques, la tasa de interés pactada.</p>																				



## R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)

Columna	Descripción														
	<p>En el caso de bonos cupón cero, la tasa de rendimiento pactada o al vencimiento del instrumento, según se trate.</p> <p>Tratándose de instrumentos de deuda con pagos de interés periódicos, deberán reportar la tasa de rendimiento a vencimiento pactada para cada operación, sumando en su caso la sobretasa.</p> <p>En caso de operaciones de reporto y préstamo de instrumentos financieros se deberá reportar la tasa premio pactada.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>														
<b>15</b>	<p><b>TIPO DE TASA</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Tasa”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>Tasa real</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>No aplica</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Tipo de Tasa” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)	102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	104	Tasa real	105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)	106	No aplica
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)														
102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
104	Tasa real														
105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)														
106	No aplica														
<b>16</b>	<p><b>DÍAS POR VENCER</b></p> <p>Indicar el número de días al vencimiento del instrumento, en la fecha de concertación de la operación.</p> <p>En los casos de operaciones de reporto y préstamo de instrumentos financieros se indicará el plazo por vencer de la operación, el cual debe ser consistente con el CO-RE y el CO-PR.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>														

<b>R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>17</b>	<p><b>PLAZO TOTAL DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>Se deberá anotar el plazo total del instrumento entre la fecha de emisión y la fecha de vencimiento.</p> <p>En los casos de operaciones de reporto, préstamo de instrumentos financieros y derivados se indicará el plazo total al que se haya pactado la operación.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
<b>18</b>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los valores de que se traten. Así mismo, dicho número deberá ser el mismo que haya sido reportado en el CO-RE, CO-PR, CO-DE y, en su caso, en el CO-GA.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderá al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de reporto celebrada el 2 de enero de 2022, en la cual la entidad haya participado como reportadora, y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería “102202201020020”, el cual estaría integrado de la siguiente forma: 102, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p> <p>Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.</p>
<b>19</b>	<p><b>FECHA DE OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la fecha en que la entidad concertó la operación.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>

<b>R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>20</b>	<p><b>HORA DE OPERACIÓN</b></p> <p>Se deberá utilizar el formato HH:MM:SS.</p> <p>Ejemplo: si la hora de la operación fue a las 1:15:12 p.m., se deberá reportar 13:15:12.</p>
<b>21</b>	<p><b>COMISIÓN PAGADA</b></p> <p>Cantidad pagada por la entidad al intermediario que corresponda por la operación de compra o venta de valores.</p> <p>Se deberá anotar el monto redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>22</b>	<p><b>IVA COMISIÓN PAGADA</b></p> <p>Importe de IVA correspondiente a las comisiones pagadas al intermediario por la operación de compra o venta de valores que corresponda.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>23</b>	<p><b>CLAVE PAÍS DE CONCERTACIÓN</b></p> <p>Registrar la clave del país donde fueron operados los títulos. Para ello, se deberán utilizar las opciones contenidas en el catálogo denominado "Países".</p> <p>Las claves del catálogo "Países" se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
<b>24</b>	<p><b>CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave CASFIM que corresponde a la contraparte con la que se haya pactado la operación.</p> <p>Las claves CASFIM de las contrapartes se encuentran disponibles para su consulta en el SITI, en el "Catálogo de Instituciones".</p>
<b>25</b>	<p><b>CONTRAPARTE DISTINTO AL ANTERIOR</b></p> <p>Se especificará la clave de contraparte que no se encuentra en las opciones del catálogo denominado "Instituciones" sin que exceda de 20 (veinte) caracteres.</p>

<b>R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Este campo sólo deberá utilizarse en aquellos casos en que la contraparte no cuente con una clave CASFIM.
<b>26</b>	<p><b>TASA CUPÓN VIGENTE</b></p> <p>Para el caso de instrumentos de deuda cuponados, corresponde a la tasa cupón vigente con la que se determinó el monto reportado en la columna12 “Intereses Devengados”.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>
<b>27</b>	<p><b>PLAZO DEL CUPÓN</b></p> <p>Total de días que comprende el cupón vigente.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin comas Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
<b>28</b>	<p><b>FECHA DE LIQUIDACIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la fecha en que se liquida la operación.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>
<b>29</b>	<p><b>CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA CONTRAPARTE</b></p> <p>Registrar la calificación que la operadora asigne a la Contraparte de la operación de que se trate, conforme a sus políticas internas.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el “Catálogo de Calificación de la Contraparte FI” el cual se encuentra disponible para su consulta en el SITI.</p>
<b>30</b>	<b>MONEDA EN LA QUE SE PACTÓ LA OPERACIÓN</b>

## R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)

Columna	Descripción												
	<p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado “Catálogo de Monedas Países CC”, con la que fue concertada la operación.</p> <p>Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Monedas Países CC” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>												
<b>31</b>	<p><b>COMPRA EN MERCADO PRIMARIO</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo Tipo de Mercado SI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>OFERTA PÚBLICA PRIMARIA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">107</td> <td>NO APLICA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">108</td> <td>SUBASTA DE VALORES GUBERNAMENTALES</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo Tipo de Mercado SI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	106	OFERTA PÚBLICA PRIMARIA	107	NO APLICA	108	SUBASTA DE VALORES GUBERNAMENTALES				
CLAVE	DESCRIPCIÓN												
106	OFERTA PÚBLICA PRIMARIA												
107	NO APLICA												
108	SUBASTA DE VALORES GUBERNAMENTALES												
<b>32</b>	<p><b>MEDIO DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Reportar de acuerdo con la forma a través de la cual se pactó la operación.</p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Canales”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">CLAVE</th> <th style="text-align: center;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>Operación por Internet</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>Operación por medios electrónicos de negociación</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>Operación por Teléfono</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>En bolsas de valores de mercados reconocidos</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>Liquidación en Instituciones para el Depósito de</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Canales” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Operación por Internet	102	Operación por medios electrónicos de negociación	103	Operación por Teléfono	104	En bolsas de valores de mercados reconocidos	105	Liquidación en Instituciones para el Depósito de
CLAVE	DESCRIPCIÓN												
101	Operación por Internet												
102	Operación por medios electrónicos de negociación												
103	Operación por Teléfono												
104	En bolsas de valores de mercados reconocidos												
105	Liquidación en Instituciones para el Depósito de												

