

**CIRCULAR CONSAR 19-29 Modificaciones y adiciones a las Reglas Generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro.<sup>1</sup>**

Al margen un sello con el Escudo Nacional, que dice: Estados Unidos Mexicanos.- HACIENDA.- Secretaría de Hacienda y Crédito Público.- Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro.

**CIRCULAR CONSAR 19-29**

**MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.**

El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, con fundamento en lo dispuesto en los artículos 5 fracciones I, II, VII y XVI, 12 fracciones I, VIII y XVI, 88, 89, 90 fracciones II, 91 y 113 de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 106 de la Ley del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado; 140 del Reglamento de la Ley de los Sistemas de Ahorro para el Retiro; 1, 2 fracción III y 8 primer párrafo del Reglamento Interior de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, y

**CONSIDERANDO**

Que la Circular 19-8, "Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro" con sus modificaciones y adiciones, tienen por objeto establecer el procedimiento y requisitos a los que deberán sujetarse las Administradoras de Fondos para el Retiro, Sociedades de Inversión Especializadas de Fondos para el Retiro, Entidades Receptoras y Empresas Operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, en cuanto a la información que deberán proporcionar a la Comisión, para que ésta cuente con los elementos necesarios para supervisar su adecuado funcionamiento;

Que, para contar con toda la información necesaria para supervisar el funcionamiento de los Participantes en los Sistemas de Ahorro para el Retiro, es necesario que se actualicen los anexos 75, 77, 78, 118, 119, 121, 123, 141, 143 y 144, con el objeto de mantener actualizados los catálogos de contrapartes y las denominaciones de los sistemas de concertación, catálogos de calificaciones y calificadoras, los cuales se actualizan de forma recurrente;

Que para instrumentar la adición del artículo 96 bis de las Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro, publicada en el Diario Oficial de la Federación el 27 de septiembre de 2022, relativo a la obligación de las Administradoras de entregar a la Comisión información sobre la valuación de Activos Objeto de Inversión es necesario incorporar un nuevo anexo 148 que permita a los regulados dar cumplimiento a dicha obligación, y

Que de conformidad con la Ley General de Mejora Regulatoria, las presentes modificaciones no generan costos de cumplimiento a los particulares obligados, ya que no se generan obligaciones, sanciones, no se modifican o crea trámites que signifiquen mayores cargas administrativas o costos de cumplimiento, no reduce o restringen prestaciones o derechos, no establecen o modifican definiciones, clasificaciones, metodologías, criterios, caracterizaciones o cualquier otro término de referencia, afectando derechos, obligaciones, prestaciones o trámites de los particulares ya que se trata de una actualización natural de catálogos y referencias, y por otro lado, la incorporación del anexo 148, deriva de una obligación previamente cuantificada en diverso cuerpo normativo previamente publicado, ha tenido a bien expedir las siguientes:

**MODIFICACIONES Y ADICIONES A LAS REGLAS GENERALES A LAS QUE DEBERÁ SUJETARSE LA INFORMACIÓN QUE LAS ADMINISTRADORAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO, LAS ENTIDADES RECEPTORAS Y LAS EMPRESAS OPERADORAS DE LA BASE DE DATOS NACIONAL SAR, ENTREGUEN A LA COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO.**

<sup>1</sup> Publicada en el Diario Oficial de la Federación el 7 de julio de 2023

**PRIMERO.-** Se **MODIFICA** la regla Séptima, fracciones L y LI, y se **ADICIONA** la fracción XXVIII a la regla Séptima, de la Circular CONSAR 19-8, “Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro”, modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18, CONSAR 19-19, CONSAR 19-20, CONSAR 19-21, CONSAR 19-22, CONSAR 19-23, CONSAR 19-24, CONSAR 19-25, CONSAR 19-26, CONSAR 19-27 y CONSAR 19-28 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016, 6 de septiembre de 2017, 15 de marzo de 2018, 18 de enero de 2019, 31 de mayo de 2019, 8 de octubre de 2019, 5 de diciembre de 2019, 17 de diciembre de 2020, 31 de mayo de 2021, y 4 de febrero y 25 de julio de 2022 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

**“SEPTIMA.** - La información que las Administradoras deberán proporcionar a la Comisión consiste en:

**I. a XLIX. ...**

**L.** Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del tercer día hábil anterior al de entrega del formato, de conformidad con el formato establecido como anexo 143 de las presentes reglas generales;

**LI.** Información pública disponible de la composición de Fondos Mutuos, al cierre del último día hábil correspondiente a dos meses anteriores a la entrega del formato, de conformidad con el formato establecido como anexo 144 de las presentes reglas generales, y

**LII.** Los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores, de conformidad con lo establecido en el anexo 148 de las presentes reglas generales.”

**SEGUNDO.-** Se **MODIFICAN** los anexos 75, 77, 78, 118, 119, 121, 123, 141, 143 y 144 y se **ADICIONA** el anexo 148, de la Circular CONSAR 19-8, “Reglas generales a las que deberá sujetarse la información que las administradoras de fondos para el retiro, las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro, las entidades receptoras y las empresas operadoras de la Base de Datos Nacional SAR, entreguen a la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro”, modificada y adicionada por las Circulares CONSAR 19-9, CONSAR 19-10, CONSAR 19-11, CONSAR 19-12, CONSAR 19-13, CONSAR 19-14, CONSAR 19-15, CONSAR 19-16, CONSAR 19-17, CONSAR 19-18, CONSAR 19-19, CONSAR 19-20, CONSAR 19-21, CONSAR 19-22, CONSAR 19-23, CONSAR 19-24, CONSAR 19-25, CONSAR 19-26, CONSAR 19-27 y CONSAR 19-28 publicadas en el Diario Oficial de la Federación los días 18 de agosto de 2008, 22 de enero de 2010, 2 de julio de 2010, 15 de agosto de 2011, 6 de julio de 2012, 16 de octubre de 2012, 7 de junio de 2013, 27 de septiembre de 2013, 9 de septiembre de 2014, 17 de agosto de 2015, 6 de junio de 2016, 6 de septiembre de 2017, 15 de marzo de 2018, 18 de enero de 2019, 31 de mayo de 2019, 8 de octubre de 2019, 5 de diciembre de 2019, 17 de diciembre de 2020, 31 de mayo de 2021, y 4 de febrero de 2022, y 25 de julio de 2022 respectivamente, para quedar en los siguientes términos:

**TRANSITORIAS**


**PRIMERA.-** Las presentes modificaciones y adiciones entrarán en vigor al día hábil siguiente de su publicación en el Diario Oficial de la Federación con excepción de lo siguiente:

- I. El formato establecido como Anexo 123 de las presentes reglas, entrará en vigor a los 30 días naturales después al de su publicación en el Diario Oficial de la Federación.
- II. El formato establecido como Anexo 148 de las presentes reglas, entrará en vigor a los 90 días naturales después al de su publicación en el Diario Oficial de la Federación.

**SEGUNDA.-** Con la entrada en vigor de las presentes modificaciones y adiciones, se abrogan todas aquellas disposiciones que contravengan a las presentes.







Ciudad de México, a 21 de junio de 2023.- El Presidente de la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro, Mtro. **Julio César Cervantes Parra.-** Rúbrica.

**Anexo 75**

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0316	<b>PROCESO :</b>	FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b>	AFORES (con información de SIEFORES)	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	






DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.-</b> Este archivo contiene Información del desglose de operaciones de compraventa durante el día. Se deberá enviar un archivo por SIEFORE.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO.	203	16:00 a 20:00 Hrs.

**ENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante " <b>203</b> ". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante"0316"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave de Tipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	6	0	22	27	Clave de Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	28	35	Fecha de la Operación que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	168	0	36	203	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE(S)**

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA							
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud	Posición	Observaciones	

				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación <sup>1</sup> .
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores 12 Para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones Tercerizadas <sup>1</sup> .
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01 <sup>1</sup> .
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								en pesos se deberá anotar EFECTIV. <sup>5</sup>
11	Serie		AN	7	0	52	58	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59	68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de Activo de la Inversión Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros <sup>15</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación <sup>3</sup> .
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77	88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104	118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que los valores reportados no cuenten con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo 15 del presente formato "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
17	Monto total a liquidar		N	14	2	119	134	Monto total a liquidar en la operación en pesos En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a la Circular CONSAR serie 15

DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								vigentes. <sup>2</sup> .
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135	140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	147	148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. 1
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros <sup>2, 9</sup> .
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países <sup>1</sup> .
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes.  En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13:  -En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación.  -En caso de ser operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del Custodio Internacional, de la Plataforma de Negociación Electrónica o del Administrador con el que se haya realizado la operación, según el Catálogo de Contrapartes.  -En caso de flujos por dividendos o cupones se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes.  -En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup> .
24	Hora de concertación de la operación		N	4	0	172	175	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros <sup>10</sup> .
25	Banco de Trabajo		N	1	0	176	176	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si=1 y No=0 <sup>1</sup> .
26	Medio de concertación		N	1	0	177	177	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación:  0 = No aplica

**DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								<p>1 = Telefónico</p> <p>2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación.</p> <p>En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá considerar lo siguiente:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Cuando se realicen a través del Custodio Internacional o del Administrador se deberá indicar 0.</li> <li>- Cuando se realicen a través de Plataformas se deberá indicar 2.<sup>1</sup></li> </ul>
27	Sistema de concertación		N	2	0	178	179	<p>En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros.</p> <p>Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado.</p> <p>0 - No aplica</p> <p>1 - MEI</p> <p>2 - SIPO</p> <p>3 - VAR</p> <p>4 - MEIPresval</p> <p>5 - Corros Monex</p> <p>6 - Bloomberg</p> <p>7 - Market Axess</p> <p>8 - Reuters</p> <p>99 - OTRO</p> <p>En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos que se realicen a través de Plataformas, se deberá indicar 99.<sup>1</sup>.</p>
28	Tipo de postura		N	1	0	180	180	<p>Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta.</p> <p>1 - Agresor</p> <p>2 - Agredido</p> <p>Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción.<sup>1</sup></p>
29	Clase de Activo de la Inversión tercerizada		N	3	0	181	183	<p>En caso de ser inversión tercerizada se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de Activos de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros<sup>1</sup>.</p>
30	Observaciones		AN	20	0	184	203	<p>Se deberá anotar el nombre de la contraparte en caso de haber utilizado el Identificador 076000 "otros operadores" o 700000 "otros</p>

## DETALLE 1: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								Bancos extranjeros" como Contraparte <sup>5</sup> .

## CATÁLOGO(S)

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

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

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	CITIBANAMEX
556	AZTECA
562	INVERCAP
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	000090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.
002	538	000090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	000090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	000090	Siefore Básica de Pensiones	Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	568	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	000090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001000	Siefore Inicial	Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	534	001000	Siefore Inicial	Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE.
002	538	001000	Siefore Inicial	Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	544	001000	Siefore Inicial	Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	550	001000	Siefore Inicial	Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	552	001000	Siefore Inicial	Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	556	001000	Siefore Inicial	Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	562	001000	Siefore Inicial	Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	568	001000	Siefore Inicial	Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	578	001000	Siefore Inicial	Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	530	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V.



Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	534	001955	Siefore Básica 55-59	Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001955	Siefore Básica 55-59	Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	544	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	550	001955	Siefore Básica 55-59	Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	552	001955	Siefore Básica 55-59	Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	556	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	562	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	568	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V.
002	578	001955	Siefore Básica 55-59	Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	530	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	534	001960	Siefore Básica 60-64	Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001960	Siefore Básica 60-64	Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	544	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	550	001960	Siefore Básica 60-64	Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	552	001960	Siefore Básica 60-64	Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	556	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	562	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	568	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V.
002	578	001960	Siefore Básica 60-64	Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	530	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	534	001965	Siefore Básica 65-69	Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001965	Siefore Básica 65-69	Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	544	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	550	001965	Siefore Básica 65-69	Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	552	001965	Siefore Básica 65-69	Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	556	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	562	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	568	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V.
002	578	001965	Siefore Básica 65-69	Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	530	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	534	001970	Siefore Básica 70-74	Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001970	Siefore Básica 70-74	Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	544	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	550	001970	Siefore Básica 70-74	Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	552	001970	Siefore Básica 70-74	Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	556	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	562	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	568	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V.
002	578	001970	Siefore Básica 70-74	Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	530	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	534	001975	Siefore Básica 75-79	Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001975	Siefore Básica 75-79	Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	544	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	550	001975	Siefore Básica 75-79	Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	552	001975	Siefore Básica 75-79	Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	556	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	562	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	568	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V.
002	578	001975	Siefore Básica 75-79	Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	530	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	534	001980	Siefore Básica 80-84	Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001980	Siefore Básica 80-84	Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	544	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	550	001980	Siefore Básica 80-84	Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	552	001980	Siefore Básica 80-84	Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	556	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	562	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	568	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	578	001980	Siefore Básica 80-84	Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	530	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	534	001985	Siefore Básica 85-89	Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001985	Siefore Básica 85-89	Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	544	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	550	001985	Siefore Básica 85-89	Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	552	001985	Siefore Básica 85-89	Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	556	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	562	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	568	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V.
002	578	001985	Siefore Básica 85-89	Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	530	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	534	001990	Siefore Básica 90-94	Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001990	Siefore Básica 90-94	Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	544	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	550	001990	Siefore Básica 90-94	Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	552	001990	Siefore Básica 90-94	Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	556	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	562	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	568	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V.
002	578	001990	Siefore Básica 90-94	Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
003	334	000001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
004	430	000001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	000007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	000009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	000010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	000003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

Catálogo de Tipo de Inversión		
Id	Abreviación	Descripción
0	Di	Directo
1	Re	Reporto
6	Pv	Préstamo de Valores
7	Gd	Garantías entregadas por operaciones con IFD
8	Gr	Garantías recibidas por operaciones de Reporto
9	Gi	Garantías recibidas por operaciones con IFD
10	Gp	Garantías recibidas por Préstamo de Valores
11	Ce	Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados
12	Ef	Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa
13	Ec	Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa.

Catálogo de Tipo de Liquidación		
Id	Abreviación	Descripción
1	MD	Mismo Día
2	24	24 Hrs.
3	48	48 Hrs.
4	72	72 Hrs.
5	96	96 Hrs.
6	120	120 Hrs.
7	144	144 Hrs.
8	168	168 Hrs.
9	192	192 Hrs.

14	Lt	Inversiones tercerizadas
15	Ge	Garantías entregadas por instrumentos Estructurados
16	Oc	Operaciones Cambiarias de compra o venta de divisas.
17	Er	Garantías entregadas por operaciones de Reporto
18	Ep	Garantías entregadas por operaciones de Préstamo de Valores

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

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción
1	BCC	Bono Cupón Cero
2	BTF	Bono Tasa Fija
3	TFA	Bono Tasa Fija Amortizable
4	BTV	Bono Tasa Flotante
5	TVA	Bono Tasa Flotante Amortizable
6	ACC	Acciones
7	ETF	Exchange Traded Funds
8	NEP	Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento
9	TRK	Instrumentos conocidos como Trackers
10	EFF	Efectivo
11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
12	MDT	Inversión Tercerizada
13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente
14	FMU	Fondo Mutuo

Catálogo de Tipo de Operación			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	001-250	Co	Compra
2	501-750	Ve	Venta
3	251-500	Ac	Compra por amortización
4	751-999	Av	Venta por amortización

Catálogo de Clase de Activos de Inversión Tercerizada	
Identificador	Descripción
0	No aplica
1	Mercancías.
2	Renta Variable.
3	Deuda Extranjera
999	Otro.

Catálogo de Sistema de Concertación	
Identificador	Descripción
0	No aplica
1	MEI
2	SIPO
3	VAR
4	MEIPresval
5	Corros Monex
6	Bloomberg
7	Market Axess
8	Reuters
99	OTRO

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	27	Hungría
2	Australia	28	Letonia
3	Austria	29	Lituania
4	Bélgica	30	Malta
5	Canadá	31	República Checa
6	Dinamarca	32	Suecia
7	España	33	Brasil
8	Estados Unidos de Norteamérica	34	China
9	Finlandia	35	India
10	Francia	36	Otro
11	Grecia	37	Rumanía
12	Países Bajos (Holanda)	38	Noruega
13	Hong Kong	39	Chile
14	Irlanda	40	Israel
15	Italia	41	Bulgaria
16	Japón	42	Colombia
17	Luxemburgo	43	Corea del Sur
18	México	44	Islandia
19	Polonia	45	Perú
20	Portugal	46	Singapur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	47	Malasia
22	Suiza	48	Nueva Zelanda
23	Chipre	49	Sudáfrica
24	Eslovaquia	50	Tailandia
25	Eslovenia	51	Taiwán
26	Estonia	52	Croacia

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
2001	Banco de México	82035	Confia Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	82037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13004	Casa de Bolsa Santander Serfín	82039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	82042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
13006	HSBC Casa de Bolsa	82043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
13007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	82044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en

13010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer
13011	Multivalores Casa de Bolsa
13012	Finamex Casa de Bolsa
13013	IXE Casa de Bolsa
13015	Interacciones Casa de Bolsa
13018	Casa de Bolsa Arka
13019	Value Casa de Bolsa
13020	Actinver Casa de Bolsa
13021	Monex Casa de Bolsa
13026	Vector Casa de Bolsa
13027	Casa de Bolsa Banorte
13032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa
13040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa
13041	Invex Casa de Bolsa
13104	ING Baring (México) Casa de Bolsa
13105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa
13106	Deutsche Securities Casa de Bolsa
13109	J.P. Morgan Casa de Bolsa
13114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa
13118	Casa de Bolsa Credit Suisse México
13119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa
13120	UBS Casa de Bolsa
13121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13122	Base Internacional Casa de Bolsa
13123	Barclays Capital Casa de Bolsa
13124	Intercam Casa de Bolsa
13125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13126	BullTick Casa de Bolsa
13127	Masari Casa de Bolsa, S.A.
13129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
16031	Monex Divisas, S.A. de C.V.
16035	Central de Divisas Casa de Cambio
16040	Consultoría Internacional Casa de Cambio
16041	Casa de Cambio Tiber
16044	Eurofímex, Casa de Cambio
16067	Masari, Casa de Cambio
16240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio
16408	B y B Casa de Cambio
16419	Finamex Casa de Cambio
16507	Casa de Cambio Tamibe
16533	Casa de Cambio Majapara
16587	Sterling Casa de Cambio
16629	Money Tron Casa de Cambio
16712	Intercam Casa de Cambio
16714	Order Express Casa de Cambio
16715	Prodira, Casa de Cambio
16717	Imperial Casa de Cambio
16718	Divisas San Jorge Casa de Cambio
16719	Unica Casa de Cambio
25001	Bolsa Mexicana de Valores
25002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores

	Londres, Inglaterra.
82048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
82049	Bancomer Sucursal en Houston
82050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
82051	Casa de Bolsa Ve por Más
700000	Otros Bancos Extranjeros
701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
701001	Abasis
701002	American Express (Extranjero)
701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
701005	Bank Of America (Extranjero)
701006	Bank Boston Na (Extranjero)
701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
701008	Bank Of New York (Extranjero)
701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
701010	Bank One (Extranjero)
701011	BNP Paribas (Extranjero)
701012	Barclays Bank (Extranjero)
701013	Bear Stearns (Extranjero)
701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
701016	Citi National Bank (Extranjero)
701017	Citibank (Extranjero)
701018	Comerica Bank (Extranjero)
701019	Commerzbank (Extranjero)
701020	Controladora Prosa
701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
701022	Credit Suisse (Extranjero)
701023	Den Danske Bank (Extranjero)
701024	Deutsche Bank (Extranjero)
701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
701026	Fortis Bank (Extranjero)
701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
701030	Indosuez International (Extranjero)
701031	ING Bank (Extranjero)
701032	J.P. Morgan (Extranjero)
701033	Lehman Brothers (Extranjero)
701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
701038	Republic National Bank (Extranjero)
701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
701041	Societe Generale (Extranjero)
701042	Solomon Brothers (Extranjero)
701043	Standard Bank London (Extranjero)
701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
701048	Union Bank (Extranjero)
701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)

25007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados
25013	Contraparte Central de Valores de México
25014	Flujos por pago de cupón o dividendo
37006	Banco Nacional de Comercio Exterior
37009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos
37019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada
37135	Nacional Financiera
37166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros
37168	Sociedad Hipotecaria Federal
40002	Banco Nacional de México
40012	BBVA Bancomer
40014	Banco Santander
40017	BBVA Bancomer Servicios
40021	HSBC México
40022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero
40030	Banco del Bajío
40032	Ixe Banco
40036	Banco Inbursa
40037	Banco Interacciones
40042	Banca Mifel
40044	Scotiabank Inverlat
40058	Banco Regional de Monterrey
40059	Banco Invex
40060	Bansi
40062	Banca Afirme
40072	Banco Mercantil del Norte
40102	The Royal Bank of Scotland México
40103	American Express Bank (México)
40106	Bank of America México
40108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)
40110	Banco J.P. Morgan
40112	Banco Monex
40113	Banco Ve por Más
40116	ING Bank (México)
40124	Deutsche Bank México
40126	Banco Credit Suisse México
40127	Banco Azteca
40128	Banco Autofin México
40129	Barclays Bank México
40130	Banco Compartamos
40131	Banco Ahorro Famsa
40132	Banco Multiva
40133	Banco Actinver
40134	Banco Wal-Mart de México Adelante
40136	Banco Regional
40137	BanCoppel
40138	Banco Amigo
40139	UBS Bank México
40140	Banco Fácil
40141	Volkswagen Bank
40142	El Banco Deuno
40143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple
40144	The Bank of New York Mellon (México)
40145	Banco Base
40160	Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple

701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
701053	NYSE (New York Stock Exchange)
701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
701275	Asigna, Compensación y Liquidación
701276	Chicago Board of Trade
701277	Credit Agricole Corp
701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
801150	Bank Morgan Stanley Ag
801151	Smith Barney / Cgm Inc.
801152	Citi Bank N.A. New York Officers
801153	Pershing Inc.
801154	Calyon Financial Inc.
801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
801157	Segregación de Instrumentos
801158	Segregación Inversa de Instrumentos
801159	Reclasificaciones
801160	Acciones Propias
801161	Cortes Transversales
801162	Bank West
801163	Bcpbank Canada
801164	Bridgewater Bank
801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
801166	Canadian Tire Bank
801167	Canadian Western Bank
801168	Citizens Bank Of Canada
801169	Cs Alterna Bank
801170	Dundee Bank Of Canada
801171	First Nations Bank Of Canada
801172	General Bank Of Canada
801173	Laurentian Bank Of Canada
801174	Manulife Bank Of Canada
801175	National Bank Of Greece (Canada)
801176	Pacific & Western Bank Of Canada
801177	Wachovia Bank N.A.
801178	Wells Fargo Bank N.A.
801179	Us Bank N.A.
801180	Suntrust Bank
801181	Hsbc Bank Usa N.A.
801182	Fia Card Svc N.A.
801183	Regions Bank
801184	National City Bank
801185	Branch Bkg & TC
801186	State Street B&TC
801187	Countrywide Bank N.A.
801188	Pnc Bank N.A.
801189	Keybank N.A.