**R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE INVERSIÓN (CO-CV)**

Columna	Descripción														
<b>33</b>	<p><b>CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA</b></p> <p>Se anotará la clave que corresponda a la calificación vigente asignada por la Institución Calificadora de Valores a la emisión o serie del instrumento, conforme al “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda”.</p> <p>La clave 101 No aplica, se utilizará únicamente en los instrumentos que no tengan la obligación de estar calificados. En caso de que el instrumento cuente con calificaciones emitidas por distintas calificadoras, deberá registrarse la que represente mayor riesgo.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>														
<b>34</b>	<p><b>BURSÁTILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE</b></p> <p>El grado de Bursátilidad de las acciones deberá identificarse con la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Índice de Bursátilidad”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="631 1199 1187 1465"> <thead> <tr> <th align="center">CLAVE</th> <th align="center">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td align="center">101</td> <td align="center">BURSATILIDAD ALTA</td> </tr> <tr> <td align="center">102</td> <td align="center">BURSATILIDAD MEDIA</td> </tr> <tr> <td align="center">103</td> <td align="center">BURSATILIDAD BAJA</td> </tr> <tr> <td align="center">104</td> <td align="center">BURSATILIDAD MÍNIMA</td> </tr> <tr> <td align="center">105</td> <td align="center">BURSATILIDAD NULA</td> </tr> <tr> <td align="center">106</td> <td align="center">NO APLICA</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Índice de Bursátilidad” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BURSATILIDAD ALTA	102	BURSATILIDAD MEDIA	103	BURSATILIDAD BAJA	104	BURSATILIDAD MÍNIMA	105	BURSATILIDAD NULA	106	NO APLICA
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	BURSATILIDAD ALTA														
102	BURSATILIDAD MEDIA														
103	BURSATILIDAD BAJA														
104	BURSATILIDAD MÍNIMA														
105	BURSATILIDAD NULA														
106	NO APLICA														
<b>35</b>	<p><b>MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado “Catálogo de Monedas Países CC”, con la que fue emitido el instrumento.</p> <p>Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se</p>														

**R03 E-0351 OPERACIONES DE COMPRA-VENTA DE ACTIVOS OBJETO DE  
INVERSIÓN (CO-CV)**

<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	<p>encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Monedas Países CC” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN Y ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN</b>				
4	TIPO DE OPERACIÓN	Numérico	3	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	CODIGO IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
11	COSTO UNITARIO (SIN INTERESES)	Numérico	16	6
12	INTERESES DEVENGADOS	Numérico	21	0
13	TIPO DE LIQUIDACIÓN	Numérico	3	0
14	TASA AL VALUAR	Numérico	16	6
15	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
16	DÍAS POR VENCER	Numérico	6	0
17	PLAZO TOTAL DEL INSTRUMENTO	Numérico	6	0
18	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
19	FECHA DE OPERACIÓN	Fecha	8	0
20	HORA DE OPERACIÓN	Alfanumérico	8	0
21	COMISIÓN PAGADA	Numérico	21	0
22	IVA COMISIÓN PAGADA	Numérico	21	0
23	CLAVE PAÍS DE CONCERTACIÓN	Numérico	4	0
24	TIPO DE CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN	Alfanumérico	6	0
25	TIPO DE CONTRAPARTE DISTINTO AL ANTERIOR	Alfanumérico	20	0
26	TASA CUPÓN VIGENTE	Numérico	16	6
27	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
28	FECHA DE LIQUIDACIÓN	Fecha	8	0
29	CALIFICACIÓN DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
30	MONEDA EN LA QUE SE PACTÓ LA OPERACIÓN	Numérico	4	0
31	COMPRA EN MERCADO PRIMARIO	Numérico	3	0
32	MEDIO DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN	Numérico	3	0
33	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
34	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
35	MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO	Numérico	4	0



## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA POR OPERACIÓN Y ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN</b>				
4	TIPO DE OPERACIÓN	Numérico	3	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	CODIGO IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
11	COSTO UNITARIO (SIN INTERESES)	Numérico	16	6
12	INTERESES DEVENGADOS	Numérico	21	0
13	TIPO DE LIQUIDACIÓN	Numérico	3	0
14	TASA AL VALUAR	Numérico	16	6
15	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
16	DÍAS POR VENCER	Numérico	6	0
17	PLAZO TOTAL DEL INSTRUMENTO	Numérico	6	0
18	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
19	FECHA DE OPERACIÓN	Fecha	8	0
20	HORA DE OPERACIÓN	Alfanumérico	8	0
21	COMISIÓN PAGADA	Numérico	21	0
22	IVA COMISIÓN PAGADA	Numérico	21	0
23	CLAVE PAÍS DE CONCERTACIÓN	Numérico	4	0
24	TIPO DE CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN	Alfanumérico	6	0
25	TIPO DE CONTRAPARTE DISTINTO AL ANTERIOR	Alfanumérico	20	0
26	TASA CUPÓN VIGENTE	Numérico	16	6
27	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
28	FECHA DE LIQUIDACIÓN	Fecha	8	0
29	CALIFICACIÓN DE LA CONTRAPARTE	Numérico	3	0
30	MONEDA EN LA QUE SE PACTÓ LA OPERACIÓN	Numérico	4	0
31	COMPRA EN MERCADO PRIMARIO	Numérico	3	0
32	MEDIO DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN	Numérico	3	0
33	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
34	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
35	MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO	Numérico	4	0

## R03 J-0311 Cartera de inversión (CO-CA)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección información por instrumento de inversión.*- Contiene los campos necesarios para poder identificar los activos objeto de inversión propiedad de la entidad, en la fecha del reporte y con independencia de la fecha de liquidación.

En apego a las disposiciones aplicables todos los valores deberán registrarse en este reporte en la fecha de operación, independientemente de su liquidación.

Los instrumentos financieros y operaciones en este reporte, deberán quedar registrados con base en lo establecido por los criterios contables emitidos por la Comisión, vigentes a la fecha de la información financiera.

El reporte está conformado por **(27) veintisiete** columnas, las cuales se describen a continuación:

R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)	
Columna	Descripción
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<b>PERÍODO</b> Se refiere al período mensual o trimestral de la información que está reportando la entidad.  Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.  Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 01 de diciembre de 2022, se capturará: 20221201.  En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se

<b>R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)</b>																	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>																
	<p>deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturará: 202204.</p> <p>Y en caso de que el periodo de envío sea anual se capturará solo el año, por ejemplo, si se desea enviar la información de 2022, el dato a capturar será: 2022.</p>																
<b>2</b>	<p><b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b></p> <p>Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.</p> <p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado “Instituciones” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El formato para capturar este campo es #####.</p>																
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>311</b> que se puede obtener del catálogo “Subreportes” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>																
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN POR INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>																	
<b>4</b>	<p><b>NÚMERO CONSECUTIVO</b></p> <p>Se deberá anotar el número ascendente de uno en uno para cada instrumento que conforma la cartera de valores de la entidad.</p>																
<b>5</b>	<p><b>TIPO DE INVERSIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 15%;">CLAVE</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>101</td> <td>Inversión en Directo</td> </tr> <tr> <td>102</td> <td>Operación de reporte actuando como reportador</td> </tr> <tr> <td>103</td> <td>Operación de reporte actuando como reportado</td> </tr> <tr> <td>104</td> <td>Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando</td> </tr> <tr> <td>105</td> <td>Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando</td> </tr> <tr> <td>106</td> <td>Inversiones en instrumentos financieros derivados</td> </tr> <tr> <td>107</td> <td>Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Inversión en Directo	102	Operación de reporte actuando como reportador	103	Operación de reporte actuando como reportado	104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando	105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando	106	Inversiones en instrumentos financieros derivados	107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)
CLAVE	DESCRIPCIÓN																
101	Inversión en Directo																
102	Operación de reporte actuando como reportador																
103	Operación de reporte actuando como reportado																
104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando																
105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando																
106	Inversiones en instrumentos financieros derivados																
107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)																

<b>R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)</b>							
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>						
	<table border="1"> <tr> <td>108</td> <td>Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros</td> </tr> <tr> <td>109</td> <td>Garantías en valores por operaciones de préstamo de</td> </tr> <tr> <td>110</td> <td>Garantías en valores por operaciones de reporto</td> </tr> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Tipo de Inversión FI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros	109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de	110	Garantías en valores por operaciones de reporto
108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros						
109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de						
110	Garantías en valores por operaciones de reporto						
<b>6</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda a la operación.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, registrar la clave de la Institución Bancaria de acuerdo con el Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).</p>						
<b>7</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie conforme a la utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión de que se trate.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, anotar los últimos siete números de la cuenta.</p>						
<b>8</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>						
<b>9</b>	<p><b>TASA A VALUAR</b></p> <p>Reportar la tasa de valuación proporcionada por el proveedor de precios contratado por la entidad de que se trate y que permita obtener el “Valor razonable del título reportado”.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>						

### R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)

Columnna	Descripción														
<b>10</b>	<p><b>TIPO DE TASA</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Tasa”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="background-color: #cccccc;">CLAVE</th> <th style="background-color: #cccccc;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td>Tasa real</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td>Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td>No aplica</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Tipo de Tasa” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)	102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	104	Tasa real	105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)	106	No aplica
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)														
102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
104	Tasa real														
105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)														
106	No aplica														
<b>11</b>	<p><b>CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA</b></p> <p>Se anotará la clave que corresponda a la calificación vigente asignada por la Institución Calificadora de Valores a la emisión o serie del instrumento, conforme al “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda”.</p> <p>La clave 101 No aplica, se utilizará únicamente en los instrumentos que no tengan la obligación de estar calificados.</p> <p>En caso de que el instrumento cuente con calificaciones emitidas por distintas calificadoras, deberá registrarse la que represente mayor riesgo.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>														
<b>12</b>	<p><b>BURSÁTILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE</b></p> <p>El grado de Bursátilidad de las acciones deberá identificarse con la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Índice de Bursátilidad”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="background-color: #cccccc;">CLAVE</th> <th style="background-color: #cccccc;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td>BURSÁTILIDAD ALTA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td>BURSÁTILIDAD MEDIA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td>BURSÁTILIDAD BAJA</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BURSÁTILIDAD ALTA	102	BURSÁTILIDAD MEDIA	103	BURSÁTILIDAD BAJA						
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	BURSÁTILIDAD ALTA														
102	BURSÁTILIDAD MEDIA														
103	BURSÁTILIDAD BAJA														

R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)							
Columnna	Descripción						
	<table border="1"> <tr> <td>104</td> <td>BURSÁTILIDAD MÍNIMA</td> </tr> <tr> <td>105</td> <td>BURSÁTILIDAD NULA</td> </tr> <tr> <td>106</td> <td>NO APLICA</td> </tr> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Índice de Bursatilidad” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA	105	BURSÁTILIDAD NULA	106	NO APLICA
104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA						
105	BURSÁTILIDAD NULA						
106	NO APLICA						
13	<p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS OPERADOS</b></p> <p>Deberá registrarse el número de títulos de valores o inversiones propiedad de la entidad, conforme a la siguiente fórmula:</p> <p><b>POSICIÓN INICIAL DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b></p> <p>+ Más</p> <p><b>OPERACIONES DE COMPRA O ENTRADAS DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b></p> <p>- Menos</p> <p><b>OPERACIONES DE VENTA O SALIDA DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b></p> <p>= Igual a:</p> <p><b>POSICIÓN AL FINAL DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b></p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>						
14	<p><b>TOTAL DE TÍTULOS DE LA EMISIÓN EN CIRCULACIÓN</b></p> <p>Cantidad de títulos en circulación que corresponden a la emisión o serie del instrumento de que se trate, en la fecha a que corresponda la información.</p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>						
15	<p><b>COSTO PROMEDIO UNITARIO DE ADQUISICIÓN</b></p> <p>Se deberá anotar el costo promedio unitario que resulte de aplicar la metodología prevista en los criterios contables correspondientes, en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el costo es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>						
16	<p><b>COSTO TOTAL DE ADQUISICIÓN</b></p> <p>Monto obtenido de multiplicar el Costo promedio unitario de adquisición por la Cantidad de títulos operados del activo objeto de inversión de que se trate.</p>						

<b>R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.
<b>17</b>	<p><b>VALOR RAZONABLE UNITARIO</b></p> <p>Valor de mercado, en su caso con intereses, determinado por el proveedor de precios o el comité de valuación correspondiente para el activo objeto de inversión de que se trate, en el día de la valuación.</p> <p>En el caso de las cuentas de cheques, deberán reportarse valuados conforme a las disposiciones de carácter general establecidas por la Comisión, incluyendo los intereses devengados y no pagados por la Institución Bancaria con la que se tiene la cuenta de cheques.</p> <p>Se deberá anotar el valor razonable unitario en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el costo es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>
<b>18</b>	<p><b>VALOR RAZONABLE TOTAL</b></p> <p>Monto obtenido de multiplicar el Valor razonable unitario por la Cantidad de títulos operados.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>19</b>	<p><b>DÍAS POR VENCER</b></p> <p>Registrar el número de días por vencer a la fecha de valuación de los activos objeto de inversión.</p> <p>En los casos de operaciones de reporto y préstamo de instrumentos financieros se indicará el plazo por vencer de la operación, el cual debe ser consistente con el CO-RE y el CO-PR.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
<b>20</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p>