46048	Citibank (Banamex USA)
47005	Morgan Stanley and Company Limited
76000	Otros Operadores
76001	Derfin
76008	Stock & Price
76010	Scotia Inverlat Derivados
76014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados
76018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)
76022	Darka
76029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados
76043	Timber Hill LLC.
76044	Enlace Derivados
76048	Intercam Derivados
79001	Bancomer Holding-Islas Caimán
79003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.
79004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.
79005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo
79006	Euro-American Capital Corporation Limited.- Islas Caimán
79009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.
79010	California Commerce Bank-California, E.U.A.
79012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda
79013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda
79014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán
79015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.
79016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán
79017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán
79018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán
79022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.
79025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.
79026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp
79027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.
79028	BBVA Bancomer USA
79029	Dinero Express
79030	Banorte USA Corporation
79031	INB Financial Corp.
79032	INB Delaware Corporation
79033	Inter Nacional Bank
80000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras
80001	Acci Securities Incorporated
80004	Afin Securities International Limited
80005	Arka Securities Incorporated
80008	BBVA Bancomer Securities International Inc.
80009	BBVA Bancomer Holdings Corporation
80013	Vectormex Incorporated
80014	Vectormex Global Advisors Incorporated
80015	Vectormex International Incorporated
80019	Valores Finamex Corporation, Inc.
80020	Valores Finamex International Incorporated

801190	Lasalle Bank N.A.
801191	North Fork Bank
801192	Manufacturers & Traders Tc
801193	Bank Of The West
801194	Fifth Third Bank
801195	Northern TC
801196	Goldman Sachs Paris
801197	Citigroup Global Markets, INC
801198	Jefferies Group, LLC
801199	UBS Securities, LLC
801200	Evercore, LLC
801201	GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney)
801202	Santander USA
801203	CME Clearing
801204	Barclays Capital, Inc
801205	BCP Securities, LLC
801206	BTG Pactual US Capital, LLC
801207	Bulltick, LLC
801208	Santander Investment Securities, Inc
801209	Scotia Capital, Inc
801210	Natixis
801211	XP Securities LLC
801212	INTL FCStone
801213	LarrainVial Securities US LLC
801214	HSBC Securities USA
801215	Stone Financial Inc.
801216	ICE Clearing
900000	Otros Mandatarios o Administradores
900001	Schroders Plc.
900002	Blackrock Inc.
900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
900004	Amundi Asset Management
900005	Nomura Holdings, Inc .
900007	Wellington Management Company LLP
900008	Ninety One PLC
900009	Alliance Bernstein
900011	Fidelity International
900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.
900014	Goldman Sachs Asset Management International
900015	Morgan Stanley Investment Management Inc
900016	Vanguard Group
900017	Natixis
900018	WisdomTree Investments, Inc.
900019	State Street Corporation
900020	DWS Investments
900021	Sherpa Capital
900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
900023	FirstTrust
900024	Baillie Gifford

80021	Finamex Securities Incorporated
80022	Valores Finamex Limited
80023	Interacciones Global Incorporated
80024	Inter-Financial Services, Limited
80025	Monex Securities Incorporated
80026	Invex Incorporated
80027	GBM International Incorporated
80028	Foreign Holdings Ltd.
80029	Portfolio Investment Incorporated
80030	Arka International, Corp.
80031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
80032	Banorte Asset Management, Inc.
80033	Afin International Holdings, Inc.
80034	Banorte I, LLC.
80037	Invex International, S.A.
80038	Invex Worldwide, S.A.
80041	Inbursa International, Inc.
80042	Inbursa Securities, Inc.
80043	IXE Holdings, Inc.
82004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
82006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
82008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
82009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
82010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
82011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
82012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
82014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
82016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
82025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
82027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
82030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
82031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán

900025	UBS AG
900026	AXA Investment Managers
900027	BNP Paribas Asset Management
900028	GAM Holding AG
900029	Invesco Capital Management
900030	Janus Henderson Investors
900031	Jupiter Asset Management Limited
900032	NN Investment Partners B.V.
900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
900034	Columbia Threadneedle Investments
900035	UTI Asset Management
900036	Nikko Asset Management
900037	Global X
900038	VanEck
900039	KraneShares
900040	ProShares
900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
900043	Acadian Asset Management LLC
900044	Man Group
900045	Berenberg
900046	Finamex
900047	ODDO BHF Asset Management SAS
910000	Otras Bolsas de Derivados
920000	Otros Socios Operadores
930000	Otros Socios Liquidadores
940000	Otras Cámaras de Compensación
950000	Otras Plataformas Electrónicas de Negociación
950001	Allfunds Bank, S.A.U.
950002	Fundvest, Pershing LLC
950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

#### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día

MM = mes



AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

<sup>9</sup> El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

<sup>10</sup> Hora de Operación. Se deberá llenar con el estilo HHMM, con las Horas en formato de 00 - 24 Horas y los minutos de 00 - 60.

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

#### **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

1° ISIN, de no existir éste,

2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

3° SEDOL.

Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores, salvo en instrumentos provenientes de operaciones primarias, pendientes de liquidar, en donde estos identificadores aún no sean asignados y por tanto no existan.

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

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

#### **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

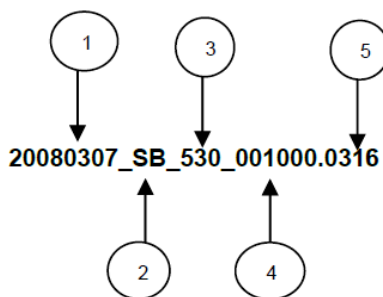
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- V. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente:

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	6 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0316"</b> .

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_001000.0316.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_001000.0316**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:







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

#### Anexo 77

Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro			
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b>	0314	<b>PROCESO:</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE:</b>	AFORES (con información de SIEFORES)	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.-</b> Este archivo contiene información del desglose de operaciones con instrumentos financieros derivados (Forwards, Futuros, Opciones y Swaps). Se deberá enviar un archivo por SIEFORE".			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	738	07:00 a 10:00 Hrs.

#### ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = Constante " <b>738</b> ". <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0314"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave de Tipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	6	0	22	27	Clave de Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	28	35	Fecha de información correspondiente al día hábil previo al que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	703	0	36	738	Vacíos. <sup>6</sup>

#### DETALLE(S)


DETALLE 1: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>

4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Tipo de Operación		N	3	0	141	143	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
13	Subyacente		AN	18	0	144	161	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
14	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
15	Divisa de Liquidación		N	2	0	165	166	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. <sup>1</sup>
16	Plazo de referencia		N	4	0	167	170	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
17	Fecha de operación		F	8	0	171	178	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
18	Fecha de inicio		F	8	0	179	186	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un derivado fecha valor o no. <sup>3</sup>
19	Fecha de liquidación		F	8	0	187	194	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0	195	202	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
21	Tamaño del contrato		N	14	2	203	218	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
22	Número de contratos		N	14	0	219	232	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	233	235	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
24	Precio o Tasa pactada		N	14	7	236	256	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
25	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	257	262	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del

								contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
26	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	263	263	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
27	Tipo de Valor del Cheapest to Deliver		AN	4	0	264	267	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
28	Emisora del Cheapest to Deliver		AN	7	0	268	274	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
29	Serie del Cheapest to Deliver		AN	6	0	275	280	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	281	289	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
31	Medio de Concertación		N	1	0	290	290	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
32	Contraparte		N	8	0	291	298	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
33	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	299	318	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista identificador para la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
34	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	319	321	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
35	Calificación contraparte primera		N	4	0	322	325	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
36	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	326	328	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación contraparte segunda		N	4	0	329	332	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>
38	Observaciones y características especiales		AN	150	0	333	482	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
39	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	483	502	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
40	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	503	516	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
41	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	517	524	En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de

								Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
42	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	525	544	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
43	Socio Operador		N	8	0	545	552	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
44	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	553	572	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Socio Liquidador		N	8	0	573	580	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	581	600	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Cámara de Compensación		N	8	0	601	608	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	609	628	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	629	642	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
50	Espacios en blanco		AN	96	0	643	738	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>

**DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios asignado al contrato. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Tipo de Operación		N	3	0	141	143	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
13	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	144	151	Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. <sup>1</sup>
14	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	152	171	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
15	Subyacente		AN	18	0	172	189	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0	190	191	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
17	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	192	194	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia		N	4	0	195	198	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
19	Fecha de operación		F	8	0	199	206	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
20	Fecha de inicio		F	8	0	207	214	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un

DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
21	Fecha de liquidación		F	8	0	215	222	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	223	230	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
23	Tamaño del contrato		N	14	2	231	246	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
24	Número de contratos		N	14	0	247	260	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
25	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	261	263	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Precio o Tasa pactada		N	14	7	264	284	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
27	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	285	290	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
28	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	291	291	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
29	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	292	295	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	296	302	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
31	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	303	308	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
32	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	309	317	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
33	Observaciones características especiales y		AN	150	0	318	467	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
34	Medio de Concertación		N	1	0	468	468	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
35	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	469	482	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una



DETALLE 2: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								cobertura. <sup>1</sup>
36	Socio Operador		N	8	0	483	490	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no exista el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
37	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	491	510	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". <sup>5</sup>
38	Socio Liquidador		N	8	0	511	518	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
39	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	519	538	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
40	Cámara de Compensación		N	8	0	539	546	Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
41	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	547	566	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
42	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	567	580	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
43	Espacios en blanco		AN	158	0	581	738	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "303"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>


DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. <sup>16</sup>
10	Unique Trade Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Se registrará el Identificador 1 o 7 según el caso, del Estatus de la operación (Catálogo Estatus de operación). Anexo <sup>1</sup>
12	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	141	148	En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
13	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	149	168	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
14	Tipo de opción		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>
15	Subclase de opción		N	3	0	172	174	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>
16	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	175	175	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
17	Subyacente		AN	18	0	176	193	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
18	Divisa de Liquidación		N	2	0	194	195	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta. <sup>1</sup>

**DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
19	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	196	198	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup>
20	Plazo de referencia		N	4	0	199	202	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
21	Fecha de la operación		F	8	0	203	210	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
22	Fecha de inicio		F	8	0	211	218	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
23	Fecha de Liquidación		F	8	0	219	226	Se deberá anotar la fecha en que se liquida o intercambia el flujo del contrato derivado. <sup>3</sup>
24	Fecha de Vencimiento		F	8	0	227	234	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
25	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	235	242	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3-</sup>
26	Tipo de operación		N	3	0	243	245	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación. <sup>1</sup>
27	Tamaño del contrato		N	14	2	246	261	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
28	Número de contratos		N	14	0	262	275	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
29	Divisa del tamaño del contrato o del monto notional		N	3	0	276	278	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
30	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	279	293	Se deberá anotar el strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
31	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	294	308	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>2</sup>
32	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	309	323	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>2</sup>
33	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	324	329	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas <sup>5</sup>
34	Prima Pactada		N	14	6	330	349	Se deberá anotar el monto de la prima en pesos, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
35	Contraparte		N	8	0	350	357	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC según el Catálogo Contrapartes. En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros <sup>1</sup>
36	Nombre corto de la		AN	20	0	358	377	Se deberá anotar el nombre corto de la

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)									
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones	
				Ent.	Dec.	De:	A:		
	contraparte							contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>	
37	Calificadora primera      Contraparte		N	3	0	378	380	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros <sup>1</sup>	
38	Calificación primera      contraparte		N	4	0	381	384	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>	
39	Calificadora segunda      Contraparte		N	3	0	385	387	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros <sup>1</sup>	
40	Calificación segunda      contraparte		N	4	0	388	391	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>	
41	Observaciones y características especiales		AN	150	0	392	541	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>	
42	Medio de Concertación		N	1	0	542	542	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>	
43	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	543	562	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>	
44	Delta de la opción		N	2	6	563	570	Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes <sup>2</sup>	
45	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	571	584	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero <sup>1</sup>	
46	Socio Operador		N	8	0	585	592	En caso de que la operación haya requerido un	

**DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
47	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	593	612	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
48	Socio Liquidador		N	8	0	613	620	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup> En otro caso reportar con ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
49	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	621	640	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
50	Cámara de Compensación		N	8	0	641	648	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación asociada según el catálogo de contrapartes. Si no existiera el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
51	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	649	668	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
52	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	669	682	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.

DETALLE 3: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TÍTULOS OPCIONALES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros <sup>1</sup>
53	Espacios en blanco		AN	56	0	683	738	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "304"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Swap Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Estatus de operación		N	3	0	138	140	Identificador 1 u 8 del Catálogo Estatus de operación. <sup>1</sup>
12	Fecha de operación		F	8	0	141	148	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
13	Tipo de Posición		N	1	0	149	149	En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación al contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2. Se deberá reportar 1 en otro caso. <sup>1</sup>
14	Fecha de inicio		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
15	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	158	160	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
16	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	161	163	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
17	Fecha de próxima liquidación a entregar		F	8	0	164	171	Se deberá anotar la fecha de entrega del próximo flujo a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>3</sup>
18	Fecha de próxima liquidación a recibir		F	8	0	172	179	Se deberá de anotar la fecha de recepción del próximo flujo a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la fecha del próximo flujo a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>3</sup>
19	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	180	183	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
20	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	184	187	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
21	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	188	190	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
22	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	191	193	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
23	Número de cupones a entregar		N	3	0	194	196	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
24	Número de cupones a recibir		N	3	0	197	199	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
25	Valor nocional		N	14	6	200	219	Se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
26	Valor nocional 2		N	14	6	220	239	Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir (pata larga)

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
27	Tipo de cambio pactado		N	12	6	240	257	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con nacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
28	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	258	263	En caso de que las divisas asociadas a los nacionales del swap sean distintas, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nacional a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nacional a recibir, según el catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nacional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nacional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado. En otro caso, se deberá registrar únicamente en las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos nacionales. <sup>5</sup>
29	Divisa del nacional a entregar		N	3	0	264	266	Se registrará el identificador de la divisa asociada al nacional a entregar conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nacional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
30	Divisa del nacional a recibir		N	3	0	267	269	Se registrará el identificador de la divisa asociada al nacional a recibir conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nacional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
31	Divisa de Liquidación		N	2	0	270	271	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que entregará/recibirá la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). <sup>1</sup>
32	Subyacente a entregar		AN	18	0	272	289	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
33	Subyacente a recibir		AN	18	0	290	307	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la



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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
34	Divisa del subyacente a entregar		AN	6	0	308	313	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
35	Divisa del subyacente a recibir		AN	6	0	314	319	Se registrará la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir conforme al catálogo de divisas.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
36	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	320	335	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
37	Tasa a recibir del siguiente cupón		N	10	6	336	351	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa conocida de la siguiente liquidación.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
38	Sobretasa a entregar		N	3	2	352	356	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
39	Sobretasa a recibir		N	3	2	357	361	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios.  Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>

DETALLE 4: CONTIENE LA INFORMACION DE OPERACIONES CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
40	Tipo tasa a entregar		N	3	0	362	364	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
41	Tipo tasa a recibir		N	3	0	365	367	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
42	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	368	377	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
43	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	378	387	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>5</sup>
44	Amortiza Capital		N	1	0	388	388	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
45	Tipo de intercambios		N	3	0	389	391	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
46	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	392	399	En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la Bolsa de Derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
47	Nombre Corto de Bolsa de Derivados		AN	20	0	400	419	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
48	Contraparte		N	8	0	420	427	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
49	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	428	447	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
50	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	448	450	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.



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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
51	Calificación primera      contraparte		N	4	0	451	454	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
52	Calificadora segunda      Contraparte		N	3	0	455	457	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
53	Calificación segunda      contraparte		N	4	0	458	461	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
54	Medio de Concertación		N	1	0	462	462	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
55	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	463	482	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
56	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	483	496	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
57	Observaciones características especiales y		AN	117	0	497	613	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
58	Socio Operador		N	8	0	614	621	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
59	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	622	641	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
60	Socio Liquidador		N	8	0	642	649	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
61	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	650	669	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
62	Cámara de Compensación		N	8	0	670	677	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
63	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	678	697	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
64	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	698	711	En caso de que la posición reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados, se deberá registrar un folio consecutivo para cada estrategia definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
65	Número de Contratos		N	13	0	712	724	Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos en posición, en valor absoluto. Se deberá reportar en ceros en otro caso. <sup>1</sup>
66	Espacios en blanco		AN	14	0	725	738	Vacíos. <sup>6</sup>

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





Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "305"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
3	Cusip o Cins		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	Sedol		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo Valor		AN	4	0	32	35	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	6	0	43	48	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	49	58	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
9	Bloomberg Ticker		AN	9	0	59	67	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
10	Unique Swap Identifier		AN	70	0	68	137	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
11	Tipo de Cupón		N	1	0	138	138	Se deberá anotar si se refiere a cupones a entregar = 1 y/o a cupones a recibir = 2. <sup>1</sup>
12	Numero de Cupón		N	3	0	139	141	Comenzando con el cupón vigente. <sup>1</sup>
13	Fecha Inicio		F	8	0	142	149	Se deberá anotar la fecha en que inicia el cupón. <sup>3</sup>
14	Fecha Final		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que vence el cupón. <sup>3</sup>
15	Días de cupón		N	3	0	158	160	Días de cupón. <sup>1</sup>
16	Monto de referencia para amortizar		N	14	6	161	180	Monto de referencia en caso de amortizar parte o completo el valor notional. <sup>2</sup>
17	Nocional		N	14	6	181	200	Se deberá anotar el monto del valor notional del cupón sobre el cual se pagarán los intereses. <sup>2</sup>
18	Subyacente		AN	18	0	201	218	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
19	Sobretasa		N	3	2	219	223	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar o recibir, se ocuparán todos los espacios. <sup>2</sup>
20	Observaciones Características Especiales <sup>o</sup>		AN	50	0	224	273	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
21	Fecha Inicial de Vigencia del cupón		F	8	0	274	281	Se deberá anotar la fecha a partir de la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha inicial del primer cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
22	Fecha Final de Vigencia del cupón		F	8	0	282	289	Se deberá anotar la fecha hasta la cual se considerará vigente la información del cupón. Corresponde a la fecha final del último cupón vigente del swap. <sup>3</sup>
23	Espacios en blanco		AN	449	0	290	738	Vacios. <sup>6</sup>

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

A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "306"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo Garantía		N	1	0	4	4	Se deberá anotar el identificador del tipo de la garantía conforme al catálogo Tipo de Garantía. <sup>1</sup>
3	Estatus de la Garantía		N	1	0	5	5	Se deberá anotar el identificador del "Estatus de la Garantía" conforme a lo siguiente: 1 si la Garantía está en tránsito (confirmada), 2 si la Garantía está en liquidada. 3 si la Garantía no fue entregada en la fecha de liquidación pactada. <sup>1</sup>
4	Fecha de Liquidación		F	8	0	6	13	Se deberá reportar la fecha de liquidación de la Garantía, cuando el "Estatus de la Garantía" sea reportado en "1" (en tránsito). En caso de que el "Estatus de la Garantía" sea reportado en "2" (liquidada), se deberá reportar 19000101. <sup>3</sup>
5	ISIN de la Garantía		AN	12	0	14	25	En caso de reportarse valores, se deberá anotar el ISIN proporcionado por el proveedor de precios. En otro caso se llenará con ceros. <sup>5</sup>
6	Cusip o Cins de la Garantía		AN	9	0	26	34	En caso de reportarse valores, se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. En otro caso se llenará con ceros. <sup>13</sup>
7	Sedol de la Garantía		AN	7	0	35	41	En caso de reportarse valores, se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionado por el proveedor de precios. En otro caso se llenará con ceros. <sup>14</sup>
8	Tipo de Valor de la Garantía		AN	4	0	42	45	Se deberá reportar la clave del tipo de valor otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar el tipo de valor asignado por el proveedor de precios al tipo de cambio correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EF". <sup>15</sup>
9	Emisora de la Garantía		AN	7	0	46	52	Se deberá reportar la clave de la emisora otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la emisora asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos se deberá anotar "EFECTIV". <sup>15</sup>
10	Serie de la Garantía		AN	7	0	53	59	Se deberá reportar la serie otorgada por el proveedor de precios. Para el caso de las garantías en efectivo denominadas en divisa se deberá utilizar la serie asignada por el proveedor de precios al tipo de cambio contra el peso correspondiente a la divisa de la garantía. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. <sup>15</sup>
11	Consecutivo de la Garantía		AN	10	0	60	69	Se deberá reportar en cero justificado a la izquierda. <sup>15</sup>
12	Contraparte de la Garantía		N	8	0	70	77	Identificador de la Contraparte en caso de que la garantía se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
13	Nombre corto de la contraparte de la garantía		AN	20	0	78	97	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. <sup>5</sup>

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

A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados.










Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
14	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	98	105	En el caso que las posiciones de derivados asociadas a la garantía se encuentren listadas en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de contrapartes o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar zeros <sup>1</sup>
15	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	106	125	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
16	Socio Liquidador		N	8	0	126	133	En caso de ser un derivado listado, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con zeros. <sup>1</sup>
17	Nombre Corto Socio liquidador		AN	20	0	134	153	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
18	Cámara de Compensación		N	8	0	154	161	En caso de que las posiciones de derivados asociadas a las garantías utilicen una Cámara de Compensación para su liquidación, se deberá reportar su identificador de acuerdo al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con zeros. <sup>1</sup>
19	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	162	181	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
20	Número de títulos		N	14	0	182	195	Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá anotar el número de títulos respecto de la garantía recibida o entregada. Para el caso de efectivo en divisas se deberá reportar el monto nominal de divisas entregadas o recibidas. Para el caso de garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos. <sup>1</sup>
21	Valor Unitario a Mercado		N	9	6	196	210	Para el caso de entrega o recepción de valores en garantía, se deberá reportar el valor a mercado unitario en pesos de acuerdo al proveedor de precios. Para el caso de las garantías entregadas o recibidas en divisas, se deberá anotar el tipo de cambio de la divisa contra el peso de acuerdo al proveedor de precios. Para el caso de las garantías en pesos se deberá reportar 1. <sup>2</sup>
22	Valor de mercado en pesos de la garantía		N	14	6	211	230	Para el caso de valores entregados o recibidos en garantía se deberá anotar el valor total a mercado de las garantías con respecto a los

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

A través de este detalle se reportará la información de garantías entregadas o recibidas por contraparte para el caso de derivados OTC y aportaciones iniciales mínimas en el caso de derivados listados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								precios del proveedor de precios a la fecha de envío. Para el caso de las garantías en efectivo en divisas, se deberá reportar el monto entregado o recibido en pesos actualizado con el tipo de cambio a la fecha de envío. Para el caso de las garantías en efectivo en pesos, se deberá reportar el monto en pesos entregado o recibido. <sup>1</sup>
23	Valor de mercado en divisa		N	14	6	231	250	Se deberá anotar la valuación de las garantías a valor de mercado en la divisa origen. <sup>1</sup>
24	Intereses Devengados		N	14	2	251	266	Importe de los Intereses devengados en pesos de las garantías a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
25	Divisa de la Garantía		N	2	0	267	268	Se registrará el identificador de la divisa conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Traslado de dominio (Prenda Bursátil)		N	2	0	269	270	Se reportará 01 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes nacionales (prenda bursátil) y 02 si la garantía reportada cuenta con traslado de dominio con contrapartes internacionales (CSA). Se reportará 00 en otro caso. <sup>1</sup>
27	Factor de Aforo		N	3	4	271	277	Se deberá reportar el valor residual después de aplicar el "haircut" o dato de descuento. Ejemplo: En caso de que se determine un "haircut" o dato de descuento de 10%, se deberá reportar 0.9 <sup>1</sup>
28	Número de contrato		AN	30	0	278	307	Se deberá reportar el número de contrato marco al amparo del cuál fue entregada o recibida la garantía. <sup>5</sup>
29	Espacios en blanco		AN	431	0	308	738	Vacíos. <sup>6</sup>

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


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "307"</b> . <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>












DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Tipo de Operación		N	3	0	142	144	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1 - Largo 2 - Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
14	Subyacente		AN	18	0	145	162	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
15	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	163	165	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup>
16	Divisa de Liquidación		N	2	0	166	167	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta <sup>1</sup> .
17	Plazo de referencia		N	4	0	168	171	En caso de que el Forward sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
18	Fecha de operación		F	8	0	172	179	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
19	Fecha de inicio		F	8	0	180	187	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
20	Fecha de Vencimiento		F	8	0	188	195	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
21	Tamaño del contrato		N	14	2	196	211	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
22	Número de contratos		N	14	0	212	225	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
23	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	226	228	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
24	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	229	249	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
25	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	250	270	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros <sup>2</sup>
26	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	271	286	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición (se reportará la utilidad

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
27	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	287	292	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
28	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	293	293	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega.
29	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	294	297	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
30	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	298	304	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
31	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	305	310	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según el Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
32	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	311	319	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
33	Medio de Concertación		N	1	0	320	320	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
34	Contraparte		N	8	0	321	328	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que el forward se opere en el mercado OTC, según el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
35	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	329	348	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
36	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	349	351	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadoradora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
37	Calificación contraparte primera		N	4	0	352	355	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
38	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	356	358	Se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadoradora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
39	Calificación contraparte segunda		N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadoradora distinta a la reportada


DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								en el concepto "Calificadora Contraparte primera". <sup>1</sup>
40	Observaciones y características especiales		AN	150	0	363	512	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
41	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	513	532	Corresponde al Identificador definitivo proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
42	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	533	546	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. <sup>1</sup>
43	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	547	554	En caso de que la operación haya sido realizada en bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
44	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	555	574	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Socio Operador		N	8	0	575	582	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	583	602	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Socio Liquidador		N	8	0	603	610	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	611	630	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Cámara de Compensación		N	8	0	631	638	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de

DETALLE 7: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FORWARDS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
50	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	639	658	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
51	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	659	672	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
52	Espacios en blanco		AN	66	0	673	738	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "308"</b> . <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. <sup>17</sup>

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Tipo de Operación		N	3	0	142	144	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
14	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	145	152	Se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. <sup>1</sup>
15	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	153	172	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
16	Subyacente		AN	18	0	173	190	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>
17	Divisa de Liquidación		N	2	0	191	192	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará la operación según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
18	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	193	195	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>1</sup>
19	Plazo de referencia		N	4	0	196	199	En caso de que el Futuro sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
20	Fecha de operación		F	8	0	200	207	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
21	Fecha de inicio		F	8	0	208	215	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
22	Fecha de Vencimiento		F	8	0	216	223	Se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, que es, la fecha en que desaparece la operación en el layout. <sup>3</sup>
23	Tamaño del contrato		N	14	2	224	239	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
24	Número de contratos		N	14	0	240	253	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
25	Divisa del tamaño del contrato		N	3	0	254	256	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
26	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	257	277	Se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
27	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	278	298	En caso de cierre se deberá anotar el precio, tasa o nivel al cual se cerró la posición con

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
28	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	299	314	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
29	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	315	320	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas. <sup>5</sup>
30	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	321	321	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>
31	Tipo de Valor del subyacente Cheapest to Deliver		AN	4	0	322	325	Clave del Tipo de Valor del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
32	Emisora del subyacente Cheapest to Deliver		AN	7	0	326	332	Clave de la Emisora del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
33	Serie del subyacente Cheapest to Deliver		AN	6	0	333	338	Clave de la serie del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre bonos según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. En otro caso reportar espacios en blanco. <sup>5</sup>
34	Precio de Cheapest to Deliver		N	3	6	339	347	Precio Limpio del Cheapest to Deliver en caso de derivados sobre Bonos. <sup>2</sup>
35	Observaciones características especiales y		AN	150	0	348	497	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
36	Medio de Concertación		N	1	0	498	498	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
37	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	499	518	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
38	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	519	532	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
39	Socio Operador		N	8	0	533	540	Se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de

DETALLE 8: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (FUTUROS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
40	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	541	560	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". <sup>5</sup>
41	Socio Liquidador		N	8	0	561	568	Se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
42	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	569	588	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
43	Cámara de Compensación		N	8	0	589	596	Se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación del contrato según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
44	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	597	616	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
45	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	617	630	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. <sup>1</sup>
46	Espacios en blanco		AN	108	0	631	738	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TITULOS OPCIONALES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "309". <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición larga o corta se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TITULOS OPCIONALES)									
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones	
				Ent.	Dec.	De:	A:		
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>	
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>	
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>	
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>	
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>15</sup>	
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>	
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>	
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. <sup>16</sup>	
11	Unique Trade Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Trade Identifier" de la operación. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. <sup>17</sup>	
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>	
13	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	142	149	En caso de que la posición se encuentre listada en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En otro caso reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar cero. <sup>1</sup>	
14	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	150	169	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la bolsa de derivados en caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados" En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>	
15	Tipo de opción		N	3	0	170	172	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de opción. <sup>1</sup>	
16	Subclase de opción		N	3	0	173	175	Se deberá anotar la subclase de opción con respecto al catálogo de subclase de opción. <sup>1</sup>	
17	Entrega física o diferenciales		AN	1	0	176	176	"F" cuando la liquidación a vencimiento del contrato sea por entrega física y "D" cuando sea por diferenciales, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entrega. <sup>5</sup>	
18	Subyacente		AN	18	0	177	194	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente del derivado reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. <sup>5</sup>	



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


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
19	Divisa de Liquidación		N	2	0	195	196	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación al vencimiento de la operación conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio con liquidación en físico (compra-venta de divisas) se deberá registrar la divisa que será entregada por la SIEFORE, es decir, la divisa a la que se tiene una exposición corta <sup>1</sup> .
20	Divisa de cotización del subyacente		N	3	0	197	199	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de cotización del Subyacente del contrato conforme al catálogo de divisas. Para el caso de las operaciones de tipo de cambio, se deberá reportar la divisa que sería recibida asumiendo una posición larga en el contrato <sup>1</sup> .
21	Plazo de referencia		N	4	0	200	203	En caso de que la opción sea de tasa de interés o bonos, se deberá anotar el plazo sobre el cual hace referencia la tasa pactada o el plazo cupón estándar de un bono. En otro caso reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
22	Fecha de la operación		F	8	0	204	211	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
23	Fecha de inicio		F	8	0	212	219	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
24	Fecha de Vencimiento		F	8	0	220	227	Se deberá anotar la fecha en que vence la opción o fecha de expiración, que es, la fecha en que desaparece la operación del layout. <sup>3</sup>
25	Fecha de ejercicio vigente		F	8	0	228	235	Se deberá anotar la fecha de ejercicio próxima vigente, cabe señalar que en caso de opciones americanas esta se actualizará diariamente. <sup>3-</sup>
26	Tipo de operación		N	3	0	236	238	Se deberá anotar el identificador de acuerdo al catálogo de Tipos de Operación: 1-Largo 2-Corto Deberá guardar consistencia con lo reportado en el Detalle 1 del presente formato de transmisión a la fecha de información del día hábil anterior en el concepto "Tipo de Operación" de la posición. <sup>1</sup>
27	Tamaño del contrato		N	14	2	239	254	Se deberá anotar el tamaño del contrato pactado en valor absoluto en la divisa pactada. <sup>2</sup>
28	Número de contratos		N	14	0	255	268	Se deberá anotar el número de contratos pactados en valor absoluto. <sup>1</sup>
29	Divisa del tamaño del contrato o del monto nominal		N	2	0	269	270	Se registrará el identificador de la divisa asociada al tamaño del contrato conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
30	Precio o Tasa pactada de apertura		N	14	7	271	291	Se deberá anotar el strike al cual se pactó inicialmente en la operación con puntos forwards integrados en su caso. <sup>2</sup>
31	Precio o Tasa pactada al cierre de la posición		N	14	7	292	312	En caso de cierre se deberá anotar el strike al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros <sup>2</sup>
32	Monto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	313	328	Se deberá anotar el monto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
33	Precio o tasa de ejercicio vigente		N	9	6	329	343	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. <sup>2</sup>
34	Precio o tasa de ejercicio Cap		N	9	6	344	358	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien

DETALLE 9: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (OPCIONES/TITULOS OPCIONALES)								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								subyacente. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>2</sup>
35	Precio o tasa de ejercicio Floor		N	9	6	359	373	Se deberá anotar el precio, tasa o strike al cual se pactó la compra o la venta del bien subyacente. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>2</sup>
36	Estructura de las divisas del precio o tasa pactada		AN	6	0	374	379	Para derivados de tipo de cambio, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar del contrato asumiendo una posición larga y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir del contrato asumiendo una posición larga conforme al catálogo de divisas independientemente del tipo de operación del derivado. En caso contrario, solo se registrará en las 3 primeras posiciones la clave de la divisa de cotización del subyacente conforme al catálogo de divisas <sup>5</sup>
37	Prima Pactada		N	14	6	380	399	Se deberá anotar el monto en pesos de la prima, importe que se paga o que se cobra por tener derecho de ejercer o no las condiciones establecidas en el contrato. <sup>2</sup>
38	Contraparte		N	8	0	400	407	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se haya concertado la operación en caso de que la opción se opere en el mercado OTC, para lo cual la clave de bolsa de derivados deberá ir en ceros y este campo con la contraparte según el Catálogo Contrapartes. En caso de ser una operación realizada en bolsa de derivados reportar ceros. <sup>1</sup>
39	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	408	427	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte siempre y cuando no exista la contraparte en el catálogo limitándose a 20 caracteres que describan el nombre. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
40	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	428	430	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
41	Calificación contraparte primera		N	4	0	431	434	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
42	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	435	437	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
43	Calificación contraparte segunda		N	4	0	438	441	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera"








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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
44	Observaciones características especiales y		AN	150	0	442	591	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
45	Medio de Concertación		N	1	0	592	592	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
46	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	593	612	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
47	Delta de la opción		N	2	6	613	620	Delta calculada por la administradora utilizando los modelos internos de valuación independiente que prevén las Disposiciones de carácter generar en materia financiera vigentes <sup>2</sup>
48	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	621	634	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar un cero. <sup>1</sup>
49	Socio Operador		N	8	0	635	642	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador de la entidad a través de la cual se realizó la concertación de la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
50	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	643	662	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
51	Socio Liquidador		N	8	0	663	670	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
52	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	671	690	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
53	Cámara de Compensación		N	8	0	691	698	En caso de ser un derivado listado o una operación OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
54	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	699	718	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
55	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	719	732	En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión. Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados. En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio. En ningún caso se podrá reutilizar el folio. Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados. En el caso de Títulos Opcionales se deberá reportar ceros. <sup>1</sup>
56	Espacios en Blanco		AN	6	0	733	738	Vacíos. <sup>6</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "310"</b> . <sup>1</sup>
2	Aperturas y Cierres		N	1	0	4	4	Identificador según el Catálogo de Aperturas y Cierres. Cuando se incremente la posición se deberá reportar alta; cuando ésta se disminuya se deberá reportar baja. <sup>5</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
4	Cusip o Cins		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar el CUSIP o el CINS proporcionado por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
5	Sedol		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
6	Tipo Valor		AN	4	0	33	36	Clave del Tipo de Valor del instrumento derivado según Catálogo que proporcione el proveedor de precios. <sup>5</sup>
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Clave de la Emisora del Instrumento derivado según catálogo que proporcione el proveedor

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								de precios. <sup>5</sup>
8	Serie		AN	6	0	44	49	Fecha de vencimiento del contrato derivado en formato aammdd o serie específica en caso de que cotice en un mercado organizado. <sup>15</sup>
9	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Indicador consecutivo del instrumento de acuerdo al asignado por el proveedor de precios. <sup>15</sup>
10	Bloomberg Ticker		AN	9	0	60	68	Se deberá anotar el ticker que Bloomberg asigna al contrato. <sup>16</sup>
11	Unique Swap Identifier		AN	70	0	69	138	Se deberá anotar la clave "Unique Swap Identifier" de la operación. <sup>17</sup>
12	Estatus de operación		N	3	0	139	141	Se registrará el Identificador 1 de manera constante. <sup>1</sup>
13	Fecha de operación		F	8	0	142	149	Se deberá anotar la fecha en que se pacta la operación. <sup>3</sup>
14	Fecha de inicio		F	8	0	150	157	Se deberá anotar la fecha en que inicia la operación pactada ya sea que se pacte un instrumento derivado con fecha valor o no. <sup>3</sup>
15	Tipo de Posición		N	1	0	158	158	En caso de tratarse de una operación de Swap listada en una bolsa de derivados y operaciones que liquiden en contrapartes centrales, y en la cual, la posición en relación contrato estandarizado sea corta, se deberá reportar 2. Se deberá reportar 1 en otro caso. <sup>1</sup>
16	Número de cupón vigente a entregar		N	3	0	159	161	Se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
17	Número de cupón vigente a recibir		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el número de cupón vigente a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
18	Plazo de referencia a entregar		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el plazo del cupón a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
19	Plazo de referencia a recibir		N	4	0	169	172	Se deberá anotar el plazo del cupón a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el plazo del cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
20	Días para fijar tasa a entregar		N	3	0	173	175	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
21	Días para fijar tasa a recibir		N	3	0	176	178	Días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente cupón a recibir, este campo debe ser con signo y dos cifras. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los días hábiles antes o después del corte de cupón para resetear la tasa de interés variable del siguiente

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								cupón a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
22	Número de cupones a entregar		N	3	0	179	181	Se deberá anotar el número de cupones totales a entregar desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
23	Número de cupones a recibir		N	3	0	182	184	Se deberá anotar el número de cupones totales a recibir desde el inicio de la operación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el número de cupones totales a recibir (pata larga) desde el inicio de la operación asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
24	Valor nocional		N	14	6	185	204	Se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (referencia de pata a entregar). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
25	Valor nocional 2		N	14	6	205	224	Se deberá anotar el monto del valor nocional de la divisa a recibir (referencia de pata a recibir). Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el monto del valor nocional en la divisa a recibir asumiendo una posición larga en el contrato. <sup>2</sup>
26	Tipo de cambio pactado		N	12	6	225	242	Se deberá anotar en su caso, el tipo de cambio pactado para swaps con notacionales en distinta divisa. <sup>2</sup>
27	Estructura de las Divisas del Tipo de Cambio pactado		AN	6	0	243	248	Si es que se pactó un tipo de cambio de referencia para notacionales, se registrará en las tres primeras posiciones la clave de la divisa a entregar y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa a recibir según el catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales de swaps con divisas asociadas distintas, se deberán anotar en las tres primeras posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado y en las siguientes 3 posiciones la clave de la divisa asociada al nocional a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo siempre una posición larga en el contrato estandarizado. En otro caso se deberá registrar las tres primeras posiciones de la divisa asociada a ambos notacionales. <sup>5</sup>
28	Divisa del nocional a entregar		N	2	0	249	250	Se registrará el identificador de la divisa del nocional a entregar conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de la divisa asociada al nocional a entregar (pata corta) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
29	Divisa del nocional a recibir		N	2	0	251	252	Se registrará el identificador de la divisa del nocional a recibir conforme al catálogo de Divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar el identificador de


DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								la divisa asociada al notional a recibir (pata larga) asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
30	Divisa de Liquidación		N	2	0	253	254	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de liquidación asociada a los flujos que recibirá/entregará la SIEFORE (para las patas denominadas en UDI, se deberá reportar Pesos). <sup>1</sup>
31	Subyacente a entregar		AN	18	0	255	272	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a entregar del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a entregar (pata corta) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
32	Subyacente a recibir		AN	18	0	273	290	Se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie otorgado por el proveedor de precios al subyacente a recibir del swap reportado. Se deberá respetar el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En el caso de no utilizar completamente los caracteres mencionados se dejarán los espacios en blanco. Cabe mencionar que para el caso de Derivados sobre Vehículos que repliquen índices o Mercancías, se deberá capturar el tipo valor, emisora y serie correspondiente al Vehículo. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá seguir la especificación anterior para el subyacente a recibir (pata larga) en el contrato estandarizado asumiendo una posición larga en el mismo. <sup>5</sup>
33	Divisa del subyacente a entregar		AN	3	0	291	293	Se registrará la clave de la divisa a entregar conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a entregar (pata corta) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
34	Divisa del subyacente a recibir		AN	3	0	294	296	Se registrará la clave de la divisa a recibir conforme al catálogo de divisas. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la clave de la divisa de cotización del subyacente a recibir (pata larga) conforme al catálogo de divisas, asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
35	Tasa a entregar del siguiente cupón		N	10	6	297	312	Se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a entregar, o tasa conocida de la siguiente liquidación entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
36	Tasa a recibir del siguiente		N	10	6	313	328	Se deberá anotar la tasa fija a recibir, o tasa