<b>R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo previo.
<b>21</b>	<p><b>CLAVE PAÍS DE CONCERTACIÓN</b></p> <p>Registrar la clave del país donde fueron operados los títulos. Para ello, se deberán utilizar las opciones contenidas en el catálogo denominado "Países".</p> <p>Las claves del catálogo "Países" se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
<b>22</b>	<p><b>VAR DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>Registrar el Valor en Riesgo que corresponda al instrumento de que se trate, para la fecha de valuación.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>23</b>	<p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS</b></p> <p>El saldo en títulos propiedad de la entidad, para el activo objeto de inversión de que se trate, determinado conforme a la siguiente fórmula:</p> <p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS AL INICIO DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b>  <b>+ Más</b>  <b>TÍTULOS DE ENTRADA O DE COMPRA LIQUIDADOS EL DÍA DE LA VALUACIÓN</b>  <b>- Menos</b>  <b>TÍTULOS DE SALIDA O DE VENTA LIQUIDADOS EL DÍA DE LA VALUACIÓN</b>  <b>= Igual a:</b>  <b>CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS AL FINAL DEL DÍA DE LA VALUACIÓN</b></p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 236,569, se deberá reportar 236569.</p>
<b>24</b>	<p><b>PLAZO DEL CUPÓN</b></p> <p>Total de días que comprende el cupón vigente.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>



<b>R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA)</b>	
Columna	Descripción
<b>25</b>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los valores de que se traten. Así mismo, dicho número deberá ser el mismo que haya sido reportado en el CO-CV, CO-RE, CO-PR, CO-DE y, en su caso, en el CO-GA.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderá al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de reporto celebrada el 2 de enero de 2022, en la cual la entidad haya participado como reportadora, y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería “102202201020020”, el cual estaría integrado de la siguiente forma: 102, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p> <p>Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.</p>
<b>26</b>	<p><b>MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponda de acuerdo con el catálogo denominado “Catálogo de Monedas Países CC”, con la que se emitió el instrumento.</p> <p>Se utilizará la clave de la moneda que se conozca y que describa mejor al País y su moneda de curso legal. En el caso de nuevas Monedas y sus Países, que no se encuentren en el catálogo, la sociedad operadora de fondos de inversión solicitará a la Dirección General de Análisis e Información de la CNBV el alta para asignársele la clave correspondiente.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Monedas Países CC” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>
<b>27</b>	<p><b>DURACIÓN DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>Se refiere a la duración MaCaulay determinada por el proveedor de precios contratado por la entidad, para la fecha de la información reportada y para el instrumento de que se trate.</p> <p>Se deberá anotar el número de días con seis decimales y sin comas. Ejemplo: 58.758996.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN POR INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>				
4	NÚMERO CONSECUTIVO	Numérico	6	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	TASA A VALUAR	Numérico	16	6
10	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
11	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
12	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
13	CANTIDAD DE TÍTULOS OPERADOS	Numérico	21	0
14	TOTAL DE TÍTULOS DE LA EMISIÓN EN CIRCULACIÓN	Numérico	21	0
15	COSTO PROMEDIO UNITARIO DE ADQUISICIÓN	Numérico	16	6
16	COSTO TOTAL DE ADQUISICIÓN	Numérico	21	0
17	VALOR RAZONABLE UNITARIO	Numérico	16	6
18	VALOR RAZONABLE TOTAL	Numérico	21	0
19	DÍAS POR VENCER	Numérico	6	0
20	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL QUE APLIQUE)	Alfanumérico	14	0
21	PAÍS DE CONCERTACIÓN	Numérico	4	0
22	VAR DEL INSTRUMENTO	Numérico	21	0
23	CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS	Numérico	21	0
24	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
25	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
26	MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO	Numérico	4	0
27	DURACIÓN DEL INSTRUMENTO	Numérico	16	6

## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN POR INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>				
4	NÚMERO CONSECUTIVO	Numérico	6	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	TASA A VALUAR	Numérico	16	6
10	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
11	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
12	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
13	CANTIDAD DE TÍTULOS OPERADOS	Numérico	21	0
14	TOTAL DE TÍTULOS DE LA EMISIÓN EN CIRCULACIÓN	Numérico	21	0
15	COSTO PROMEDIO UNITARIO DE ADQUISICIÓN	Numérico	16	6
16	COSTO TOTAL DE ADQUISICIÓN	Numérico	21	0
17	VALOR RAZONABLE UNITARIO	Numérico	16	6
18	VALOR RAZONABLE TOTAL	Numérico	21	0
19	DÍAS POR VENCER	Numérico	6	0
20	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL QUE APLIQUE)	Alfanumérico	14	0
21	PAÍS DE CONCERTACIÓN	Numérico	4	0
22	VAR DEL INSTRUMENTO	Numérico	21	0
23	CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS	Numérico	21	0
24	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
25	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
26	MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO	Numérico	4	0
27	DURACIÓN DEL INSTRUMENTO	Numérico	16	6

## Definición del Documento Reporte Anual:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	4	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN POR INSTRUMENTO DE INVERSIÓN</b>				
4	NÚMERO CONSECUTIVO	Numérico	6	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	TASA A VALUAR	Numérico	16	6
10	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
11	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
12	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
13	CANTIDAD DE TÍTULOS OPERADOS	Numérico	21	0
14	TOTAL DE TÍTULOS DE LA EMISIÓN EN CIRCULACIÓN	Numérico	21	0
15	COSTO PROMEDIO UNITARIO DE ADQUISICIÓN	Numérico	16	6
16	COSTO TOTAL DE ADQUISICIÓN	Numérico	21	0
17	VALOR RAZONABLE UNITARIO	Numérico	16	6
18	VALOR RAZONABLE TOTAL	Numérico	21	0
19	DÍAS POR VENCER	Numérico	6	0
20	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL QUE APLIQUE)	Alfanumérico	14	0
21	PAÍS DE CONCERTACIÓN	Numérico	4	0
22	VAR DEL INSTRUMENTO	Numérico	21	0
23	CANTIDAD DE TÍTULOS LIQUIDADOS	Numérico	21	0
24	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
25	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
26	MONEDA EN LA QUE SE EMITIÓ EL INSTRUMENTO	Numérico	4	0
27	DURACIÓN DEL INSTRUMENTO	Numérico	16	6

## R03 J-0312 Provisión de intereses devengados sobre valores (CO-IN)

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 2 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección información detallada.*- Contiene los campos necesarios para poder determinar los intereses devengados de los activos objeto de inversión propiedad de las entidades de que se trate.

El reporte está conformado por **23 (veintitrés)** columnas, las cuales se describen a continuación:

<b>R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<b>PERÍODO</b> Se refiere al período mensual o trimestral de la información que está reportando la entidad.  Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.  Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 01 de diciembre de 2022, se capturará: 20221201.  En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturará: 202204.
<b>2</b>	<b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b> Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.