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
	cupón							conocida de la siguiente liquidación. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la tasa fija a recibir, o la tasa conocida de la siguiente liquidación recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
37	Sobretasa a entregar		N	3	2	329	333	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
38	Sobretasa a recibir		N	3	2	334	338	Se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir, se utilizarán todos los espacios. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberán anotar los puntos porcentuales con signo más o menos de la tasa de referencia a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>2</sup>
39	Tipo tasa a entregar		N	3	0	339	341	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a entregar conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
40	Tipo tasa a recibir		N	3	0	342	344	Se registrará el identificador del Tipo de Tasa a recibir conforme al catálogo de Tipos de Tasa. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar el identificador del Tipo de Tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>1</sup>
41	Base de cálculo de la tasa a entregar		AN	10	0	345	354	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a entregar. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a entregar (pata corta), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
42	Base de cálculo de la tasa a recibir		AN	10	0	355	364	Se deberá anotar la composición de la tasa "Act/Act", "Act/365", "Act/360" o cualquier otra que aplique a la tasa a recibir. Para el caso de operaciones listadas y operaciones que liquiden con contrapartes centrales, se deberá anotar la composición de la tasa a recibir (pata larga), asumiendo una posición larga en el contrato estandarizado. <sup>5</sup>
43	Amortiza Capital		N	1	0	365	365	Se registrará el identificador del catálogo de Tipo de Amortizaciones. <sup>1</sup>
44	Tipo de intercambios		N	3	0	366	368	Se registrará el identificador correspondiente, según el catálogo de Tipo de intercambios. <sup>1</sup>
45	Clave de Bolsa de Derivados		N	8	0	369	376	En caso de que la posición sea un swap listado en una bolsa de derivados, se deberá anotar el identificador de la bolsa de derivados conforme al catálogo de Contrapartes, o el identificador "Otras Bolsas de Derivados" contenido en el catálogo de Contrapartes cuando no exista identificador para la bolsa de derivados. En caso de operaciones OTC, incluso aquellas que liquiden en contrapartes centrales, se







DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								deberán reportar ceros. <sup>1</sup>
46	Nombre Corto Bolsa de Derivados		AN	20	0	377	396	En caso de reportarse el identificador "Otras Bolsas de Derivados" en el campo "Clave de Bolsa de Derivados", se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la bolsa de derivados. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
47	Contraparte		N	8	0	397	404	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte con la que se cierra la operación en caso de que el swap sea una operación OTC, incluso si liquida en contrapartes centrales, de acuerdo con el Catálogo Contrapartes. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
48	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	405	424	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres en caso de que no exista la contraparte en el catálogo de contrapartes. En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
49	Calificadora primera Contraparte		N	3	0	425	427	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
50	Calificación primera contraparte		N	4	0	428	431	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación crediticia mínima de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro reportar ceros. <sup>1</sup>
51	Calificadora segunda Contraparte		N	3	0	432	434	En caso de que la operación se haya concertado en el mercado OTC, se registrará el identificador correspondiente a la agencia calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
52	Calificación segunda contraparte		N	4	0	435	438	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte en el caso de derivados concertados en el mercado OTC conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima otorgada por una agencia calificadora distinta a la reportada en el concepto "Calificadora Contraparte primera" En otro caso reportar ceros. <sup>1</sup>
53	Medio de Concertación		N	1	0	439	439	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 1 = Telefónico 2 = Electrónico. <sup>1</sup>
54	Número de confirmación de la operación con la contraparte		AN	20	0	440	459	Corresponde al Identificador proporcionado por la contraparte para fines de confirmar la operación. <sup>5</sup>
55	Folio para cobertura de divisas		N	14	0	460	473	En caso de formar parte de una estructura de cobertura donde sus divisas no tienen permitido tomar posiciones puras o direccionales se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE. Este folio será idéntico en todos los instrumentos que forman parte de la cobertura. En caso de disminuir o aumentar la posición en los instrumentos de la estructura se deberá renovar el folio de cobertura para todos los instrumentos asociados a la misma. No se

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								podrán reutilizar los folios en ningún caso. La cobertura deberá ser total de manera obligatoria. Indicar cero si no corresponde a una cobertura. <sup>1</sup>
56	Observaciones características especiales y		AN	117	0	474	590	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las condiciones pactadas que no estén especificadas en el formato e intervengan en la valuación de un instrumento derivado. <sup>5</sup>
57	Socio Operador		N	8	0	591	598	En caso de que la operación haya requerido un socio operador para ser realizada, se deberá reportar el identificador del socio operador que participó en la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Operadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En caso de que la operación no haya requerido un socio operador para ser realizada, reportar ceros. <sup>1</sup>
58	Nombre Corto Socio Operador		AN	20	0	599	618	Se deberá anotar el nombre corto, limitado a 20 caracteres, de la entidad a través de la cual se concertó la operación en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Operadores" en el campo "Socio Operador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
59	Socio Liquidador		N	8	0	619	626	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la entidad liquidadora utilizada para la operación conforme al catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para dicha entidad, se deberá reportar el identificador "Otros Socios Liquidadores" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
60	Nombre Corto Socio Liquidador		AN	20	0	627	646	Se deberá anotar el nombre corto limitado a 20 caracteres de la entidad a través de la cual se liquida la posición en caso de reportarse el identificador "Otros Socios Liquidadores" en el campo "Socio Liquidador". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
61	Cámara de Compensación		N	8	0	647	654	En caso de ser un derivado listado o una operación de swap OTC que liquide en contrapartes centrales, se deberá reportar el identificador de la Cámara de Compensación de la operación según el catálogo de contrapartes. Si no existe el identificador para esa Cámara de Compensación, se deberá reportar el identificador "Otras Cámaras de Compensación" contenido en el catálogo de Contrapartes. En otro caso reportar con ceros. <sup>1</sup>
62	Nombre Corto Cámara de Compensación		AN	20	0	655	674	Se deberá anotar el nombre corto de la Cámara de Compensación limitado a 20 caracteres en caso de reportarse el identificador "Otras Cámaras de Compensación" en el campo "Cámara de Compensación". En otro caso reportar vacío. <sup>5</sup>
63	Precio o Tasa Neta pactada al cierre de la posición		N	14	7	675	695	En caso de cierre se deberá anotar el precio o tasa neta al cual se cerró la posición con puntos forwards integrados. Para el caso de una apertura se llenará con ceros. <sup>2</sup>
64	Monto Neto liquidado al cierre de la posición		N	14	2	696	711	Se deberá anotar el monto neto liquidado en pesos, al cierre de la posición, (se reportará la utilidad o pérdida del día para derivados listados y la acumulada para derivados OTC

DETALLE 10: CONTIENE LA INFORMACION DE ALTAS Y BAJAS CON INSTRUMENTOS DERIVADOS (SWAPS).								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								con el signo correspondiente). <sup>2</sup>
65	Folio para estrategia con derivados		N	14	0	712	725	<p>En caso de que la operación reportada forme parte de una estrategia de inversión que involucre derivados se deberá registrar un folio consecutivo, para cada estrategia, definido por la SIEFORE. Este folio será el mismo para todos los instrumentos que forman parte de dicha estrategia de inversión.</p> <p>Se entenderá por estrategia de inversión a un conjunto de derivados que busquen un objetivo de rentabilidad conjunta a través del posicionamiento sobre subyacentes, a través de la cobertura de los mismos, o a través de la réplica de comportamiento de otro instrumento derivado como es el caso de los engrapados.</p> <p>En caso de modificar la estrategia (disminuir / aumentar la posición, o incorporar nuevos instrumentos a la estrategia) se deberá generar un nuevo folio.</p> <p>En ningún caso se podrá reutilizar el folio.</p> <p>Indicar ceros si no corresponde a una estrategia con derivados.<sup>1</sup></p>
66	Número de Contratos		N	13	0	726	738	Para el caso de swaps listados o swaps OTC que liquiden en contrapartes centrales, se deberá reportar el número de contratos operados, en valor absoluto. <sup>1</sup>

**DETALLE 11: CONTIENE LA INFORMACION VIGENTE DE LAS LÍNEAS OPERATIVAS O IMPORTE MÍNIMO DE TRANSFERENCIA (THRESHOLDS O MINIMUM TRANSFER AMOUNT) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION), LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX) ASÍ COMO LOS CONTRATOS QUE CUENTAN CON PRENDA BURSÁTIL.**

A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro y contratos que cuenten con prenda bursátil. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "311"</b> . <sup>1</sup>
2	Contraparte		N	8	0	4	11	Se deberá reportar el identificador de la Contraparte según el Catálogo Contrapartes. <sup>1</sup>
3	Nombre Corto contraparte		AN	20	0	12	31	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte del contrato limitado a 20 caracteres en caso de no existir identificador para la misma en el catálogo de contrapartes y que, en su caso, deberá coincidir con el nombre reportado en los detalles 1 a 4. <sup>5</sup>
4	Id Contrato		N	2	0	32	33	Se deberá registrar un número consecutivo definido por la SIEFORE para cada contrato ISDA reportado para cada contraparte, en el presente detalle. No se podrán reutilizar los identificadores para la misma contraparte en ningún caso. <sup>1</sup>
5	Tipo de Neteo		N	1	0	34	34	Se deberá anotar el tipo de neteo de derivados establecido en los contratos ISDA o ISDAMEX para el cómputo de consumo de las líneas operativas (threshold o minimum transfer amount) según el catálogo de "Tipo de Neteo". <sup>1</sup>
6	Threshold establecido por la Contraparte		N	9	0	35	43	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como línea operativa o margen operativo para la SIEFORE. <sup>1</sup>
7	Divisa del Threshold establecido por la Contraparte		N	2	0	44	45	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
8	Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte		N	9	0	46	54	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como importe mínimo de transferencia para la

**DETALLE 11:** CONTIENE LA INFORMACION VIGENTE DE LAS LÍNEAS OPERATIVAS O IMPORTE MÍNIMO DE TRANSFERENCIA (THRESHOLDS O MINIMUM TRANSFER AMOUNT) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION), LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX) ASÍ COMO LOS CONTRATOS QUE CUENTAN CON PRENDA BURSÁTIL.

A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro y contratos que cuenten con prenda bursátil. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								SIEFORE. <sup>1</sup>
9	Divisa del Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte		N	2	0	55	56	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
10	Threshold establecido por la SIEFORE		N	9	0	57	65	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como línea operativa o margen operativo para la contraparte. <sup>1</sup>
11	Divisa del Threshold establecido por la SIEFORE		N	2	0	66	67	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Threshold establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
12	Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la SIEFORE		N	9	0	68	76	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como importe mínimo de transferencia para la contraparte. <sup>1</sup>
13	Divisa del Minimum Transfer Amount (MTA) establecido por la SIEFORE		N	2	0	77	78	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Minimum Transfer Amount establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
14	Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte		N	9	0	79	87	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la contraparte como monto independiente. <sup>1</sup>
15	Divisa del Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte		N	2	0	88	89	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la Contraparte" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
16	Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE		N	9	0	90	98	Se deberá anotar el monto denominado en divisa, establecido por la SIEFORE como monto independiente. <sup>1</sup>
17	Divisa del Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE		N	2	0	99	100	Se reportará el identificador de la divisa asociada al monto reportado en el campo "Monto Independiente o Margen Inicial establecido por la SIEFORE" conforme al catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
18	Manejo de Garantías		N	1	0	101	101	Se deberá registrar 1 si el contrato ISDA prevé manejo de garantías con instrumentos financieros. De lo contrario se deberá reportar cero. <sup>1</sup>
19	Liquidación en Pesos		N	1	0	102	102	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en pesos. En otro caso reportar 0.
20	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo I de divisas		N	1	0	103	103	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo I de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. <sup>1</sup>
21	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo II de divisas		N	1	0	104	104	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo II de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. <sup>1</sup>

**DETALLE 11:** CONTIENE LA INFORMACION VIGENTE DE LAS LÍNEAS OPERATIVAS O IMPORTE MÍNIMO DE TRANSFERENCIA (THRESHOLDS O MINIMUM TRANSFER AMOUNT) Y CARACTERÍSTICAS DE OPERACIÓN DE DERIVADOS ESTABLECIDAS CON LAS CONTRAPARTES EN LOS CONTRATOS ISDA (INTERNATIONAL SWAP DEALERS ASSOCIATION), LOS CSA (CREDIT SUPPORT ANNEX) ASÍ COMO LOS CONTRATOS QUE CUENTAN CON PRENDA BURSÁTIL.

A través de este detalle se reportará la información relevante sobre las características operativas de contratos ISDA e ISDAMEX y en su caso CSA de las Sociedades de Inversión Especializadas en Fondos para el Retiro y contratos que cuenten con prenda bursátil. Se deberá reportar la información antes descrita para todos los contratos de la Sociedad de Inversión Especializada en Fondos para el Retiro.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
22	Liquidación de Threshold en divisas del Grupo III de divisas		N	1	0	105	105	Se deberá reportar 1 en caso de que la liquidación de las posiciones que computen un exceso con el saldo acreedor/deudor a las líneas operativas o Thresholds se pueda realizar en alguna de las divisas definidas en el Grupo III de divisas autorizadas por el CAR. En otro caso reportar 0. <sup>1</sup>
23	Número de contrato		AN	30	0	106	135	Se deberá reportar el número de contrato marco.
24	Observaciones		AN	603	0	136	738	En caso de reportar el identificador "Otro" en el campo "Tipo de Neteo", se deberán reportar características especiales relacionadas con la forma en la que se netean las posiciones para el cómputo de consumos de las líneas operativas establecidas en los contratos de derivados. <sup>6</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	CITIBANAMEX
556	AZTECA
562	INVERCAP
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	000090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	538	000090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	000090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	000090	Siefore Básica de Pensiones	Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	568	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	000090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001000	Siefore Inicial	Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	534	001000	Siefore Inicial	Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE.
002	538	001000	Siefore Inicial	Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	544	001000	Siefore Inicial	Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	550	001000	Siefore Inicial	Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	552	001000	Siefore Inicial	Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	556	001000	Siefore Inicial	Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	562	001000	Siefore Inicial	Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	568	001000	Siefore Inicial	Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	578	001000	Siefore Inicial	Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	530	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	534	001955	Siefore Básica 55-59	Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001955	Siefore Básica 55-59	Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	544	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	550	001955	Siefore Básica 55-59	Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	552	001955	Siefore Básica 55-59	Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	556	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	562	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	568	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V.
002	578	001955	Siefore Básica 55-59	Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	530	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	534	001960	Siefore Básica 60-64	Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001960	Siefore Básica 60-64	Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	544	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	550	001960	Siefore Básica 60-64	Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	552	001960	Siefore Básica 60-64	Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	556	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	562	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	568	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V.
002	578	001960	Siefore Básica 60-64	Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	530	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	534	001965	Siefore Básica 65-69	Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001965	Siefore Básica 65-69	Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	544	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	550	001965	Siefore Básica 65-69	Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	552	001965	Siefore Básica 65-69	Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	556	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	562	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	568	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V.
002	578	001965	Siefore Básica 65-69	Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	530	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	534	001970	Siefore Básica 70-74	Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001970	Siefore Básica 70-74	Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	544	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	550	001970	Siefore Básica 70-74	Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	552	001970	Siefore Básica 70-74	Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	556	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	562	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	568	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V.
002	578	001970	Siefore Básica 70-74	Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	534	001975	Siefore Básica 75-79	Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001975	Siefore Básica 75-79	Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	544	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	550	001975	Siefore Básica 75-79	Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	552	001975	Siefore Básica 75-79	Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	556	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	562	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	568	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V.
002	578	001975	Siefore Básica 75-79	Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	530	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	534	001980	Siefore Básica 80-84	Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001980	Siefore Básica 80-84	Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	544	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	550	001980	Siefore Básica 80-84	Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	552	001980	Siefore Básica 80-84	Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	556	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	562	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	568	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V.
002	578	001980	Siefore Básica 80-84	Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	530	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	534	001985	Siefore Básica 85-89	Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001985	Siefore Básica 85-89	Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	544	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	550	001985	Siefore Básica 85-89	Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	552	001985	Siefore Básica 85-89	Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	556	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	562	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	568	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V.
002	578	001985	Siefore Básica 85-89	Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	530	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	534	001990	Siefore Básica 90-94	Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001990	Siefore Básica 90-94	Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	544	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	550	001990	Siefore Básica 90-94	Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	552	001990	Siefore Básica 90-94	Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	556	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	562	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	568	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V.
002	578	001990	Siefore Básica 90-94	Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
003	334	000001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
004	430	000001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	000007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	000009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	000010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
017	644	000003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

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

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

Catálogo de Estatus de Operación	
Identificador	Descripción
1	Posición Abierta.
7	Se ejerce la opción (Este estatus se empleará únicamente en la fecha de

Catálogo de Tipos de Tasa		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Tasa Fija	TF
2	Tasa Variable al Inicio del Cupón	TVI
3	Tasa Variable al Final del Cupón	TVF



	ejercicio de la opción)			
8	Se utiliza el layout de detalle (Estatus para indicar que el instrumento cuenta con un calendario de cupones). En las fechas que no exista detalle, a reportar, de cupones se empleará el Estatus de Operación 1	4	Tasa Variable Promedio	TVP
		5	Tasa Capitalizable Simple	TCS
		6	Tasa Capitalizable Compuesta	TCC
		100	Otros	OTR

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

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

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

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

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

Catálogo de Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH IBCA
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003

A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			<b>HR D</b>			<b>1056</b>
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045
CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048
D	D	D	HR D (G)		D	1049
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Global</b>						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055

<b>Catálogo de Tipo de Garantía</b>	
<b>Identificador</b>	<b>Descripción</b>
1	<b>Garantía otorgada por la SIEFORE</b> en operaciones con Instrumentos Financieros Derivados.

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
2001	Banco de México	82035	Confía Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	82037	Cremi Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13004	Casa de Bolsa Santander Serfín	82039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	82042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
13006	HSBC Casa de Bolsa	82043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
13007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	82044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
13010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	82048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
13011	Multivalores Casa de Bolsa	82049	Bancomer Sucursal en Houston
13012	Finamex Casa de Bolsa	82050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
13013	IXE Casa de Bolsa	82051	Casa de Bolsa Ve por Más
13015	Interacciones Casa de Bolsa	700000	Otros Bancos Extranjeros
13018	Casa de Bolsa Arka	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
13019	Value Casa de Bolsa	701001	Abasis
13020	Actinver Casa de Bolsa	701002	American Express (Extranjero)
13021	Monex Casa de Bolsa	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
13026	Vector Casa de Bolsa	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
13027	Casa de Bolsa Banorte	701005	Bank Of America (Extranjero)
13032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
13040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
13041	Invex Casa de Bolsa	701008	Bank Of New York (Extranjero)
13104	ING Baring (México) Casa de Bolsa	701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
13105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa	701010	Bank One (Extranjero)
13106	Deutsche Securities Casa de Bolsa	701011	BNP Paribas (Extranjero)
13109	J.P. Morgan Casa de Bolsa	701012	Barclays Bank (Extranjero)
13114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701013	Bear Stearns (Extranjero)
13117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa	701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
13118	Casa de Bolsa Credit Suisse México	701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
13119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa	701016	Citi National Bank (Extranjero)
13120	UBS Casa de Bolsa	701017	Citibank (Extranjero)
13121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701018	Comerica Bank (Extranjero)
13122	Base Internacional Casa de Bolsa	701019	Commerzbank (Extranjero)
13123	Barclays Capital Casa de Bolsa	701020	Controladora Prosa
13124	Intercam Casa de Bolsa	701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
13125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701022	Credit Suisse (Extranjero)
13126	BullTick Casa de Bolsa	701023	Den Danske Bank (Extranjero)
13127	Masari Casa de Bolsa, S.A.	701024	Deutsche Bank (Extranjero)
13129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
13130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701026	Fortis Bank (Extranjero)
13131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.	701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
16031	Monex Divisas, S.A. de C.V.	701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
16035	Central de Divisas Casa de Cambio	701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
16040	Consultoría Internacional Casa de Cambio	701030	Indosuez International (Extranjero)
16041	Casa de Cambio Tiber	701031	ING Bank (Extranjero)
16044	Eurofimec, Casa de Cambio	701032	J.P. Morgan (Extranjero)
16067	Masari, Casa de Cambio	701033	Lehman Brothers (Extranjero)
16240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio	701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
16408	B y B Casa de Cambio	701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
16419	Finamex Casa de Cambio	701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
16507	Casa de Cambio Tamibe	701038	Republic National Bank (Extranjero)
16533	Casa de Cambio Majapara	701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)

16587	Sterling Casa de Cambio
16629	Money Tron Casa de Cambio
16712	Intercom Casa de Cambio
16714	Order Express Casa de Cambio
16715	Prodira, Casa de Cambio
16717	Imperial Casa de Cambio
16718	Divisas San Jorge Casa de Cambio
16719	Unica Casa de Cambio
25001	Bolsa Mexicana de Valores
25002	S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores
25007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados
25013	Contraparte Central de Valores de México
25014	Flujos por pago de cupón o dividendo
37006	Banco Nacional de Comercio Exterior
37009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos
37019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada
37135	Nacional Financiera
37166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros
37168	Sociedad Hipotecaria Federal
40002	Banco Nacional de México
40012	BBVA Bancomer
40014	Banco Santander
40017	BBVA Bancomer Servicios
40021	HSBC México
40022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero
40030	Banco del Bajío
40032	Ixe Banco
40036	Banco Inbursa
40037	Banco Interacciones
40042	Banca Mifel
40044	Scotiabank Inverlat
40058	Banco Regional de Monterrey
40059	Banco Invex
40060	Bansi
40062	Banca Afirme
40072	Banco Mercantil del Norte
40102	The Royal Bank of Scotland México
40103	American Express Bank (México)
40106	Bank of America México
40108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)
40110	Banco J.P. Morgan
40112	Banco Monex
40113	Banco Ve por Más
40116	ING Bank (México)
40124	Deutsche Bank México
40126	Banco Credit Suisse México
40127	Banco Azteca
40128	Banco Autofin México
40129	Barclays Bank México
40130	Banco Compartamos
40131	Banco Ahorro Famsa
40132	Banco Multiva
40133	Banco Actinver
40134	Banco Wal-Mart de México Adelante
40136	Banco Regional

701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
701041	Societe Generale (Extranjero)
701042	Solomon Brothers (Extranjero)
701043	Standard Bank London (Extranjero)
701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
701048	Union Bank (Extranjero)
701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
701053	NYSE (New York Stock Exchange)
701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)
701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
701275	Asigna, Compensación y Liquidación
701276	Chicago Board of Trade
701277	Credit Agricole Corp
701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
801150	Bank Morgan Stanley Ag
801151	Smith Barney / Cgm Inc.
801152	Citi Bank N.A. New York Officers
801153	Pershing Inc.
801154	Calyon Financial Inc.
801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
801157	Segregación de Instrumentos
801158	Segregación Inversa de Instrumentos
801159	Reclasificaciones
801160	Acciones Propias
801161	Cortes Transversales
801162	Bank West
801163	Bcpbank Canada
801164	Bridgewater Bank
801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
801166	Canadian Tire Bank
801167	Canadian Western Bank
801168	Citizens Bank Of Canada
801169	Cs Alterna Bank
801170	Dundee Bank Of Canada
801171	First Nations Bank Of Canada
801172	General Bank Of Canada
801173	Laurentian Bank Of Canada
801174	Manulife Bank Of Canada
801175	National Bank Of Greece (Canada)
801176	Pacific & Western Bank Of Canada
801177	Wachovia Bank N.A.
801178	Wells Fargo Bank N.A.
801179	Us Bank N.A.

40137	BanCoppel
40138	Banco Amigo
40139	UBS Bank México
40140	Banco Fácil
40141	Volkswagen Bank
40142	El Banco Deuno
40143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple
40144	The Bank of New York Mellon (México)
40145	Banco Base
40160	Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple
46048	Citibank (Banamex USA)
47005	Morgan Stanley and Company Limited
76000	Otros Operadores
76001	Derfin
76008	Stock & Price
76010	Scotia Inverlat Derivados
76014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados
76018	Servicios y Asesoramientos Financieros (Serafi)
76022	Darka
76029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados
76043	Timber Hill LLC.
76044	Enlace Derivados
76048	Intercam Derivados
79001	Bancomer Holding-Islas Caimán
79003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.
79004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.
79005	Intermex Holding, S.A.- Luxemburgo
79006	Euro-American Capital Corporation Limited.- Islas Caimán
79009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.
79010	California Commerce Bank-California, E.U.A.
79012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda
79013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda
79014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán
79015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.
79016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán
79017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán
79018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán
79022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.
79025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.
79026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp
79027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.
79028	BBVA Bancomer USA
79029	Dinero Express
79030	Banorte USA Corporation
79031	INB Financial Corp.
79032	INB Delaware Corporation
79033	Inter Nacional Bank

801180	Suntrust Bank
801181	Hsbc Bank Usa N.A.
801182	Fia Card Svc N.A.
801183	Regions Bank
801184	National City Bank
801185	Branch Bkg & TC
801186	State Street B&TC
801187	Countrywide Bank N.A.
801188	Pnc Bank N.A.
801189	Keybank N.A.
801190	Lasalle Bank N.A.
801191	North Fork Bank
801192	Manufacturers & Traders Tc
801193	Bank Of The West
801194	Fifth Third Bank
801195	Northern TC
801196	Goldman Sachs Paris
801197	Citigroup Global Markets, INC
801198	Jefferies Group, LLC
801199	UBS Securities, LLC
801200	Evercore, LLC
801201	GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney)
801202	Santander USA
801203	CME Clearing
801204	Barclays Capital, Inc
801205	BCP Securities, LLC
801206	BTG Pactual US Capital, LLC
801207	Bulltick, LLC
801208	Santander Investment Securities, Inc
801209	Scotia Capital, Inc
801210	Natixis
801211	XP Securities LLC
801212	INTL FCStone
801213	LarrainVial Securities US LLC
801214	HSBC Securities USA
801215	Stone Financial Inc.
801216	ICE Clearing
900000	Otros Mandatarios o Administradores
900001	Schroders Plc.
900002	Blackrock Inc.
900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
900004	Amundi Asset Management
900005	Nomura Holdings, Inc .
900007	Wellington Management Company LLP
900008	Ninety One PLC
900009	Alliance Bernstein
900011	Fidelity International
900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.

80000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras
80001	Acci Securities Incorporated
80004	Afin Securities International Limited
80005	Arka Securities Incorporated
80008	BBVA Bancomer Securities International Inc.
80009	BBVA Bancomer Holdings Corporation
80013	Vectormex Incorporated
80014	Vectormex Global Advisors Incorporated
80015	Vectormex International Incorporated
80019	Valores Finamex Corporation, Inc.
80020	Valores Finamex International Incorporated
80021	Finamex Securities Incorporated
80022	Valores Finamex Limited
80023	Interacciones Global Incorporated
80024	Inter-Financial Services, Limited
80025	Monex Securities Incorporated
80026	Invex Incorporated
80027	GBM International Incorporated
80028	Foreign Holdings Ltd.
80029	Portfolio Investment Incorporated
80030	Arka International, Corp.
80031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
80032	Banorte Asset Management, Inc.
80033	Afin International Holdings, Inc.
80034	Banorte I, LLC.
80037	Invex International, S.A.
80038	Invex Worldwide, S.A.
80041	Inbursa International, Inc.
80042	Inbursa Securities, Inc.
80043	IXE Holdings, Inc.
82004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
82006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
82008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
82009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
82010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
82011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
82012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
82014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
82016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
82025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
82027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
82030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
82031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán

900014	Goldman Sachs Asset Management International
900015	Morgan Stanley Investment Management Inc
900016	Vanguard Group
900017	Natixis
900018	WisdomTree Investments, Inc.
900019	State Street Corporation
900020	DWS Investments
900021	Sherpa Capital
900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
900023	FirstTrust
900024	Baillie Gifford
900025	UBS AG
900026	AXA Investment Managers
900027	BNP Paribas Asset Management
900028	GAM Holding AG
900029	Invesco Capital Management
900030	Janus Henderson Investors
900031	Jupiter Asset Management Limited
900032	NN Investment Partners B.V.
900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
900034	Columbia Threadneedle Investments
900035	UTI Asset Management
900036	Nikko Asset Management
900037	Global X
900038	VanEck
900039	KraneShares
900040	ProShares
900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
900043	Acadian Asset Management LLC
900044	Man Group
900045	Berenberg
900046	Finamex
900047	ODDO BHF Asset Management SAS
910000	Otras Bolsas de Derivados
920000	Otros Socios Operadores
930000	Otros Socios Liquidadores
940000	Otras Cámaras de Compensación
950000	Otras Plataformas Electrónicas de Negociación
950001	Allfunds Bank, S.A.U.
950002	Fundvest, Pershing LLC
950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

<sup>15</sup> Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos; si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de

existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas, en caso de no existir se anotará un CERO justificado a la izquierda.

<sup>16</sup> Bloomberg Ticker será la clave que asigna Bloomberg al tipo de contrato o producto reportado. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

<sup>17</sup> "Unique Trade Identifier" o "Unique Swap Identifier" es la clave única de operación asignada con propósitos de reporte regulatorio, a cada operación de derivados. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

#### POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO

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

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

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

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

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

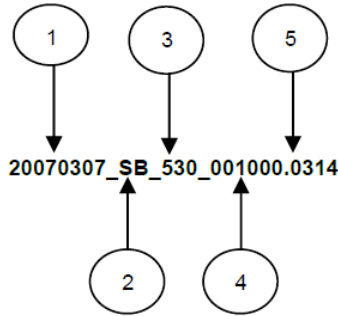
- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con éste.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión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

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad SIEFOREs Básicas, SIEFOREs de Aportaciones Voluntarias, SIEFOREs de Aportaciones Complementarias y SIEFOREs de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	6 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFOREs).
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0314"</b> .

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



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



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

**20070307\_SB\_530\_001000.0314.gpg**

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

**A20070307\_SB\_530\_001000.0314**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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

**Anexo 078**

<b>Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro</b>			
	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0300	<b>PROCESO :</b> FINANCIERO
	<b>FUENTE :</b>	AFORES (con información de SIEFORES)	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>


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

**ENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "343"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0300"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave del Tipo de Entidad Siefore a que corresponda la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad Siefore a que corresponda la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
7	Subtipo de Entidad		N	6	0	22	27	Clave del Subtipo de Entidad a que corresponda la Información de acuerdo al Catálogo de Subtipos de Entidades Siefores, anexos. <sup>1</sup>
8	Fecha de Información		F	8	0	28	35	Fecha de información correspondiente al día hábil previo al que se reporta. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	308	0	36	343	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

## DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>15</sup>
9	Plazo Total de la Operación de Reporto		N	6	0	60	65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Reporto. <sup>1</sup>
10	Plazo Actual del Reporto		N	6	0	66	71	El número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Reporto. <sup>1</sup>
11	Cantidad de Títulos adquiridos en Reporto		N	12	0	72	83	Número de títulos de los valores recibidos como colateral de la operación en Reporto (unidades). <sup>1</sup>
12	Costo total de adquisición del Reporto		N	14	2	84	99	Costo total de la operación de Reporto sin incluir el premio en pesos. <sup>2</sup>
13	Tasa Premio		N	3	3	100	105	Tasa Premio pactada del Reporto. <sup>2</sup>
14	Precio Pactado		N	9	6	106	120	Precio unitario pactado para la operación de Reporto en pesos. <sup>2</sup>
15	Importe pactado de cada operación		N	14	2	121	136	El valor total de la operación en Reporto al vencimiento, equivalente al costo total de adquisición más el premio pactado. <sup>2</sup>

DETALLE 1: DESGLOSE DE VALORES EN REPORTE								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
16	Premio devengado		N	14	2	137	152	Premio devengado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Valor razonable		N	14	2	153	168	Valor de mercado del Reporto a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
18	Tipo de garantía pactada		N	2	0	169	170	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía pactada para la operación según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores <sup>1</sup>
19	Tasa de mercado		N	3	3	171	176	Tasa de mercado al plazo actual del Reporto, proporcionada por el Proveedor de Precios para determinar el valor razonable del Reporto en función a la calificación de la Contraparte de Reporto. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	177	178	Se deberá anotar el identificador de la Divisa pactada en el Reporto para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
21	Divisa de Liquidación		N	2	0	179	180	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el instrumento según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
22	Tipo de cambio pactado		N	9	6	181	195	Tipo de cambio pactado <sup>2</sup> , en el reporte para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. <sup>9</sup>
23	Contraparte		N	6	0	196	201	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	202	221	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
25	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	222	224	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto primera		N	4	0	225	228	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporto conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
27	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	229	231	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora de la calificación homologada reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
28	Calificación de la Contraparte para operaciones de Reporto segunda		N	4	0	232	235	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de reporto conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
29	Folio de operación		N	12	0	236	247	Se deberá anotar un folio único por cada operación de reporto definido por la Siefore, el cual está asociado al folio del colateral de la operación en su caso. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Colateral recibido por concepto de operaciones en reporto y garantías recibidas por concepto de préstamos de valores). En caso de no recibir sobrecolateral llenar con ceros. <sup>1</sup>
30	Espacios en blanco		AN	96	0	248	343	Vacíos. <sup>6</sup>

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>
2	Número consecutivo		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo de acuerdo al Catálogo de Tipo de Operación. <sup>1</sup>
3	Tipo de Inversión		N	2	0	7	8	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, en el caso de llamadas de capital también se deberán reportar con tipo de inversión 0 y como una operación de compra, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 12 para Posición en efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 13 para Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa se debe considerar los montos en AIMS y excedentes y se debe reportar también el efectivo en pesos, 14 para Inversiones tercerizadas, 16 para operaciones cambiarias de compra o venta de divisas. Para las operaciones cambiarias se deberán reportar la operación de compra de la divisa recibida y la operación venta de la divisa entregada. <sup>1</sup>
4	Tipo de Liquidación		N	2	0	9	10	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Liquidación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 01. <sup>1</sup>
5	Tipo de Instrumento		N	2	0	11	12	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
6	ISIN		AN	12	0	13	24	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
7	CUSIP O CINS		AN	9	0	25	33	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
8	SEDOL		AN	7	0	34	40	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
9	Tipo de Valor		AN	4	0	41	44	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EF. <sup>5</sup>
10	Emisora		AN	7	0	45	51	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar EFECTIVO. <sup>5</sup>
11	Serie		AN	7	0	52	58	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de Efectivo en pesos se deberá anotar 990101. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Inveval. <sup>15</sup>
12	Consecutivo		AN	10	0	59	68	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								Tercerizada. Para el caso de Efectivo en pesos se llenará con ceros. <sup>15</sup>
13	Fecha de Liquidación		F	8	0	69	76	Fecha de Liquidación de la operación. <sup>3</sup>
14	Cantidad de Títulos		N	12	0	77	88	Número de Títulos operados (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el monto en la divisa base. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
15	Costo unitario		N	9	6	89	103	Costo unitario en pesos de los títulos operados (Precio Limpio). En caso de ser operaciones en efectivo se anotará el tipo de cambio pactado. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
16	Costo unitario más intereses devengados		N	9	6	104	118	Costo unitario en pesos de los títulos operados incluyendo los intereses devengados por la emisión a la fecha de liquidación (Precio unitario de liquidación). En caso de que la posición no cuente con intereses devengados se deberá reportar el mismo monto que el campo "Costo unitario". En caso de ser operaciones en efectivo o inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
17	Monto total a liquidar		N	14	2	119	134	Monto total a liquidar en la operación en pesos. En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore. Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro". <sup>2</sup>
18	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	135	140	Número de días por transcurrir de la fecha de operación a la fecha de vencimiento de la emisión, o bien, de la operación cambiaria. En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>
19	Tasa de rendimiento		N	3	3	141	146	Tasa de rendimiento pactada para cada operación. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
20	Divisa		N	2	0	147	148	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de origen pactada para operaciones en Divisas según el Catálogo de Divisas. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 99. <sup>1</sup>
21	Tipo de cambio promedio de adquisición		N	9	6	149	163	Tipo de cambio <sup>9</sup> promedio de adquisición para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
22	País de adquisición		N	2	0	164	165	Se deberá anotar el identificador del país donde se adquirió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>
23	Contraparte		N	6	0	166	171	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso de que el tipo de inversión sea 12 o 13: - En caso de ser operaciones de compra/venta de divisas, dividendos, flujos de Swaps o vencimientos Forwards de divisas se reportará el identificador de la contraparte correspondiente a la operación. - En caso de ser operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del Custodio Internacional, de la Plataforma de Negociación Electrónica o del Administrador con el que haya realizado la operación, según el Catálogo de Contrapartes. - En caso de flujos por dividendos o pagos de cupón se deberá reportar el identificador "025014", según el Catálogo de Contrapartes.

DETALLE 2: OPERACIONES COMPRA-VENTA DURANTE EL DIA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								- En caso de llamadas de capital se deberá reportar el identificador "025002". En otro caso se deberá llenar con ceros. <sup>1</sup>
24	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	172	191	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
25	Hora de concertación de la operación		N	4	0	192	195	Hora de concertación de la operación. Para las operaciones de acciones propias, amortizaciones y vencimientos de reporto se deberá llenar con ceros. <sup>10</sup>
26	Banco de Trabajo		N	1	0	196	196	Deberá anotar si se usó un banco de trabajo: Si = 1 y No = 0. <sup>1</sup>
27	Medio de concertación		N	1	0	197	197	Se deberá anotar el medio de concertación de la operación: 0 = No aplica 1 = Telefónico 2 = Electrónico. En este caso deberá indicarse el Sistema de concertación y el tipo de postura en la operación. <sup>1</sup> En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos se deberá considerar lo siguiente: - Cuando se realicen a través del Custodio Internacional o del Administrador o Patrocinador del Fondo se deberá indicar 0. - Cuando se realicen a través de Plataformas se deberá indicar 2. <sup>1</sup>
28	Sistema de concertación		N	2	0	198	199	En el caso de que el medio de concertación sea electrónico deberá indicarse el sistema de concertación según el catálogo de Sistema de Concertación, en caso contrario llenar con ceros. Si se especifica 99, indicar en el campo de observaciones el sistema de concertación usado. 0 - No aplica 1 - MEI 2 - SIPO 3 - VAR 4 - MEIPresval 5 - Corros Monex 6 - Bloomberg 7 - Market Axess 8 - Reuters 99 - OTRO. <sup>1</sup> En el caso de operaciones de compra/venta de Fondos Mutuos que se realicen a través de medios electrónicos, se deberá indicar 99. <sup>1</sup>
29	Tipo de postura		N	1	0	200	200	Se deberá anotar el tipo de postura de la operación de compra venta. 1- Agresor 2- Agredido. Para flujos se considerará como agresor a la parte que detona la acción. <sup>1</sup>
30	Clase de la Inversión tercerizada		N	3	0	201	203	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada, en caso contrario llenar con ceros. <sup>1</sup>
31	Observaciones		AN	20	0	204	223	Se deberán reportar características especiales que no se incorporen en la información del presente detalle para las operaciones de compra y venta que se realicen en el día. <sup>5</sup>
32	Compra en mercado primario		N	1	0	224	224	En caso de reportar compras realizadas en mercado primario anotar 1. En otro caso se deberá anotar 0. <sup>1</sup>
33	Espacios en blanco		AN	119	0	225	343	Vacios. <sup>6</sup>


DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "303"</b> <sup>1</sup> .
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 0 para Directo, 1 para Reporto, 6 para Préstamo de Valores, 7 para Garantías entregadas por operaciones con Instrumentos Financieros Derivados, 11 para el Inst. de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados, 14 para Inversiones Tercerizadas 15 para Garantías entregadas por operaciones con instrumentos estructurados. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento <sup>1</sup> .
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar MDT. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario. <sup>5</sup>
9	Serie		AN	7	0	47	53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. En caso de ser Inversiones Tercerizadas será un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. Para el caso de Inversiones Tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión Tercerizada. <sup>15</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos en la posición de la emisión en la cartera (en unidades). Para el caso de ETF's y Fondos Mutuos será el número de unidades de creación. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá anotar 1. <sup>1</sup>
12	Costo promedio unitario en pesos de Adquisición		N	9	6	76	90	En este campo se debe poner el costo unitario promedio de adquisición. En el caso de operaciones de préstamo de valores y de garantías entregadas por operaciones con IFD, este valor debe reflejar el costo unitario de los valores al inicio de la operación y mantenerse constante hasta el vencimiento o realización En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros. <sup>2</sup>
13	Costo Total de Adquisición		N	14	2	91	106	De acuerdo al Catálogo de Tipos de inversión: -Si se indica "1" en el campo Tipo de Inversión

DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								<p>entonces en este campo se debe poner el costo total de la operación del reporte sin incluir el premio.</p> <p>-Si se indica "0, 6, 7, 11" en el campo Tipo de Inversión entonces en este campo se debe poner costo total de adquisición. Este costo debe ser igual a la cantidad de títulos por el costo promedio unitario.</p> <p>-En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el monto en pesos conforme a la fecha de ingreso o egreso de los recursos de la Siefore.</p> <p>Los montos deberán expresarse conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro".<sup>2</sup></p>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	<p>En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte</p> <p>En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.<sup>2</sup></p>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	<p>En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado.</p> <p>En caso de que el Tipo de Inversión sea "14" se deberá reportar el valor a Mercado en pesos conforme a las "DISPOSICIONES de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro" y a las "DISPOSICIONES de carácter general que establecen el régimen de inversión al que deberán sujetarse las sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro".<sup>2</sup></p>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	<p>Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se deberá llenar con ceros.<sup>2</sup></p>
17	Días por Vencer a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	<p>Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte a la fecha de vencimiento de la emisión. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros.<sup>1</sup></p>
18	País de origen		N	2	0	160	161	<p>Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. En caso de ser Inversiones Tercerizadas se anotará el país de origen del mandatario.<sup>1</sup></p>
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162	164	<p>Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.<sup>1</sup></p>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165	168	<p>Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000.<sup>1</sup></p>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169	171	<p>Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras.<sup>1</sup></p>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172	175	<p>Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las</p>



DETALLE 3: CARTERA DE VALORES								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
27	Tipo de derecho o modificación accionaria		N	2	0	190	191	Se deberá anotar el identificador del tipo de derecho o modificación accionaria decretado según el Catálogo de Tipo de Derecho, para cualquier Activo Objeto de Inversión, de lo contrario llenar con ceros. <sup>1</sup>
28	Fecha en que se decreta el derecho o modificación accionaria		F	8	0	192	199	Si se ha decretado algún tipo de derecho o modificación accionaria a la fecha del reporte que no haya sido liquidado/ejercido, se deberá anotar la fecha en que se decretó. Solamente en el caso de acciones o vehículos, de lo contrario llenar con ceros. <sup>3</sup>
29	Proporción de la modificación accionaria		N	6	6	200	211	En caso de reportarse algún Tipo de derecho o modificación accionaria en el Id 27, indicar la proporción en que se modificó la tenencia de acciones o vehículos (reportar el factor que se multiplica por cada título: #Títulos nuevos / #Títulos anteriores). <sup>2</sup>
30	Ejercicio del derecho o modificación accionaria		N	1	0	212	212	En caso de ejercerse en la fecha de información el derecho o modificación accionaria se deberá anotar "1" si no "0". <sup>1</sup>
31	Monto del Derecho		N	14	2	213	228	Si el tipo de derecho decretado es pago en efectivo se deberá anotar el monto decretado de pago por unidad accionaria o por título del vehículo. <sup>2</sup>
32	Valor Nominal Actualizado		N	14	6	229	248	Se refiere al Valor Nominal Actual del instrumento (solo para Bonos), Este dato se puede obtener del proveedor de precios (Denominado en moneda de origen). En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
33	Títulos en circulación		N	14	0	249	262	Se refiere al total títulos en circulación del instrumento en tenencia. En caso de ser operaciones en efectivo o Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>
34	Valor Nominal Inicial		N	14	6	263	282	Se refiere al Valor Nominal Original del instrumento, Este dato se puede obtener del proveedor de precios si son acciones el campo será 0 (Denominado en moneda de origen). En caso de ser Inversiones Tercerizadas se llenará con ceros. <sup>1</sup>