**R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)**

Columna	Descripción																						
	<p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado “Instituciones” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El formato para capturar este campo es #####.</p>																						
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>312</b> que se puede obtener del catálogo “Subreportes” disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>																						
<b>II. SECCIÓN INFORMACIÓN DETALLADA</b>																							
<b>4</b>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA</b></p> <p>Se anotará el Número previsto en el reporte R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA) en el campo denominado “NÚMERO CONSECUTIVO”.</p>																						
<b>5</b>	<p><b>TIPO DE INVERSIÓN</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Inversión FI”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="370 1119 1458 1738"> <thead> <tr> <th data-bbox="375 1125 508 1163">CLAVE</th> <th data-bbox="513 1125 1453 1163">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="375 1169 508 1207">101</td> <td data-bbox="513 1169 1453 1207">Inversión en Directo</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1213 508 1251">102</td> <td data-bbox="513 1213 1453 1251">Operación de reporto actuando como reportador</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1257 508 1295">103</td> <td data-bbox="513 1257 1453 1295">Operación de reporto actuando como reportado</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1302 508 1373">104</td> <td data-bbox="513 1302 1453 1373">Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestatario</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1379 508 1451">105</td> <td data-bbox="513 1379 1453 1451">Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestamista</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1457 508 1495">106</td> <td data-bbox="513 1457 1453 1495">Inversiones en instrumentos financieros derivados</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1501 508 1539">107</td> <td data-bbox="513 1501 1453 1539">Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1545 508 1617">108</td> <td data-bbox="513 1545 1453 1617">Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros derivados</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1623 508 1694">109</td> <td data-bbox="513 1623 1453 1694">Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos financieros</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1701 508 1738">110</td> <td data-bbox="513 1701 1453 1738">Garantías en valores por operaciones de reporto</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Tipo de Inversión FI” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Inversión en Directo	102	Operación de reporto actuando como reportador	103	Operación de reporto actuando como reportado	104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestatario	105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestamista	106	Inversiones en instrumentos financieros derivados	107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)	108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros derivados	109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos financieros	110	Garantías en valores por operaciones de reporto
CLAVE	DESCRIPCIÓN																						
101	Inversión en Directo																						
102	Operación de reporto actuando como reportador																						
103	Operación de reporto actuando como reportado																						
104	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestatario																						
105	Operación de préstamo de instrumentos financieros actuando como prestamista																						
106	Inversiones en instrumentos financieros derivados																						
107	Inversión en empresa promovida (aplica sólo para FINCAS)																						
108	Garantías en valores por inversiones en instrumentos financieros derivados																						
109	Garantías en valores por operaciones de préstamo de instrumentos financieros																						
110	Garantías en valores por operaciones de reporto																						

<b>R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>6</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda a la operación.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, registrar la clave de la Institución Bancaria de acuerdo con el Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).</p>
<b>7</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie conforme a la utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión de que se trate.</p> <p>En el caso de Cuentas de cheques, anotar los últimos siete números de la cuenta.</p>
<b>8</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>
<b>9</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo previo.</p>
<b>10</b>	<p><b>CANTIDAD DE TÍTULOS</b></p> <p>Se refiere a la Cantidad de títulos operados, conforme al reporte R03 J-0311 CARTERA DE INVERSIÓN (CO-CA).</p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>

**R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)**

Columna	Descripción
11	<p><b>PLAZO DEL CUPÓN</b></p> <p>Total de días que comprende el cupón vigente.</p> <p>En el caso de los depósitos bancarios a plazo con pago de intereses, deberán reportarse los días de la inversión.</p> <p>En el caso de cuentas de cheques con pago de intereses, deberá reportarse el período con el que se determina el pago de intereses sobre las mismas.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>
12	<p><b>FECHA INICIO DEL CUPÓN</b></p> <p>Especificar la fecha de inicio del cupón vigente.</p> <p>En los casos de cuentas de cheques corresponde a la fecha de inicio de la tasa de interés que paga la Institución Bancaria.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>
13	<p><b>FECHA DEL PRÓXIMO PAGO DE CUPÓN</b></p> <p>Especificar la fecha del próximo pago del cupón vigente.</p> <p>En el caso de los depósitos bancarios a plazo con pago de intereses, deberán reportarse la fecha de vencimiento de la inversión.</p> <p>En el caso de cuentas de cheques con pago de intereses, deberá reportarse la fecha en que la institución pagará los intereses.</p> <p>El formato para reportar este campo es AAAAMMDD (año, mes, día).</p>
14	<p><b>DÍAS TRANSCURRIDOS DEL CUPÓN</b></p> <p>Registrar el número de días transcurridos de la fecha de inicio del cupón a la fecha de valuación.</p> <p>En el caso de los depósitos bancarios a plazo con pago de intereses, deberá registrarse los días transcurridos entre la fecha de inicio de la inversión y la fecha de valuación.</p>



**R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)**

Columna	Descripción														
	<p>En el caso de cuentas de cheques con pago de intereses, deberá reportarse la diferencia entre el día siguiente al último pago de intereses y la fecha de valuación.</p> <p>Se deberá anotar el número de días sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>														
15	<p><b>VALOR NOMINAL DEL INSTRUMENTO EN LA MONEDA DE EMISIÓN</b></p> <p>Anotar el valor nominal vigente del instrumento de que se trate.</p> <p>Se deberá anotar el número, expresado en la moneda de origen a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el costo es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>														
16	<p><b>VALOR NOMINAL CALCULADO EN PESOS</b></p> <p>En su caso, se deberá anotar el valor nominal del instrumento en la moneda de emisión multiplicado por el tipo de cambio de la fecha de valuación a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el costo es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>														
17	<p><b>TASA DE CUPÓN VIGENTE</b></p> <p>Se deberá registrar la tasa de cupón del instrumento, correspondiente al período que se reporta.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>														
18	<p><b>TIPO DE TASA</b></p> <p>Se debe anotar la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Tipo de Tasa”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="370 1499 1458 1818"> <thead> <tr> <th data-bbox="375 1505 548 1547">CLAVE</th> <th data-bbox="553 1505 1453 1547">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="375 1549 548 1591">101</td> <td data-bbox="553 1549 1453 1591">Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1593 548 1635">102</td> <td data-bbox="553 1593 1453 1635">Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1638 548 1680">103</td> <td data-bbox="553 1638 1453 1680">Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1682 548 1724">104</td> <td data-bbox="553 1682 1453 1724">Tasa real</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1726 548 1768">105</td> <td data-bbox="553 1726 1453 1768">Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="375 1770 548 1812">106</td> <td data-bbox="553 1770 1453 1812">No aplica</td> </tr> </tbody> </table>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)	102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)	104	Tasa real	105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)	106	No aplica
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	Tasa de rendimiento (aplica a bonos cupón cero)														
102	Tasa fija (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
103	Tasa variable (aplica a bonos con pagos de interés periódicos)														
104	Tasa real														
105	Tasa de interés (aplica a cuentas de cheques en divisas)														
106	No aplica														