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

DETALLE 4: DETERMINACION DEL PRECIO DE LA ACCION Y ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "304"</b> . <sup>1</sup>
2	Capital Contable (Activo Total de la Sociedad de Inversión)		N	14	2	4	19	Es el capital contable, la suma del Activo Administrado por una Sociedad de Inversión y de los Activos Administrados por los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
3	Activo Administrado por la Sociedad de Inversión		N	14	2	20	35	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión directamente gestionado en materia de inversiones por ésta, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
4	Activo Administrado por los Mandatarios		N	14	2	36	51	Es el valor de mercado de los Activos Objeto de Inversión de la Sociedad de Inversión que se encuentre bajo la gestión financiera de los Mandatarios contratados por dicha Sociedad de Inversión, deberá estar denominado en pesos con 2 decimales. <sup>2</sup>
5	Acciones en circulación finales		N	12	0	52	63	Es la cantidad de acciones en circulación en día que se está reportando. <sup>1</sup>
6	Precio de la acción		N	9	6	64	78	Es el precio calculado de la acción, en pesos con 6 decimales. <sup>2</sup>
7	Espacios en blanco		AN	265	0	79	343	Vacios. <sup>6</sup>

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

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "305"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo de Inversión		N	2	0	4	5	Se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Tipo de Inversión únicamente: 8 para Garantías recibidas por operaciones de Reporto, 10 para Garantías recibidas por Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
3	Tipo de Instrumento		N	2	0	6	7	Se deberá anotar el identificador según el Catálogo de Tipo de Instrumento. <sup>1</sup>
4	ISIN		AN	12	0	8	19	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
5	CUSIP O CINS		AN	9	0	20	28	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
6	SEDOL		AN	7	0	29	35	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
7	Tipo de Valor		AN	4	0	36	39	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
8	Emisora		AN	7	0	40	46	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
9	Serie		AN	7	0	47	53	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
10	Consecutivo		AN	10	0	54	63	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>15</sup>
11	Cantidad de Títulos		N	12	0	64	75	Cantidad de Títulos recibidos de la emisión (en unidades). <sup>1</sup>
12	Costo unitario original en pesos		N	9	6	76	90	En este campo se debe poner el costo unitario original al que se recibió. <sup>2</sup>
13	Costo Total Original		N	14	2	91	106	Se debe poner el costo total original al que se recibió la posición en garantía. Este valor debe ser igual al costo unitario original por el número de títulos. <sup>2</sup>
14	Valor unitario a Mercado		N	9	6	107	121	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
15	Valor total a Mercado		N	14	2	122	137	En este campo se debe poner el valor total a mercado. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por el valor unitario de mercado. <sup>2</sup>
16	Intereses Devengados		N	14	2	138	153	Importe de los Intereses devengados por la emisión a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Días por Transcurrir a la Fecha de Vencimiento		N	6	0	154	159	Número de días por transcurrir a partir de la fecha del reporte, a la fecha de vencimiento de la emisión. <sup>1</sup>
18	País de origen		N	2	0	160	161	Se deberá anotar el identificador del país donde se emitió el activo conforme al Catálogo de Países. <sup>1</sup>
19	Calificadora Emisión primera		N	3	0	162	164	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
20	Calificación Homologada de la Emisión primera		N	4	0	165	168	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
21	Calificadora Emisión segunda		N	3	0	169	171	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisión

<b>DETALLE 5: COLATERALES Y GARANTÍAS RECIBIDAS POR CONCEPTO DE OPERACIONES EN REPORTE Y PRÉSTAMOS DE VALORES, QUE NO FORMAN PARTE DEL ACTIVO TOTAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN</b>								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
22	Calificación Homologada de la Emisión segunda		N	4	0	172	175	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al papel o instrumento conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
23	Calificadora Emisora primera		N	3	0	176	178	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Emisora primera		N	4	0	179	182	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
25	Calificadora Emisora segunda		N	3	0	183	185	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Emisora segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Emisora segunda		N	4	0	186	189	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al emisor conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
27	Contraparte		N	6	0	190	195	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes <sup>1</sup> .
28	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	196	215	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
29	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	216	218	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
30	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	219	222	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
31	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	223	225	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
32	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	226	229	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
33	Folio de operación		N	12	0	230	241	Se deberá anotar el folio asociado a la operación de reporte o préstamo de valores definido por la Siefore, el cual deberá ser el mismo reportado en los detalle 1 (Desglose de Valores en

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





Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								Reporto) y 6 (Desglose de valores en préstamo) respectivamente <sup>1</sup> .
34	Espacios en blanco		AN	102	0	242	343	Vacios <sup>6</sup> .

**DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO**








Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "306". <sup>1</sup>
2	ISIN		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios. <sup>12</sup>
3	CUSIP O CINS		AN	9	0	16	24	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios. <sup>13</sup>
4	SEDOL		AN	7	0	25	31	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios. <sup>14</sup>
5	Tipo de Valor		AN	4	0	32	35	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
6	Emisora		AN	7	0	36	42	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al activo. <sup>5</sup>
7	Serie		AN	7	0	43	49	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al activo. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. <sup>15</sup>
8	Consecutivo		AN	10	0	50	59	Clave que le otorgue al consecutivo el proveedor de precios al activo. <sup>15</sup>
9	Plazo Total de la Operación de Préstamo de Valores		N	6	0	60	65	Número de días entre la fecha de concertación y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. Se mantendrá constante en tanto el instrumento se encuentre en préstamo. <sup>1</sup>
10	Plazo Actual de la Operación de Préstamo de Valores		N	6	0	66	71	Número de días entre la fecha del reporte y la fecha de vencimiento del Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
11	Cantidad de Títulos en préstamo		N	12	0	72	83	Número de títulos en préstamo (en unidades). <sup>1</sup>
12	Valor inicial de mercado del Préstamo de Valores		N	9	6	84	98	Precio unitario pactado para la operación de Préstamo de Valores en pesos. <sup>2</sup>
13	Valor inicial total de mercado del Préstamo de Valores		N	14	2	99	114	Valor inicial total de la operación de Préstamo de Valores sin incluir el premio en pesos. Este valor debe ser igual a la cantidad de títulos por valor inicial de mercado. <sup>2</sup>
14	Importe pactado de cada operación		N	14	2	115	130	El valor total de la operación de Préstamo de Valores al vencimiento, equivalente al valor inicial total de mercado más el premio pactado. <sup>2</sup>
15	Tasa Premio		N	3	3	131	136	Tasa Premio pactada para el Préstamo de Valores. <sup>2</sup>
16	Premio devengado		N	14	2	137	152	Premio devengado del Préstamo de Valores a la fecha del reporte. <sup>2</sup>
17	Tipo de garantía pactada		N	2	0	153	154	Se deberá anotar el identificador del tipo de garantía según el Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores. <sup>1</sup>
18	Divisa		N	2	0	155	156	Se deberá anotar el identificador de la Divisa del activo objeto del Préstamo de Valores según el Catálogo de Divisas <sup>1</sup> .
19	Divisa de Liquidación		N	2	0	157	158	Se deberá anotar el identificador de la Divisa con la cual se liquidará el premio de la operación según el Catálogo de Divisas. <sup>1</sup>
20	Tipo de cambio pactado		N	9	6	159	173	Tipo de cambio <sup>9</sup> pactado para la liquidación del premio, en el Préstamo de Valores para operaciones en Divisas distintas al peso mexicano. Para la liquidación del premio en pesos mexicanos reportar 1. <sup>2</sup>

DETALLE 6: DESGLOSE DE VALORES EN PRESTAMO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
21	Contraparte		N	6	0	174	179	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup>
22	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	180	199	Se deberá anotar el nombre de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo. En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
23	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	200	202	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
24	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	203	206	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
25	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	207	209	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
26	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	210	213	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte para operaciones de préstamo de valores conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
27	Folio de operación		N	12	0	214	225	Se deberá anotar un folio único por cada operación de préstamo de valores definido por la Siefore, el cual está asociado al folio de garantía de la operación. Deberá ser el mismo reportado en el detalle 5 (Garantías recibidas por concepto de operaciones en reporto, prestamos de valores y derivados que no forman parte del activo total de la sociedad de inversión). <sup>1</sup>
28	Espacios en blanco		AN	118	0	226	343	Vacios <sup>6</sup> .

**DETALLE 7: ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "307"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de Movimiento		N	4	0	4	7	Se deberá señalar un número de movimiento definido por la SIEFORE el cual se incrementará por cada nuevo movimiento o flujo reportado, El número de movimiento deberá iniciar en 1 cada día. <sup>1</sup>
3	Tipo de inversión		N	2	0	8	9	Se deberá anotar el identificador del tipo de inversión del activo financiero del que derive el flujo o movimiento de efectivo conforme al Catálogo de Tipo de Inversión. <sup>1</sup>
4	Tipo de valor		AN	4	0	10	13	Clave que le otorgue el proveedor de precios al tipo de valor del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado. En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar MDT. Para el caso de flujos de operaciones cambiarías en el mercado spot o intereses



**DETALLE 7:** ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el tipo de valor asignado por el proveedor a la divisa del flujo, o EF si se encuentra denominado en pesos. <sup>5</sup>
5	Emisora		AN	7	0	14	20	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la emisora del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado. En caso de ser Inversiones tercerizadas deberá ser definido por la SIEFORE para cada mandatario. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la emisora asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o EFECTIV si se encuentra denominado en pesos. <sup>5</sup>
6	Serie		AN	7	0	21	27	Clave que le otorgue el proveedor de precios a la serie del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo reportado. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Indeval. En caso de ser Inversiones tercerizadas será un consecutivo definido por la SIEFORE el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar la serie asignada por el proveedor a la divisa del flujo, o 990101 si se encuentra denominado en pesos. <sup>15</sup>
7	Consecutivo		AN	10	0	28	37	Clave que le otorgue el proveedor de precios al consecutivo del Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. Para el caso de Inversiones tercerizadas se deberá anotar el identificador según el catálogo de Clase de la Inversión tercerizada. <sup>15</sup>
8	ISIN		AN	12	0	38	49	Se deberá anotar la clave del ISIN proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>12</sup>
9	CUSIP O CINS		AN	9	0	50	58	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>13</sup>
10	SEDOL		AN	7	0	59	65	Se deberá anotar la clave del SEDOL proporcionada por el proveedor de precios al Activo Objeto de Inversión del que proviene el flujo. En caso de ser Inversiones tercerizadas se deberá anotar un 0. <sup>14</sup>
11	Tipo de flujo		N	2	0	66	67	Se deberá reportar el tipo de flujo según el Catálogo de Tipos de Flujo. Para el caso de los flujos por dividendos y distribuciones de efectivo estos deberán ser reportados en la fecha exderecho. Aquí se deberán reportar las comisiones de cualquier tipo (comisiones sobre saldo, las comisiones Mexder, la tasa PAI, las comisiones de los Brókers, etc) y se deberá especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" del presente detalle el tipo de comisión. <sup>1</sup>
12	Descriptivo de tipo de flujo		AN	30	0	68	97	En caso de utilizar el identificador "99 - Otros



**DETALLE 7:** ESTE DETALLE CONTIENE INFORMACIÓN DEL DESGLOSE A NIVEL ACTIVO OBJETO DE INVERSIÓN, DE LOS MOVIMIENTOS O FLUJOS DE EFECTIVO DIARIOS QUE SE GENERAN POR LA ADMINISTRACIÓN DE LA CARTERA DE INVERSIÓN DE LAS SIEFORES. LO ANTERIOR CONSIDERA EL PAGO DE CUPONES, FLUJOS DE AMORTIZACIÓN, VENCIMIENTOS, PAGO DE DIVIDENDOS, DISTRIBUCIONES DE EFECTIVO, FLUJOS EN OPERACIONES DE DERIVADOS, INTERESES PAGADOS POR DEPÓSITOS DE EFECTIVO, ENTRE OTROS QUE PUDIERAN GENERARSE. LOS FLUJOS DEBERÁN SER REPORTADOS EN LA FECHA EN LA QUE SON RECONOCIDOS O DETERMINADOS, INDEPENDIEMENTE DE LA FECHA EN QUE ÉSTOS SE LIQUIDEN.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								flujos" en el campo "Tipo de flujo", se deberá registrar un nombre descriptivo del tipo de flujo que se está reportando. <sup>5</sup>
13	Contraparte flujo		N	6	0	98	103	Se deberá anotar el identificador de la Contraparte liquidadora de conformidad con el Catálogo de Contrapartes. <sup>1</sup> En caso de Fondos Mutuos se deberá reportar el identificador del administrador de acuerdo al Catálogo de Contrapartes <sup>1</sup>
14	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	104	123	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte liquidadora limitado a 20 caracteres cuando no exista identificador para la contraparte en el catálogo de Contrapartes. En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
15	Fecha de liquidación		F	8	0	124	131	Se deberá reportar la fecha de liquidación del flujo. <sup>3</sup>
16	Títulos o unidades		N	12	0	132	143	Se deberá reportar el número de títulos o unidades del Activo Objeto de Inversión de los cuales se deriva el flujo reportado. Para el caso de swaps se deberá reportar el monto notional utilizado para valuar la posición con el precio otorgado por el proveedor de precios. Para el caso de operaciones con derivados se deberá reportar el producto de número de contratos por tamaño de contratos. Para el caso de flujos de operaciones cambiarias en el mercado spot o intereses provenientes de depósitos de dinero a la vista, se deberá reportar el número de divisas o pesos de los cuales se deriva el flujo reportado. <sup>1</sup>
17	Divisa		N	2	0	144	145	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se encuentra denominado el flujo reportado. <sup>1</sup>
18	Divisa de liquidación		N	2	0	146	147	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en la que se liquidará el flujo reportado. <sup>1</sup>
19	Tipo de cambio aplicado		N	9	6	148	162	Se deberá anotar el tipo de cambio aplicado para valuar en pesos mexicanos el flujo denominado en divisas, o 1 si el flujo está denominado en pesos mexicanos. <sup>2</sup>
20	Dirección del flujo		N	1	0	163	163	Se deberá reportar un 1 si se trata de un flujo de entrada a la cartera de la SIEFORE. Se deberá reportar un 2 si se trata de un flujo de salida a la cartera de la SIEFORE. <sup>1</sup>
21	Monto de flujo en Divisa		N	14	2	164	179	Monto total del flujo expresado en la divisa en la que se encuentra denominado. <sup>2</sup>
22	Monto de flujo en pesos mexicanos		N	14	2	180	195	Monto total del flujo expresado en pesos mexicanos. <sup>6</sup>
23	Espacios en blanco		AN	148	0	196	343	Vacios. <sup>6</sup>




**DETALLE 8:** DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "308"</b> . <sup>1</sup>
2	Contraparte		N	6	0	4	9	Identificador de la Contraparte según el Catálogo de Contrapartes. En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMS excedentes) se deberá reportar el identificador del Socio Liquidador. En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) se deberá reportar el identificador de la Cámara de compensación. <sup>1</sup>
3	Nombre corto de la contraparte		AN	20	0	10	29	Se deberá anotar el nombre corto de la contraparte limitado a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para la



DETALLE 8: DEPÓSITOS BANCARIOS DE DINERO A LA VISTA REALIZADOS EN INSTITUCIONES DE CRÉDITO								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								<p>contraparte en el catálogo.</p> <p>En caso del que el Tipo de Depósito sea 3 (AIMS excedentes) y no exista identificador para el Socio Liquidador en el catálogo se deberá reportar el nombre corto del Socio Liquidador.</p> <p>En caso del que el Tipo de Depósito sea 4 (AIMS) y no exista identificador para la Cámara de Compensación en el catálogo se deberá reportar el nombre corto de la Cámara de Compensación.</p> <p>En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup></p>
4	Divisa		N	2	0	30	31	Se reportará el identificador de la de la divisa en la cual está denominado el depósito o en su caso la aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
5	Monto en divisa		N	12	2	32	45	Se deberá anotar el valor del depósito o aportaciones en la divisa de liquidación. <sup>2</sup>
6	Monto		N	12	2	46	59	En este campo se debe reportar el valor en pesos mexicanos del depósito o en su caso aportación mínima o excedente en operaciones con Derivados. <sup>2</sup>
7	Tipo de Depósito		N	1	0	60	60	Se deberá anotar el tipo de depósito según el catálogo de tipo de depósito. <sup>1</sup>
8	Calificadora Contraparte primera		N	3	0	61	63	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
9	Calificación Homologada de la Contraparte primera		N	4	0	64	67	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
10	Calificadora Contraparte segunda		N	3	0	68	70	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación de la Contraparte segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. <sup>1</sup>
11	Calificación Homologada de la Contraparte segunda		N	4	0	71	74	Se deberá anotar el identificador de la calificación de la contraparte conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. <sup>1</sup>
12	Espacios vacíos		AN	269	0	75	343	Vacíos. <sup>6</sup>

**DETALLE 9: FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRÁNSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "309"</b> . <sup>1</sup>
2	Divisa del Flujo		N	2	0	4	5	Se reportará el identificador de la divisa en la que se liquidará el flujo que se reporta según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
3	Tipo de Operación		N	1	0	6	6	Indicar 1 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reportada es de entrada 2 si el flujo neto pendiente por liquidar en la divisa que se reporta es de salida. <sup>1</sup>
4	Monto por liquidar		N	12	2	7	20	Se deberá anotar el valor absoluto de los flujos netos totales, en pesos mexicanos, para la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle, que estén pendientes por liquidar. <sup>2</sup>
5	Monto en divisa		N	12	2	21	34	Se deberán reportar los flujos netos totales que estén pendientes por liquidar en la divisa reportada en el concepto 2 del presente detalle. <sup>2</sup>

**DETALLE 9: FLUJOS PENDIENTES POR LIQUIDAR DERIVADOS DE OPERACIONES EN TRÁNSITO (OPERACIONES FECHA VALOR, PAGO DE CUPONES Y DIVIDENDOS, ETC).**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
6	Espacios vacíos		AN	309	0	35	343	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 10: CONSUMO DE LIMITES REGULATORIOS PARA INVERSIONES TERCERIZADAS**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "310"</b> . <sup>1</sup>
2	Identificador Mandato		AN	4	0	4	7	Se indicará el valor constante MDT. <sup>5</sup>
3	Identificador Mandatario		AN	7	0	8	14	Deberá ser definido por la Siefore para cada mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Emisora reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. <sup>5</sup>
4	Consecutivo mandato		AN	7	0	15	21	Deberá ser un consecutivo definido por la Siefore el cual se incrementará para cada contrato con un mismo mandatario y tendrá que ser el mismo definido para la Serie reportada en el detalle 3 Cartera de Valores. <sup>5</sup>
5	Límite establecido para valores extranjeros		N	14	2	22	37	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en valores extranjeros en el mandato. <sup>1</sup>
6	Consumo del límite para valores extranjeros		N	14	2	38	53	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en valores extranjeros. <sup>1</sup>
7	Límite establecido para Renta Variable		N	14	2	54	69	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en renta variable en el mandato. <sup>1</sup>
8	Consumo del límite para Renta Variable		N	14	2	70	85	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en renta variable. <sup>1</sup>
9	Límite establecido para Mercancías		N	14	2	86	101	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en mercancías. <sup>1</sup>
10	Consumo del límite para Mercancías		N	14	2	102	117	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en mercancías. <sup>1</sup>
11	Límite establecido para Divisas		N	14	2	118	133	Se deberá anotar el monto límite, en pesos, establecido por la Siefore para inversiones en divisas. <sup>1</sup>
12	Consumo del límite para divisas		N	14	2	134	149	Se deberá anotar el monto consumido, en pesos, por el mandato correspondiente al límite de inversión en divisas. <sup>1</sup>
13	Límite establecido para Medida de Control de Riesgo		N	3	8	150	160	Se deberá anotar el límite, en porcentaje, establecido por la Siefore correspondiente al límite de medida de control de riesgo. <sup>1</sup>
14	Consumo del límite para Medida Control de Riesgo		N	3	6	161	169	Se deberá anotar el límite consumido, en porcentaje (truncado a 6 decimales), por el mandato correspondiente al límite de medida de control de riesgo. <sup>1</sup>
15	Espacios vacíos		AN	174	0	170	343	Vacios. <sup>6</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)	
Clave de Entidad	Descripción
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	CITIBANAMEX
556	AZTECA
562	INVERCAP
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

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

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

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

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	000090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.
002	538	000090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	000090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	000090	Siefore Básica de Pensiones	Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	568	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	000090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001000	Siefore Inicial	Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	534	001000	Siefore Inicial	Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE.
002	538	001000	Siefore Inicial	Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	544	001000	Siefore Inicial	Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	550	001000	Siefore Inicial	Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	552	001000	Siefore Inicial	Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	556	001000	Siefore Inicial	Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	562	001000	Siefore Inicial	Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	568	001000	Siefore Inicial	Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	578	001000	Siefore Inicial	Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	530	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	534	001955	Siefore Básica 55-59	Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001955	Siefore Básica 55-59	Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	544	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	550	001955	Siefore Básica 55-59	Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	552	001955	Siefore Básica 55-59	Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	556	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	562	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	568	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V.
002	578	001955	Siefore Básica 55-59	Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	530	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	534	001960	Siefore Básica 60-64	Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001960	Siefore Básica 60-64	Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	544	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	550	001960	Siefore Básica 60-64	Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	552	001960	Siefore Básica 60-64	Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	556	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	562	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	568	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V.
002	578	001960	Siefore Básica 60-64	Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	530	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	534	001965	Siefore Básica 65-69	Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001965	Siefore Básica 65-69	Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	544	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	550	001965	Siefore Básica 65-69	Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	552	001965	Siefore Básica 65-69	Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	556	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	562	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	568	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V.
002	578	001965	Siefore Básica 65-69	Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	530	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	534	001970	Siefore Básica 70-74	Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001970	Siefore Básica 70-74	Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	544	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	550	001970	Siefore Básica 70-74	Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	552	001970	Siefore Básica 70-74	Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	556	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	562	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	568	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V.
002	578	001970	Siefore Básica 70-74	Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	530	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	534	001975	Siefore Básica 75-79	Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001975	Siefore Básica 75-79	Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	544	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	550	001975	Siefore Básica 75-79	Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	552	001975	Siefore Básica 75-79	Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	556	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	562	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	568	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V.
002	578	001975	Siefore Básica 75-79	Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	530	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	534	001980	Siefore Básica 80-84	Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001980	Siefore Básica 80-84	Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	544	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	550	001980	Siefore Básica 80-84	Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	552	001980	Siefore Básica 80-84	Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	556	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	562	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	568	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V.
002	578	001980	Siefore Básica 80-84	Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	530	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	534	001985	Siefore Básica 85-89	Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001985	Siefore Básica 85-89	Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	544	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	550	001985	Siefore Básica 85-89	Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	552	001985	Siefore Básica 85-89	Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	556	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	562	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	568	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V.
002	578	001985	Siefore Básica 85-89	Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	530	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	534	001990	Siefore Básica 90-94	Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	538	001990	Siefore Básica 90-94	Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	544	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	550	001990	Siefore Básica 90-94	Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	552	001990	Siefore Básica 90-94	Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	556	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	562	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	568	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V.
002	578	001990	Siefore Básica 90-94	Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
003	334	000001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A de C.V, Siefore
004	430	000001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	000007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.
004	430	000009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	000010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	000003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

Catálogo de Tipo de Inversión		
Id	Abreviación	Descripción
0	Di	Directo
1	Re	Reporto
6	Pv	Préstamo de Valores
7	Gd	Garantías entregadas por operaciones con IFD
8	Gr	Garantías recibidas por operaciones de Reporto
10	Gp	Garantías recibidas por Préstamo de Valores
11	Ce	Instrumentos de Deuda o Valor Extranjero de Deuda al que se vinculan los Instrumentos Estructurados
12	Ef	Posición en Efectivo denominada en cualquier divisa
13	Ec	Posición de salida en Efectivo denominada en cualquier divisa.
14	It	Inversiones tercerizadas
15	Ge	Garantías entregadas por instrumentos Estructurados
16	Oc	Operaciones Cambiarias de compra o venta de divisas.
17	Er	Garantías entregadas por operaciones de Reporto
18	Ep	Garantías entregadas por operaciones de Préstamo de Valores

Catálogo de Tipo de Liquidación		
Id	Abreviación	Descripción
1	MD	Mismo Día
2	24	24 Hrs.
3	48	48 Hrs.
4	72	72 Hrs.
5	96	96 Hrs.
6	120	120 Hrs.
7	144	144 Hrs.
8	168	168 Hrs.
9	192	192 Hrs.

Catálogo de Tipos de flujo	
Identificador	Descripción
01	Flujo por pago de cupón
02	Flujo por amortización parcial o total
03	Flujo por dividendos (reportado en fecha exderecho)
04	Flujo por distribuciones de efectivo (reportado en fecha exderecho)
05	Flujo por pago de cupones en swaps
06	Flujo por liquidación diaria de derivados listados
07	Flujo por pago de intereses sobre depósitos en efectivo y por AIMS excedentes
08	Flujo por comisiones (Especificar en el campo "Descriptivo de tipo de flujo" la descripción del tipo de comisión.)
09	Liquidación de Comisiones sobre saldo
10	Flujo por ajuste de valuación en instrumentos derivados.
11	Flujo por liquidación de reembolso del Fondo Mutuo
12	Flujo por garantías recibidas en efectivo por IFD
99	Otros flujos

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

Catálogo de Tipo de Instrumento		
Id	Abreviación	Descripción
1	BCC	Bono Cupón Cero
2	BTF	Bono Tasa Fija
3	TFA	Bono Tasa Fija Amortizable
4	BTV	Bono Tasa Flotante
5	TVA	Bono Tasa Flotante Amortizable
6	ACC	Acciones
7	ETF	Exchange Traded Funds
8	NEP	Nota Estructurada con Principal Protegido a Vencimiento
9	TRK	Instrumentos conocidos como Trackers
10	EFF	Efectivo
11	OTR	Otro tipo de instrumento no incluido
12	MDT	Inversión Tercerizada
13	EVS	Estructura vinculada a Subyacente
14	FMU	Fondo Mutuo

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	27	Hungría
2	Australia	28	Letonia
3	Austria	29	Lituania
4	Bélgica	30	Malta
5	Canadá	31	República Checa
6	Dinamarca	32	Suecia
7	España	33	Brasil
8	Estados Unidos de Norteamérica	34	China
9	Finlandia	35	India

10	Francia
11	Grecia
12	Países Bajos (Holanda)
13	Hong Kong
14	Irlanda
15	Italia
16	Japón
17	Luxemburgo
18	México
19	Polonia
20	Portugal
21	Reino Unido de la Gran Bretaña
22	Suiza
23	Chipre
24	Eslovaquia
25	Eslovenia
26	Estonia

36	Otro
37	Rumanía
38	Noruega
39	Chile
40	Israel
41	Bulgaria
42	Colombia
43	Corea del Sur
44	Islandia
45	Perú
46	Singapur
47	Malasia
48	Nueva Zelanda
49	Sudáfrica
50	Tailandia
51	Taiwán
52	Croacia

Catálogo de Sistema de Concertación	
Identificador	Descripción
0	No aplica
1	MEI
2	SIPO
3	VAR
4	MEIPresval
5	Corros Monex
6	Bloomberg
7	Market Axess
8	Reuters
99	OTRO

Catálogo de Intermediación	
Identificador	Descripción
0	Por cuenta propia
1	Banco de trabajo
9	Otro

Catálogo de Tipo de Derechos	
Identificador	Descripción
1	Dividendos en efectivo
2	Dividendos en acciones
3	Escisión
4	Fusión
5	Cambio de Valor Nominal
6	Split
7	Split Inverso
8	Cambio de emisora
9	Cambio de serie
10	Canjes
11	Derechos por Instrumentos Estructurados o Fibras
12	Suscripción de Acciones
13	Otro

Catálogo de Tipo de Garantía para Reportos y Préstamo de Valores	
Identificador	Descripción
0	Ninguna, el reporte o préstamo de valores no se encuentra garantizado
1	Caución bursátil
2	Prenda
3	Fideicomiso de garantía
4	Depósito bancario de dinero

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			<b>HR D</b>			<b>1056</b>
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045
CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048



Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
D	D	D	HR D (G)		D	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055

Catálogo de Tipo de Operación			
Identificador	Clasificación	Abreviación	Descripción
1	001-250	Co	Compra
2	501-750	Ve	Venta
3	251-400	Ac	Compra por amortización
4	751-900	Av	Venta por amortización total o parcial
5	401-500	Gc	Compra por ejercicio de garantías
6	901-999	Gv	Venta por ejercicio de garantías

Catálogo de Clase de Inversión Tercerizada	
Identificador	Descripción
0	No aplica (solamente cuando no sea mandato)
1	Mercancías.
2	Renta Variable.
3	Deuda Extranjera
4	Tipos de Cambio.
9	Mixto.

Catálogo de Contrapartes			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
2001	Banco de México	82035	Confía Oficina de Representación en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13001	Acciones y Valores Banamex, Casa de Bolsa	82037	Cremita Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13004	Casa de Bolsa Santander Serfin	82039	Bancrecer Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
13005	Scotia Inverlat, Casa de Bolsa	82042	Bco. Bilbao Vizcaya Agencia en Nueva York
13006	HSBC Casa de Bolsa	82043	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Nueva York
13007	GBM Grupo Bursátil Mexicano	82044	Bco. Bilbao Vizcaya Oficina de Representación en Londres, Inglaterra.
13010	Casa de Bolsa BBVA-Bancomer	82048	Banco Inbursa Sucursal en Islas Caimán
13011	Multivalores Casa de Bolsa	82049	Bancomer Sucursal en Houston
13012	Finamex Casa de Bolsa	82050	Banamex Oficina de Representación en Londres, Inglaterra
13013	IXE Casa de Bolsa	82051	Casa de Bolsa Ve por Más
13015	Interacciones Casa de Bolsa	700000	Otros Bancos Extranjeros
13018	Casa de Bolsa Arka	701000	ABN Amro Bank (Extranjero)
13019	Value Casa de Bolsa	701001	Abasis
13020	Activer Casa de Bolsa	701002	American Express (Extranjero)
13021	Monex Casa de Bolsa	701003	Banco Bilbao Vizcaya (Extranjero)
13026	Vector Casa de Bolsa	701004	Banco Santander Central Hispano, S. A. (Extranjero)
13027	Casa de Bolsa Banorte	701005	Bank Of America (Extranjero)
13032	Valores Mexicanos Casa de Bolsa	701006	Bank Boston Na (Extranjero)
13040	Inversora Bursátil Casa de Bolsa	701007	Bank Of Montreal (Extranjero)
13041	Invex Casa de Bolsa	701008	Bank Of New York (Extranjero)

13104	ING Baring (México) Casa de Bolsa
13105	Merrill Lynch México Casa de Bolsa
13106	Deutsche Securities Casa de Bolsa
13109	J.P. Morgan Casa de Bolsa
13114	Morgan Stanley México Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13117	ABN Amro Securities (México) Casa de Bolsa
13118	Casa de Bolsa Credit Suisse México
13119	Bank of America Securities, Casa de Bolsa
13120	UBS Casa de Bolsa
13121	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13122	Base Internacional Casa de Bolsa
13123	Barclays Capital Casa de Bolsa
13124	Intercam Casa de Bolsa
13125	CI Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13126	BullTick Casa de Bolsa
13127	Masari Casa de Bolsa, S.A.
13129	Punto Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13130	Goldman Sachs México, Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
13131	BTG Pactual Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
16031	Monex Divisas, S.A. de C.V.
16035	Central de Divisas Casa de Cambio
16040	Consultoría Internacional Casa de Cambio
16041	Casa de Cambio Tiber
16044	Eurofimec, Casa de Cambio
16067	Masari, Casa de Cambio
16240	Asesoría Cambiaria, Casa de Cambio
16408	B y B Casa de Cambio
16419	Finamex Casa de Cambio
16507	Casa de Cambio Tamibe
16533	Casa de Cambio Majapara
16587	Sterling Casa de Cambio
16629	Money Tron Casa de Cambio
16712	Intercam Casa de Cambio
16714	Order Express Casa de Cambio
16715	Prodira, Casa de Cambio
16717	Imperial Casa de Cambio
16718	Divisas San Jorge Casa de Cambio
16719	Unica Casa de Cambio
25001	Bolsa Mexicana de Valores
25002	S.D. Ineval, Institución para el Depósito de Valores
25007	MexDer, Mercado Mexicano de Derivados
25013	Contraparte Central de Valores de México
25014	Flujos por pago de cupón o dividendo
37006	Banco Nacional de Comercio Exterior
37009	Banco Nacional de Obras y Servicios Públicos
37019	Banco Nacional del Ejército, Fuerza Aérea y la Armada
37135	Nacional Financiera
37166	Banco del Ahorro Nacional y Servicios Financieros
37168	Sociedad Hipotecaria Federal
40002	Banco Nacional de México

701009	The Bank Of Nova Scotia (Extranjero)
701010	Bank One (Extranjero)
701011	BNP Paribas (Extranjero)
701012	Barclays Bank (Extranjero)
701013	Bear Stearns (Extranjero)
701014	Cargill Financial Service International (Extranjero)
701015	Chase Manhattan Bank (Extranjero)
701016	Citi National Bank (Extranjero)
701017	Citibank (Extranjero)
701018	Comerica Bank (Extranjero)
701019	Commerzbank (Extranjero)
701020	Controladora Prosa
701021	Credit Lyonnais (Extranjero)
701022	Credit Suisse (Extranjero)
701023	Den Danske Bank (Extranjero)
701024	Deutsche Bank (Extranjero)
701025	Dresdner Bank Lateinamerika (Extranjero)
701026	Fortis Bank (Extranjero)
701027	Goldman Sachs and Co. (Extranjero)
701028	Hong Kong and Shanghai Banking (Extranjero)
701029	HSBC Investment Bank, P.L.C., London, England
701030	Indosuez International (Extranjero)
701031	ING Bank (Extranjero)
701032	J.P. Morgan (Extranjero)
701033	Lehman Brothers (Extranjero)
701034	Merrill Lynch, N.Y. (Extranjero)
701035	Morgan Guaranty Trust N.Y. (Extranjero)
701037	National Westminster Bank (Natwest) (Extranjero)
701038	Republic National Bank (Extranjero)
701039	Royal Bank Of Canada (Extranjero)
701040	Royal Bank Of Scotland, Londres (Extranjero)
701041	Societe Generale (Extranjero)
701042	Solomon Brothers (Extranjero)
701043	Standard Bank London (Extranjero)
701044	Standard Chartered Bank (Extranjero)
701045	Swiss Bank Volksbank (Extranjero)
701046	The Toronto Dominion Bank (TD Bank) (Extranjero)
701047	UBS, A. G., Zurich, Switzerland (Extranjero)
701048	Union Bank (Extranjero)
701049	Westdeutsche Landezbank Girozentrale (Extranjero)
701050	William Financial Services Limited (Extranjero)
701051	CME (Chicago Mercantile Exchange)
701052	LIFE (London International Financial Futures and Options Exchange)
701053	NYSE (New York Stock Exchange)
701054	Simex (Singapur Stock Exchange)
701059	Chicago Board Options Exchange - Chicago
701060	Mid America Commodity Exchange - Chicago
701061	Commodity Exchange Incorporated - New York
701062	Stanley Bank (Utah) (Extranjero)
701119	Banco de Crédito Centroamericano (Bancentro) de Costa Rica (Extranjero)

40012	BBVA Bancomer
40014	Banco Santander
40017	BBVA Bancomer Servicios
40021	HSBC México
40022	GE Money Bank, GE Capital Grupo Financiero
40030	Banco del Bajío
40032	Ixe Banco
40036	Banco Inbursa
40037	Banco Interacciones
40042	Banca Mifel
40044	Scotiabank Inverlat
40058	Banco Regional de Monterrey
40059	Banco Invex
40060	Bansi
40062	Banca Afirme
40072	Banco Mercantil del Norte
40102	The Royal Bank of Scotland México
40103	American Express Bank (México)
40106	Bank of America México
40108	Bank of Tokyo-Mitsubishi (México)
40110	Banco J.P. Morgan
40112	Banco Monex
40113	Banco Ve por Más
40116	ING Bank (México)
40124	Deutsche Bank México
40126	Banco Credit Suisse México
40127	Banco Azteca
40128	Banco Autofin México
40129	Barclays Bank México
40130	Banco Compartamos
40131	Banco Ahorro Famsa
40132	Banco Multiva
40133	Banco Actinver
40134	Banco Wal-Mart de México Adelante
40136	Banco Regional
40137	BanCoppel
40138	Banco Amigo
40139	UBS Bank México
40140	Banco Fácil
40141	Volkswagen Bank
40142	El Banco Deuno
40143	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple
40144	The Bank of New York Mellon (México)
40145	Banco Base
40160	Banco S3 Caceis México, S.A., Institución de Banca Múltiple
46048	Citibank (Banamex USA)
47005	Morgan Stanley and Company Limited
76000	Otros Operadores
76001	Derfin
76008	Stock & Price
76010	Scotia Inverlat Derivados
76014	García Macías, Araneda y Asociados GAMAA Derivados
76018	Servicios y Asesoramientos Financieros

701121	Banco Latinoamericano de Exportaciones (Bladex) (Extranjero)
701275	Asigna, Compensación y Liquidación
701276	Chicago Board of Trade
701277	Credit Agricole Corp
701278	Credit Agricole Securities (USA), Inc
801150	Bank Morgan Stanley Ag
801151	Smith Barney / Cgm Inc.
801152	Citi Bank N.A. New York Officers
801153	Pershing Inc.
801154	Calyon Financial Inc.
801155	Morgan Stanley And Co. International Limited
801156	Morgan Stanley And Co. Securities Limited
801157	Segregación de Instrumentos
801158	Segregación Inversa de Instrumentos
801159	Reclasificaciones
801160	Acciones Propias
801161	Cortes Transversales
801162	Bank West
801163	Bcpbank Canada
801164	Bridgewater Bank
801165	Canadian Imperial Bank Of Commerce
801166	Canadian Tire Bank
801167	Canadian Western Bank
801168	Citizens Bank Of Canada
801169	Cs Alterna Bank
801170	Dundee Bank Of Canada
801171	First Nations Bank Of Canada
801172	General Bank Of Canada
801173	Laurentian Bank Of Canada
801174	Manulife Bank Of Canada
801175	National Bank Of Greece (Canada)
801176	Pacific & Western Bank Of Canada
801177	Wachovia Bank N.A.
801178	Wells Fargo Bank N.A.
801179	Us Bank N.A.
801180	Suntrust Bank
801181	Hsbc Bank Usa N.A.
801182	Fia Card Svc N.A.
801183	Regions Bank
801184	National City Bank
801185	Branch Bkg & TC
801186	State Street B&TC
801187	Countrywide Bank N.A.
801188	Pnc Bank N.A.
801189	Keybank N.A.
801190	Lasalle Bank N.A.
801191	North Fork Bank
801192	Manufacturers & Traders Tc
801193	Bank Of The West
801194	Fifth Third Bank
801195	Northern TC
801196	Goldman Sachs Paris
801197	Citigroup Global Markets, INC

	(Serafi)
76022	Darka
76029	Grupo Especializado en Futuros y Otros Derivados
76043	Timber Hill LLC.
76044	Enlace Derivados
76048	Intercam Derivados
79001	Bancomer Holding-Islas Caimán
79003	Bancomer Transfer Services, Inc.-California, E.U.A.
79004	Bancomer Foreign Exchange, Inc-Delaware, E.U.A.
79005	InterMex Holding, S.A.- Luxemburgo
79006	Euro-American Capital Corporation Limited.- Islas Caimán
79009	Banamex Holding Co.- California, E.U.A.
79010	California Commerce Bank-California, E.U.A.
79012	Banamex-Accival Asset Management Ltd.- República de Irlanda
79013	Banamex-Accival International Fund Plc.- República de Irlanda
79014	Serfin International Bank and Trust - Islas Caimán
79015	Santander Serfin Funds Transfer, Inc., California, E.U.A.
79016	B.I. Financial Holdings Ltd.- Islas Caimán
79017	B.I. Bank and Trust.- Islas Caimán
79018	B.I. Remitances Company.- Islas Caimán
79022	Bancomer Payment Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79023	Bancomer Financial Services, Inc.- Delaware, E.U.A.
79024	CMX International Bank and Trust.- Islas Caimán.
79025	Nacional Financiera S.N.C. Nafinsa Holdings Corp.
79026	Banco Nacional de México, S.A. Banamex USA Bancorp
79027	BBVA Bancomer Financial Holdings Inc.
79028	BBVA Bancomer USA
79029	Dinero Express
79030	Banorte USA Corporation
79031	INB Financial Corp.
79032	INB Delaware Corporation
79033	Inter Nacional Bank
80000	Otras Casas de Bolsa Extranjeras
80001	Acci Securities Incorporated
80004	Afin Securities International Limited
80005	Arka Securities Incorporated
80008	BBVA Bancomer Securities International Inc.
80009	BBVA Bancomer Holdings Corporation
80013	Vectormex Incorporated
80014	Vectormex Global Advisors Incorporated
80015	Vectormex International Incorporated
80019	Valores Finamex Corporation, Inc.
80020	Valores Finamex International Incorporated
80021	Finamex Securities Incorporated
80022	Valores Finamex Limited
80023	Interacciones Global Incorporated
80024	Inter-Financial Services, Limited

801198	Jefferies Group, LLC
801199	UBS Securities, LLC
801200	Evercore, LLC
801201	GMP SECURITIES LLC (Griffiths McBurney)
801202	Santander USA
801203	CME Clearing
801204	Barclays Capital, Inc
801205	BCP Securities, LLC
801206	BTG Pactual US Capital, LLC
801207	Bulltick, LLC
801208	Santander Investment Securities, Inc
801209	Scotia Capital, Inc
801210	Natixis
801211	XP Securities LLC
801212	INTL FCStone
801213	LarrainVial Securities US LLC
801214	HSBC Securities USA
801215	Stone Financial Inc.
801216	ICE Clearing
900000	Otros Mandatarios o Administradores
900001	Schroders Plc.
900002	Blackrock Inc.
900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
900004	Amundi Asset Management
900005	Nomura Holdings, Inc .
900007	Wellington Management Company LLP
900008	Ninety One PLC
900009	Alliance Bernstein
900011	Fidelity International
900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.
900014	Goldman Sachs Asset Management International
900015	Morgan Stanley Investment Management Inc
900016	Vanguard Group
900017	Natixis
900018	WisdomTree Investments, Inc.
900019	State Street Corporation
900020	DWS Investments
900021	Sherpa Capital
900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
900023	FirstTrust
900024	Baillie Gifford
900025	UBS AG
900026	AXA Investment Managers
900027	BNP Paribas Asset Management
900028	GAM Holding AG