<b>R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Las claves del “Catálogo de Tipo de Tasa” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.
<b>19</b>	<p><b>VALOR DE LA UDI O TIPO DE CAMBIO</b></p> <p>En su caso, se deberá reportar el valor en pesos de la UDI o del tipo de cambio de la divisa que corresponda a la fecha de la valuación.</p> <p>Se deberá anotar en pesos a seis decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor es de \$ 69.68457875, se deberá reportar 69.684579.</p>
<b>20</b>	<p><b>INTERESES DEVENGADOS DEL PERÍODO</b></p> <p>Información aplicable a los depósitos bancarios a plazo y las cuentas de cheques, en cualquier divisa, con pago de intereses.</p> <p>Registrar el total de intereses devengados de la Fecha de Inicio del Cupón a la fecha de valuación y que corresponde a los intereses generados durante dicho período.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>21</b>	<p><b>INTERESES DEVENGADOS DEL CUPÓN</b></p> <p>Aplica a los instrumentos de deuda, con pago de intereses.</p> <p>Registrar los intereses devengados entre la Fecha de inicio del cupón y la fecha de valuación.</p> <p>En el caso de los valores que se encuentren en incumplimiento de pago, deberá reportarse la suma de los intereses de cada uno de los periodos no pagados por el emisor correspondientes.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>22</b>	<p><b>DÍAS POR VENCER DEL INSTRUMENTO</b></p> <p>Indicar el número de días existentes entre la fecha de vencimiento del instrumento y la fecha de valuación.</p>

<b>R03 J-0312 PROVISIÓN DE INTERESES DEVENGADOS SOBRE VALORES (CO-IN)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Se deberá anotar el número sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el número es de 1,569, se deberá reportar 1569.
<b>23</b>	<p><b>TASA DE INTERÉS DEL PERÍODO</b></p> <p>Este campo aplica a depósitos bancarios a plazo y cuentas de cheques, en cualquier divisa, con pago de intereses.</p> <p>Registrar la tasa que haya sido pactada.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>I. SECCIÓN IFORMACIÓN DETALLADA</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA (NÚMERO CONSECUTIVO DE LA CARTERA)	Numérico	5	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
11	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
12	FECHA INICIO DEL CUPÓN	Fecha	8	0
13	FECHA DEL PRÓXIMO PAGO DE CUPÓN	Fecha	8	0
14	DÍAS TRANSCURRIDOS DEL CUPÓN	Numérico	6	0
15	VALOR NOMINAL DEL INSTRUMENTO EN LA MONEDA DE EMISIÓN	Numérico	16	6
16	VALOR NOMINAL CALCULADO EN PESOS	Numérico	16	6
17	TASA DE CUPÓN VIGENTE	Numérico	16	6
18	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
19	VALOR DE LA UDI O TIPO DE CAMBIO	Numérico	16	6
20	INTERESES DEVENGADOS DEL PERÍODO	Numérico	21	0
21	INTERESES DEVENGADOS DEL CUPÓN	Numérico	21	0
22	DÍAS POR VENCER DEL INSTRUMENTO	Numérico	6	0
23	TASA DE CUPÓN DEL PERÍODO	Numérico	16	6

## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>I. SECCIÓN IFORMACIÓN DETALLADA</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA (NÚMERO CONSECUTIVO DE LA CARTERA)	Numérico	5	0
5	TIPO DE INVERSIÓN	Numérico	3	0
6	EMISORA	Alfanumérico	7	0
7	SERIE	Alfanumérico	10	0
8	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
9	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
10	CANTIDAD DE TÍTULOS	Numérico	21	0
11	PLAZO DEL CUPÓN	Numérico	6	0
12	FECHA INICIO DEL CUPÓN	Fecha	8	0
13	FECHA DEL PRÓXIMO PAGO DE CUPÓN	Fecha	8	0
14	DÍAS TRANSCURRIDOS DEL CUPÓN	Numérico	6	0
15	VALOR NOMINAL DEL INSTRUMENTO EN LA MONEDA DE EMISIÓN	Numérico	16	6
16	VALOR NOMINAL CALCULADO EN PESOS	Numérico	16	6
17	TASA DE CUPÓN VIGENTE	Numérico	16	6
18	TIPO DE TASA	Numérico	3	0
19	VALOR DE LA UDI O TIPO DE CAMBIO	Numérico	16	6
20	INTERESES DEVENGADOS DEL PERÍODO	Numérico	21	0
21	INTERESES DEVENGADOS DEL CUPÓN	Numérico	21	0
22	DÍAS POR VENCER DEL INSTRUMENTO	Numérico	6	0
23	TASA DE CUPÓN DEL PERÍODO	Numérico	16	6

## R03 J-0313 Control de garantías (CO-GA)

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 4 secciones:

1. *Sección identificador del reporte.*- En esta sección se presentan campos generales del reporte de captura, como son: el período, la clave de la entidad y la clave del reporte. Estos campos son utilizados por la CNBV para clasificar el tipo de reporte por período y la entidad correspondiente.
2. *Sección datos de la operación.*- Contiene solamente un campo, el Número de referencia del Reporto, Préstamo de instrumentos financieros u Operación financiera derivada.
3. *Sección garantías recibidas.*- Contiene los campos necesarios para identificar los activos objeto de inversión que se reciben como garantías de las operaciones por la entidad de que se trate.
4. *Sección garantías otorgadas.*- Contiene los campos necesarios para identificar los activos objeto de inversión que se otorgan como garantías de las operaciones celebradas por la entidad de que se trate.

El reporte está conformado por **24 (veinticuatro)** columnas, las cuales se describen a continuación:

R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)	
Columna	Descripción
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>	
<b>1</b>	<b>PERÍODO</b> Se refiere al período mensual o trimestral de la información que está reportando la entidad.  Este dato se captura al momento de importar el documento en el SITI, por lo que no forma parte del archivo que envía la entidad.  Cuando se trate de periodo diario se capturará el año seguido del mes y el día, por ejemplo, si se desea enviar la información del 02 de enero de 2022, el dato a capturar será: 20220102, si se refiere al 02 de diciembre de 2022, se capturará: 20221202.  En el caso de periodo trimestral, tomar en consideración que el año comprende cuatro trimestres, por lo que, si la información se refiere al primero del 2022, se

<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	deberá capturar: 202201, si se trata de información del último de 2022, se capturarán: 202204.
<b>2</b>	<p><b>CLAVE DE LA ENTIDAD</b></p> <p>Este dato se refiere a la clave CASFIM que la Institución que está reportando la información tiene asignada.</p> <p>Esta clave puede ser consultada en el catálogo denominado "Instituciones" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El formato para capturar este campo es #####.</p>
<b>3</b>	<p><b>REPORTE</b></p> <p>Para el envío de este reporte se utilizará la clave <b>313</b> que se puede obtener del catálogo "Subreportes" disponible en SITI y que por cuestiones de espacio no se presenta en este instructivo.</p> <p>El llenado de este campo es obligatorio y su longitud debe ser igual a 3 dígitos.</p>
<b>II. SECCIÓN DATOS DE LA OPERACIÓN</b>	
<b>4</b>	<p><b>NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO</b></p> <p>Se refiere al número de identificación de la operación pactada, por lo que, en caso de que se haya asignado más de un instrumento a la misma, este número deberá ser idéntico para cada uno de los valores de que se traten. Así mismo, dicho número deberá corresponder con el reportado en el CO-CA, CO-CV, CO-RE, CO-PR y CO-DE.</p> <p>La metodología para generar este número de referencia es la siguiente:</p> <p>Los tres primeros dígitos corresponderán a la clave proveniente del "Catálogo de Tipo de Inversión FI", los ocho dígitos siguientes se refieren a la fecha en la que se celebró por primera vez la operación, utilizando el formato AAAAMMDD, y los últimos cuatro números corresponderá al número consecutivo del total de operaciones que se hayan realizado durante el ejercicio.</p> <p>Por ejemplo, en el caso de una operación de reporto celebrada el 2 de enero de 2022, en la cual la entidad haya participado como reportadora, y sea la operación vigésima del año en curso, el número de referencia sería "102202201020020", el cual estaría integrado de la siguiente forma: 102, para indicar el tipo de inversión, 20220102 para indicar la fecha de inicio de la operación y 0020 para indicar el número de operación del año en curso.</p>

<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	Este número deberá ser el mismo, tratándose de operaciones que hayan sido prorrogadas, con el fin de identificar la operación que le dio origen.
<b>III. SECCIÓN GARANTÍAS RECIBIDAS</b>	
<b>5</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda a la operación.</p> <p>En el caso del efectivo que hubiera sido recibido, registrar la clave de la Institución Bancaria en la que hayan sido depositados los recursos, de acuerdo con el Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM). Tratándose de entidades financieras del exterior, deberá anotarse la clave corta de la misma.</p>
<b>6</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie conforme a la proporcionada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda.</p> <p>En el caso de efectivo que hubiera sido recibido anotar los últimos siete números de la cuenta en la cual hayan sido depositados los recursos.</p>
<b>7</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>
<b>8</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL QUE APLIQUE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo previo.</p>



<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>															
Columna	Descripción														
<b>9</b>	<p><b>CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA</b></p> <p>Se anotará la clave que corresponda a la calificación vigente asignada por la Institución Calificadora de Valores a la emisión o serie del instrumento, conforme al “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda”.</p> <p>La clave 101 No aplica, se utilizará únicamente en los instrumentos que no tengan la obligación de estar calificados.</p> <p>En caso de que el instrumento cuente con calificaciones emitidas por distintas calificadoras, deberá registrarse la que represente mayor riesgo.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>														
<b>10</b>	<p><b>BURSÁTILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE</b></p> <p>El grado de Bursatilidad de las acciones deberá identificarse con la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Índice de Bursatilidad”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="background-color: #cccccc;">CLAVE</th> <th style="background-color: #cccccc;">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">101</td> <td style="text-align: center;">BURSÁTILIDAD ALTA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">102</td> <td style="text-align: center;">BURSÁTILIDAD MEDIA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">103</td> <td style="text-align: center;">BURSÁTILIDAD BAJA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">104</td> <td style="text-align: center;">BURSÁTILIDAD MÍNIMA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">105</td> <td style="text-align: center;">BURSÁTILIDAD NULA</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">106</td> <td style="text-align: center;">NO APLICA</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Índice de Bursatilidad” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BURSÁTILIDAD ALTA	102	BURSÁTILIDAD MEDIA	103	BURSÁTILIDAD BAJA	104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA	105	BURSÁTILIDAD NULA	106	NO APLICA
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	BURSÁTILIDAD ALTA														
102	BURSÁTILIDAD MEDIA														
103	BURSÁTILIDAD BAJA														
104	BURSÁTILIDAD MÍNIMA														
105	BURSÁTILIDAD NULA														
106	NO APLICA														
<b>11</b>	<p><b>TÍTULOS</b></p> <p>Se refiere al número de títulos del instrumento que se haya recibido en garantía.</p> <p>Se deberá anotar el número sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>														

<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>12</b>	<p><b>VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Corresponde al valor razonable total de la operación de la cual se hayan recibido garantías.</p> <p>Se deberá anotar el monto redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>13</b>	<p><b>VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA</b></p> <p>Corresponde al resultado de multiplicar el total de Títulos recibidos en garantía por el valor razonable proporcionado por el proveedor de precios para la emisora y emisión o serie de que se trate.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>
<b>14</b>	<p><b>ÍNDICE VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN A VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA</b></p> <p>Se registrará el resultado de dividir el valor razonable de la garantía entre el valor razonable de la operación.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>
<b>IV. SECCIÓN GARANTÍAS OTORGADAS</b>	
<b>15</b>	<p><b>EMISORA</b></p> <p>Indicar la clave de la emisora utilizada por los proveedores de precios para el activo objeto de inversión que corresponda a la operación.</p> <p>En el caso del efectivo que hubiera sido entregado, registrar la clave de la Institución Bancaria en la que hayan sido depositados los recursos, de acuerdo con el Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM). Tratándose de entidades financieras del exterior, deberá anotarse la clave corta de la misma.</p>
<b>16</b>	<p><b>SERIE</b></p> <p>Indicar la emisión o serie conforme a la utilizada por los proveedores de precios para el registro y envío de información a la CNBV.</p>

<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
	En el caso del efectivo que hubiera sido entregado, anotar los últimos siete números de la cuenta en la cual hayan sido depositados los recursos.
<b>17</b>	<p><b>TIPO DE VALOR</b></p> <p>Se refiere a la clave de tipo de valor del instrumento de conformidad con el “Catálogo de Claves de Tipo de Valor”.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Claves de Tipo de Valor” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p> <p>La clave utilizada deberá ser la misma que la proporcionada por el proveedor de precios.</p>
<b>18</b>	<p><b>CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL QUE APLIQUE)</b></p> <p>Registrar el código ISIN, CUSIP, SEDOL o algún otro que pudiera aplicar al instrumento, proporcionado por el proveedor de precios. En caso de instrumentos que no cuenten con dicho código se deberá incluir AA000000000000.</p> <p>En caso de que el instrumento reportado cuente con más de un Código, deberá privilegiarse el reporte con base en el orden citado en el párrafo previo.</p>
<b>19</b>	<p><b>CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA</b></p> <p>Se anotará la clave que corresponda a la calificación vigente asignada por la Institución Calificadora de Valores a la emisión o serie del instrumento, conforme al “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda”.</p> <p>La clave 101 No aplica, se utilizará únicamente en los instrumentos que no tengan la obligación de estar calificados.</p> <p>En caso de que el instrumento cuente con calificaciones emitidas por distintas calificadoras, deberá registrarse la que represente mayor riesgo.</p> <p>El responsable de enviar esta información deberá verificar y, en su caso, actualizar las modificaciones que, en su caso, se lleguen a presentar durante la vigencia de la operación, en la fecha en que sucedan.</p> <p>Las claves del “Catálogo de Calificación Instrumentos de Deuda” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>

**R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)**

Columna	Descripción														
20	<p><b>BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE</b></p> <p>El grado de Bursatilidad de las acciones deberá identificarse con la clave que corresponde de acuerdo con el “Catálogo de Índice de Bursatilidad”, el cual contiene las siguientes opciones:</p> <table border="1" data-bbox="615 445 1205 762"> <thead> <tr> <th data-bbox="621 453 776 495">CLAVE</th> <th data-bbox="776 453 1198 495">DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="621 495 776 537">101</td> <td data-bbox="776 495 1198 537">BURSATILIDAD ALTA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="621 537 776 579">102</td> <td data-bbox="776 537 1198 579">BURSATILIDAD MEDIA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="621 579 776 621">103</td> <td data-bbox="776 579 1198 621">BURSATILIDAD BAJA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="621 621 776 663">104</td> <td data-bbox="776 621 1198 663">BURSATILIDAD MÍNIMA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="621 663 776 705">105</td> <td data-bbox="776 663 1198 705">BURSATILIDAD NULA</td> </tr> <tr> <td data-bbox="621 705 776 747">106</td> <td data-bbox="776 705 1198 747">NO APLICA</td> </tr> </tbody> </table> <p>Las claves del “Catálogo de Índice de Bursatilidad” se encuentran disponibles para su consulta en el SITI.</p>	CLAVE	DESCRIPCIÓN	101	BURSATILIDAD ALTA	102	BURSATILIDAD MEDIA	103	BURSATILIDAD BAJA	104	BURSATILIDAD MÍNIMA	105	BURSATILIDAD NULA	106	NO APLICA
CLAVE	DESCRIPCIÓN														
101	BURSATILIDAD ALTA														
102	BURSATILIDAD MEDIA														
103	BURSATILIDAD BAJA														
104	BURSATILIDAD MÍNIMA														
105	BURSATILIDAD NULA														
106	NO APLICA														
21	<p><b>TÍTULOS</b></p> <p>Se refiere al número de títulos del instrumento que se haya entregado en garantía.</p> <p>Se deberá anotar el número de títulos sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el importe es de 1,569, se deberá reportar 1569.</p>														
22	<p><b>VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN</b></p> <p>Corresponde al valor razonable total de la operación por la cual se hayan entregado garantías.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>														
23	<p><b>VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA</b></p> <p>Corresponde al resultado de multiplicar el total de Títulos entregados en garantía por el valor razonable proporcionado por el proveedor de precios para la emisora y emisión o serie de que se trate.</p> <p>Se deberá anotar el monto en pesos redondeado sin decimales y sin comas. Ejemplo: si el valor total es de \$ 236,569.68, se deberá reportar 236570.</p>														

<b>R03 J-0313 CONTROL DE GARANTÍAS (CO-GA)</b>	
<b>Columna</b>	<b>Descripción</b>
<b>24</b>	<p><b>ÍNDICE VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN A VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA</b></p> <p>Se registrará el resultado de dividir el valor razonable de la garantía entre el valor razonable de la operación.</p> <p>Deberá reportarse el porcentaje expresado en base cien, con seis decimales, redondeados y sin el signo de porcentaje (%) ejemplo: 58.75899587% se deberá anotar 58.758996.</p>

## Definición del Documento Reporte Diario:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	8	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN DATOS DE LA OPERACIÓN</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
<b>III. SECCIÓN GARANTÍAS RECIBIDAS</b>				
5	EMISORA	Alfanumérico	7	0
6	SERIE	Alfanumérico	10	0
7	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
8	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
9	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
10	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
11	TÍTULOS	Numérico	21	0
12	VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
13	VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA	Numérico	21	0
14	ÍNDICE VAL. RAZ. DE LA OPERACIÓN A VAL. RAZ. DE LA GARANTÍA	Numérico	16	6
<b>IV. SECCIÓN GARANTÍAS OTORGADAS</b>				
15	EMISORA	Alfanumérico	7	0
16	SERIE	Alfanumérico	10	0
17	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
18	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
19	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
20	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
21	TÍTULOS	Numérico	21	0
22	VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
23	VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA	Numérico	21	0
24	ÍNDICE VAL. RAZ. DE LA OPERACIÓN A VAL. RAZ. DE LA GARANTÍA	Numérico	16	6

## Definición del Documento Reporte Trimestral:

ORDEN	NOMBRE	TIPO	LONGITUD	DECIMALES
<b>I. SECCIÓN IDENTIFICADOR DEL REPORTE</b>				
1	PERÍODO	Numérico	6	0
2	CLAVE DE LA ENTIDAD	Alfanumérico	6	0
3	REPORTE	Numérico	4	0
<b>II. SECCIÓN DATOS DE LA OPERACIÓN</b>				
4	NÚMERO DE REFERENCIA: REPORTO, PRÉSTAMO, DERIVADO	Numérico	15	0
<b>III. SECCIÓN GARANTÍAS RECIBIDAS</b>				
5	EMISORA	Alfanumérico	7	0
6	SERIE	Alfanumérico	10	0
7	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
8	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
9	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUDA	Numérico	3	0
10	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
11	TÍTULOS	Numérico	21	0
12	VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
13	VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA	Numérico	21	0
14	ÍNDICE VAL. RAZ. DE LA OPERACIÓN A VAL. RAZ. DE LA GARANTÍA	Numérico	16	6
<b>IV. SECCIÓN GARANTÍAS OTORGADAS</b>				
15	EMISORA	Alfanumérico	7	0
16	SERIE	Alfanumérico	10	0
17	TIPO DE VALOR	Alfanumérico	4	0
18	CÓDIGO DE IDENTIFICACIÓN (ISIN, CUSIP, SEDOL O EL APLICABLE)	Alfanumérico	14	0
19	CALIFICACIÓN INSTRUMENTO DE DEUA	Numérico	3	0
20	BURSATILIDAD INSTRUMENTO DE RENTA VARIABLE	Numérico	3	0
21	TÍTULOS	Numérico	21	0
22	VALOR RAZONABLE DE LA OPERACIÓN	Numérico	21	0
23	VALOR RAZONABLE DE LA GARANTÍA	Numérico	21	0
24	ÍNDICE VAL. RAZ. DE LA OPERACIÓN A VAL. RAZ. DE LA GARANTÍA	Numérico	16	6