80025	Monex Securities Incorporated
80026	Invex Incorporated
80027	GBM International Incorporated
80028	Foreign Holdings Ltd.
80029	Portfolio Investment Incorporated
80030	Arka International, Corp.
80031	BBVA Bancomer Asset Management, Inc.
80032	Banorte Asset Management, Inc.
80033	Afin International Holdings, Inc.
80034	Banorte I, LLC.
80037	Invex International, S.A.
80038	Invex Worldwide, S.A.
80041	Inbursa International, Inc.
80042	Inbursa Securities, Inc.
80043	IXE Holdings, Inc.
82004	Bancomer Oficina de Representación en La Habana, Cuba.
82006	Bancomer Sucursal en Islas Caimán.
82008	Banamex Agencia en Nueva York, N.Y., E.U.A.
82009	Banamex Agencia en Miami, Florida, E.U.A.
82010	Banamex Oficina de Representación en Dusseldorf, Alemania.
82011	Banamex Oficina de Representación en Singapur, Singapur.
82012	Banamex Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82013	Banamex Oficina de Representación en Bogotá, Colombia.
82014	Banamex Oficina de Representación en Taipei
82016	Banamex Sucursal en Nassau, Bahamas.
82025	Internacional Agencia en Tucson, Arizona, E.U.A.
82027	Internacional Oficina de Representación en Buenos Aires, Argentina.
82028	Internacional Oficina de Representación en Madrid, España.
82030	Internacional Sucursal en Islas Caimán
82031	Mercantil del Norte Sucursal en Islas Caimán

900029	Invesco Capital Management
900030	Janus Henderson Investors
900031	Jupiter Asset Management Limited
900032	NN Investment Partners B.V.
900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
900034	Columbia Threadneedle Investments
900035	UTI Asset Management
900036	Nikko Asset Management
900037	Global X
900038	VanEck
900039	KraneShares
900040	ProShares
900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
900043	Acadian Asset Management LLC
900044	Man Group
900045	Berenberg
900046	Finamex
900047	ODDO BHF Asset Management SAS
910000	Otras Bolsas de Derivados
920000	Otros Socios Operadores
930000	Otros Socios Liquidadores
940000	Otras Cámaras de Compensación
950000	Otras Plataformas Electrónicas de Negociación
950001	Allfunds Bank, S.A.U.
950002	Fundvest, Pershing LLC
950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB

Catálogo de Aviso de Reconposición	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
0	No aplica reconposición
1	En caso de encontrarse en proceso de reconposición se opta por conservar el instrumento
2	En caso de encontrarse en proceso de reconposición se opta por vender el instrumento

Catálogo de Tipo de Depósito	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
1	Depósitos en instituciones financieras
2	Depósitos con custodios
3	Depósitos con socios liquidadores (excedentes de aportaciones iniciales mínimas de derivados listados)
4	Depósitos en cámara de compensación (aportaciones iniciales mínimas de derivados listados).
5	Depósitos en garantía por derivados OTC

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO**

**Validaciones para formato de los datos**

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

<sup>7</sup> El valor de mercado del reporto se deberá calcular conforme a lo siguiente:

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

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

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

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

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

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

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

<sup>9</sup> El tipo de cambio será el correspondiente a Divisa/Peso Mexicano.

<sup>10</sup> Hora. El formato para la hora ser de 4 caracteres numéricos = "HHMM" donde:

HH = hora

MM = min

El huso horario, será el de la hora del centro de México.

<sup>11</sup> El Activo Total de la Sociedad de Inversión será el definido por la Circular CONSAR serie 15 vigente.

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

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

#### **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

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

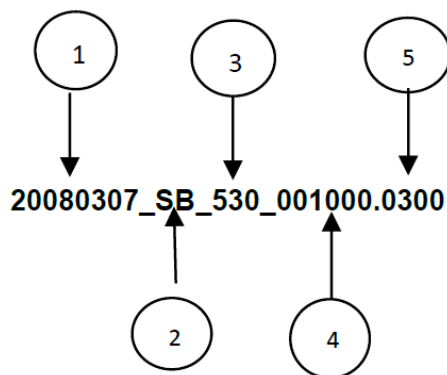
- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.
- III. Las entidades responsables de transmitir este formato a la Comisión son las Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social.
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:
  - 1° ISIN, de no existir éste,
  - 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,
  - 3° SEDOL.Por lo menos se deberá reportar uno de los tres identificadores anteriores, salvo en instrumentos provenientes de operaciones primarias, pendientes de liquidar, en donde estos identificadores aún no sean asignados y por tanto no existan.
- VI. En el caso de Tipo de Valor, Emisora, Serie y Consecutivo se llenarán los campos usando el valor asignado por el proveedor de precios sin contraponerse a las indicaciones de cada campo; de lo contrario se anotará un CERO y espacios en blanco.
- VII. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.

VIII. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCION
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad anexo al documento.
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidad Siefores Básicas, Siefores de Aportaciones Voluntarias, Siefores de Aportaciones Complementarias y Siefores de Previsión Social que se reporta conforme al catálogo de entidades anexo al documento
4	6 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFORES.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0300"</b> .

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

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



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

**20080307\_SB\_530\_001000.0300.gpg**

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

**A20080307\_SB\_530\_001000.0300**

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

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

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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





FORMATO DEL ARCHIVO : 0339

PROCESO : FINANCIERO

FUENTE : AMAFORE

ACTUALIZACIÓN:

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	369	DE 7:00 hrs a 10:00 hrs.

**ENCABEZADO**

**ENCABEZADO:** Contiene información sobre las características del formato

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de registros		N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro		N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = <b>Constante "369"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0339"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = <b>Constante "005"</b> . <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Asociaciones), anexos. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	27	34	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	335	0	35	369	Vacios. <sup>5</sup>

**SUBENCABEZADO**

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "101"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Vehículo		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada Vehículo, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	ISIN Vehículo		AN	12	0	14	25	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo reportado. <sup>6</sup>
4	CUSIP O CINS Vehículo		AN	9	0	26	34	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Vehículo reportado. <sup>7</sup>
5	SEDOL Vehículo		AN	7	0	35	41	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Vehículo reportado. <sup>8</sup>
6	Clave Vehículo		AN	10	0	42	51	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Vehículo reportado. <sup>4</sup>
7	Ticker Bloomberg Vehículo		AN	20	0	52	71	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Vehículo reportado. <sup>9</sup>
8	Ticker Reuters Vehículo		AN	20	0	72	91	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Vehículo reportado. <sup>10</sup>
9	ID del Patrocinador		N	3	0	92	94	Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Patrocinadores". <sup>1</sup>
10	Tipo de Vehículo		N	2	0	95	96	Se deberá reportar el identificador del tipo de Vehículo que corresponda considerando su naturaleza preponderante según el "Catálogo de

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								Tipos de Vehículo". <sup>1</sup>
11	Nombre descriptivo Vehículo		AN	60	0	97	156	Se deberá anotar un nombre descriptivo del Vehículo reportado. <sup>4</sup>
12	Valor del Vehículo		N	10	6	157	172	Se deberá reportar el valor a mercado del Vehículo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>1</sup>
13	Divisa de Cotización		N	2	0	173	174	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
14	Espacios en blanco		AN	195	0	175	369	Vacios. <sup>5</sup>

## DETALLE(S)

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ID Componente		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Tipo de Activo		N	2	0	14	15	Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo". <sup>1</sup>
4	Tipo de Activo Subyacente		N	2	0	16	17	En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00". <sup>4</sup>
5	ISIN		AN	12	0	18	29	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado. <sup>6</sup>
6	CUSIP O CINS		AN	9	0	30	38	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado. <sup>7</sup>
7	SEDOL		AN	7	0	39	45	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado. <sup>8</sup>
8	Clave		AN	10	0	46	55	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado. <sup>4</sup>
9	Ticker Bloomberg		AN	20	0	56	75	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al componente reportado. <sup>9</sup>
10	Ticker Reuters		AN	20	0	76	95	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al componente reportado. <sup>10</sup>
11	Nombre descriptivo del componente		AN	50	0	96	145	Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado. <sup>4</sup>
12	ISIN subyacente		AN	12	0	146	157	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>6</sup>
13	CUSIP O CINS subyacente		AN	9	0	158	166	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>7</sup>
14	SEDOL subyacente		AN	7	0	167	173	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>8</sup>
15	Clave subyacente		AN	10	0	174	183	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave de

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
16	Ticker Bloomberg subyacente		AN	20	0	184	203	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>9</sup>
17	Ticker Reuters subyacente		AN	20	0	204	223	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>10</sup>
18	Nombre descriptivo subyacente		AN	50	0	224	273	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
19	País		N	2	0	274	275	En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países. <sup>1</sup>
20	Nombre País		AN	20	0	276	295	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos <sup>4</sup>
21	Mercado		AN	4	0	296	299	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
22	País Regulador		N	2	0	300	301	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países. <sup>1</sup>
23	Nombre País Regulador		AN	20	0	302	321	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En otro caso se deberán reportar espacios vacíos <sup>4</sup>
24	Divisa de cotización		N	2	0	322	323	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
25	Clave divisa		AN	3	0	324	326	En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
26	Sector		AN	20	0	327	346	Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo. <sup>4</sup>
27	Influencia		N	3	6	347	355	Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del vehículo, medido en puntos porcentuales. <sup>1</sup>
28	Calificadora Componente primera		N	3	0	356	358	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
29	Calificación Homologada del Componente primera		N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000 <sup>1</sup>
30	Calificadora Componente segunda		N	3	0	363	365	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
31	Calificación Homologada del Componente segunda		N	4	0	366	369	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>

**CATÁLOGO(S)**

Catálogo de Tipos de Entidades		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
001	ADMINISTRADORAS	AF
002	SIEFORES BÁSICA	SB
003	SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS	AC
004	SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL	PS
005	ASOCIACIONES	AS
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
012	ENTIDAD RECEPTORA	ER
013	BANXICO	BX
014	PRESTADORAS DE SERVICIO	PS
017	SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS	AV
018	INDEVAL	ID
019	CUSTODIOS	CS
020	INSTITUTOS	IN
030	VECTORES	VE

**Catálogo de Entidad (Asociaciones)**

Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
003	Asociación Mexicana de Afores	AMAFORE

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

Catálogo de Tipos de Activo	
Identificador	Descripción
00	No aplica
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Vehículo Inmobiliario
05	Instrumentos Financieros Derivados
99	Otro

Catálogo de Tipos de Activos subyacentes	
Identificador	Descripción
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Vehículo Inmobiliario
05	Divisas
99	Otro

Catálogo de Tipos de Vehículo	
Identificador	Descripción
01	Accionario
02	Inmobiliario
03	Mercancías
04	Renta Fija
05	Mixto
99	Otro

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	27	Hungría
2	Australia	28	Letonia
3	Austria	29	Lituania
4	Bélgica	30	Malta
5	Canadá	31	República Checa
6	Dinamarca	32	Suecia
7	España	33	Brasil
8	Estados Unidos de Norteamérica	34	China
9	Finlandia	35	India
10	Francia	36	Otro
11	Grecia	37	Rumanía
12	Países Bajos (Holanda)	38	Noruega
13	Hong Kong	39	Chile
14	Irlanda	40	Israel
15	Italia	41	Bulgaria
16	Japón	42	Colombia
17	Luxemburgo	43	Corea del Sur
18	México	44	Islandia
19	Polonia	45	Perú
20	Portugal	46	Singapur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	47	Malasia
22	Suiza	48	Nueva Zelanda
23	Chipre	49	Sudáfrica
24	Eslovaquia	50	Tailandia
25	Eslovenia	51	Taiwán
26	Estonia		

Catálogo de Patrocinadores	
Identificador	Descripción
000	Otro
001	BlackRock, Inc.
002	Barclays
003	JP Morgan
004	Morningstar
005	State Street
006	Vanguard
007	WisdomTree
008	Van Eck
009	First Trust
010	InvescoPowerShares

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México
99	Otra	

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			<b>HR D</b>			<b>1056</b>
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045

CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048
D	D	D	HR D (G)		D	1049
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Global</b>						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

<sup>6</sup> ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

1 y 2: corresponden al prefijo del país.

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

<sup>7</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

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



<sup>8</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

<sup>9</sup> El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de SFTP, a la carpeta AMAFORE/RECEPCION
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos aprobados (AMAFORE).
- I. Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

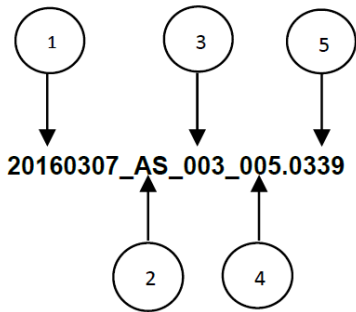
Tipo de Acción	Descripción
Envío Normal SFTP	/AMAFORE/RECEPCION
Recuperación de Acuse	/AMAFORE/TRANSMISION

II. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. <b>Constante = "AS"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que reporta <b>Constante = "005"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0339</b> .

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


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



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

**A20160307\_AS\_003\_005.0339**






## Anexo 119

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	<b>0340</b>	<b>PROCESO :</b>	<b>FINANCIERO</b>
	<b>FUENTE : AMAFORE</b>		<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	



DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información de la descomposición de índices accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	369	DE 7:00 hrs a 10:00 hrs.

## ENCABEZADO

ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato de transmisión

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de registros		N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro		N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = Constante "369". <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0340". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = Constante "005". <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (Asociaciones), anexos. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	27	34	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	335	0	35	369	Vacios. <sup>5</sup>











## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	ID índice		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada índice, y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	ISIN índice		AN	12	0	14	25	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del índice reportado. <sup>5</sup>
4	CUSIP O CINS índice		AN	9	0	26	34	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS índice reportado. <sup>7</sup>
5	SEDOL índice		AN	7	0	35	41	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del índice reportado. <sup>8</sup>
6	Clave índice		AN	10	0	42	51	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del índice reportado. <sup>4</sup>
7	Ticker Bloomberg índice		AN	20	0	52	71	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice reportado. <sup>9</sup>
8	Ticker Reuters índice		AN	20	0	72	91	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al índice reportado. <sup>10</sup>

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
9	ID del Patrocinador		N	3	0	92	94	Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Patrocinadores". <sup>1</sup>
10	Tipo de Índice		N	2	0	95	96	Se deberá reportar el identificador del tipo de índice que corresponda considerando su naturaleza preponderante, según el "Catálogo de Tipos de Índice". <sup>1</sup>
11	Nombre descriptivo índice		AN	60	0	97	156	Se deberá anotar un nombre descriptivo del índice reportado. <sup>4</sup>
12	Valor del Índice		N	10	6	157	172	Se deberá reportar el valor en puntos del índice al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>1</sup>
13	Divisa del Índice		N	2	0	173	174	Se deberá reportar el identificador de la divisa asociada al índice reportado de conformidad con el "Catálogo de Divisa" <sup>1</sup>
13	Espacios en blanco		AN	195	0	175	369	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE(S)**

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al índice del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del índice. El nivel de descomposición de cada uno de los índices debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ID Componente		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Tipo de Activo		N	2	0	14	15	Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo". <sup>1</sup>
4	Tipo de Activo Subyacente		N	2	0	16	17	En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00". <sup>4</sup>
5	ISIN		AN	12	0	18	29	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado. <sup>6</sup>
6	CUSIP O CINS		AN	9	0	30	38	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado. <sup>7</sup>
7	SEDOL		AN	7	0	39	45	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado. <sup>8</sup>
8	Clave		AN	10	0	46	55	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado. <sup>4</sup>
9	Ticker Bloomberg		AN	20	0	56	75	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al componente reportado. <sup>9</sup>
10	Ticker Reuters		AN	20	0	76	95	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al componente reportado. <sup>10</sup>
11	Nombre descriptivo del componente		AN	50	0	96	145	Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado. <sup>4</sup>
12	ISIN subyacente		AN	12	0	146	157	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>6</sup>
13	CUSIP O CINS subyacente		AN	9	0	158	166	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>7</sup>

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al índice del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del índice. El nivel de descomposición de cada uno de los índices debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
14	SEDOL subyacente		AN	7	0	167	173	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>8</sup>
15	Clave subyacente		AN	10	0	174	183	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
16	Ticker subyacente Bloomberg		AN	20	0	184	203	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>9</sup>
17	Ticker Reuters subyacente		AN	20	0	204	223	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>10</sup>
18	Nombre subyacente descriptivo		AN	50	0	224	273	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
19	País		N	2	0	274	275	En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países. <sup>1</sup>
20	Nombre País		AN	20	0	276	295	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
21	Mercado		AN	4	0	296	299	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
22	País Regulador		N	2	0	300	301	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, e deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "0" del catálogo de países. <sup>1</sup>
23	Nombre País Regulador		AN	20	0	302	321	En caso de En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 99, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En otro caso se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>

**DETALLE 1:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al índice del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del índice. El nivel de descomposición de cada uno de los índices debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
24	Divisa de cotización		N	2	0	322	323	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
25	Clave divisa		AN	3	0	324	326	En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
26	Sector		AN	20	0	327	346	Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo. <sup>4</sup>
27	Influencia		N	3	6	347	355	Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del índice, medido en puntos porcentuales. <sup>1</sup>
28	Calificadora Componente primera		N	3	0	356	358	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
29	Calificación Homologada del Componente primera		N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000 <sup>1</sup>
30	Calificadora Componente segunda		N	3	0	363	365	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segundo" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
31	Calificación Homologada del Componente segunda		N	4	0	366	369	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>

#### CATÁLOGO(S)

Catálogo de Tipos de Entidades		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
001	ADMINISTRADORAS	AF
002	SIEFORES BÁSICA	SB
003	SIEFORES APORTACIONES COMPLEMENTARIAS	AC
004	SIEFORES PREVISIÓN SOCIAL	PS
005	ASOCIACIONES	AS
007	EMPRESAS OPERADORAS	EO
012	ENTIDAD RECEPTORA	ER
013	BANXICO	BX
014	PRESTADORAS DE SERVICIO	PS
017	SIEFORES DE APORTACIONES VOLUNTARIAS	AV
018	INDEVAL	ID
019	CUSTODIOS	CS
020	INSTITUTOS	IN
030	VECTORES	VE

Catálogo de Entidad (Asociaciones)		
Clave Tipo de Entidad	Descripción	Abreviación
003	Asociación Mexicana de Afores	AMAFORE

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

Catálogo de Tipos de Activo	
Identificador	Descripción
00	No aplica
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Vehículo Inmobiliario
05	Instrumentos Financieros Derivados
99	Otro

Catálogo de Tipos de Activos Subyacentes	
Identificador	Descripción
00	No aplica
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Vehículo Inmobiliario
05	Divisas
99	Otro

Catálogo de Tipos de Índice	
Identificador	Descripción
01	Accionario
02	Inmobiliario
03	Mercancías
04	Renta Fija
05	Mixto
99	Otro

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	27	Hungría
2	Australia	28	Letonia
3	Austria	29	Lituania
4	Bélgica	30	Malta
5	Canadá	31	República Checa
6	Dinamarca	32	Suecia
7	España	33	Brasil
8	Estados Unidos de Norteamérica	34	China
9	Finlandia	35	India
10	Francia	36	Otro
11	Grecia	37	Rumanía
12	Países Bajos (Holanda)	38	Noruega
13	Hong Kong	39	Chile
14	Irlanda	40	Israel
15	Italia	41	Bulgaria
16	Japón	42	Colombia
17	Luxemburgo	43	Corea del Sur
18	México	44	Islandia
19	Polonia	45	Perú
20	Portugal	46	Singapur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	47	Malasia
22	Suiza	48	Nueva Zelanda
23	Chipre	49	Sudáfrica
24	Eslovaquia	50	Tailandia
25	Eslovenia	51	Taiwán
26	Estonia		

Catálogo de Patrocinadores	
Identificador	Descripción
000	Otro
001	BMV
002	MSCI Barra
003	Barclays
004	JP Morgan
005	Morningstar
006	Vanguard
007	WisdomTree
008	S&P Dow Jones
009	Nasdaq
010	Stoxx
011	FTSE
012	CreditSuissePowered by Holt
013	BNY Mellon
014	Center for Research in Security Prices
015	Russell
016	Keefe, Bruyette and Woods

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México
99	Otra	

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local</b>						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Local</b>						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			HR D			1056
<b>Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global</b>						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045
CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048
D	D	D	HR D (G)		D	1049
<b>Calificaciones Corto Plazo en Escala Global</b>						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055



## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

<sup>6</sup> ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

1 y 2: corresponden al prefijo del país.

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

<sup>7</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

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

<sup>8</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

<sup>9</sup> El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de SFTP, a la carpeta AMAFORE/RECEPCION
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos aprobados (AMAFORE).
- I. Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

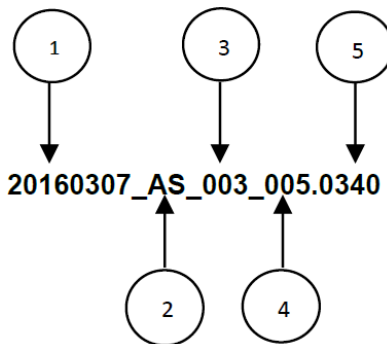
Tipo de Acción	Descripción
Envío Normal SFTP	/AMAFORE/RECEPCION
Recuperación de Acuse	/AMAFORE/TRANSMISION

II. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. <b>Constante = "AS"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los primeros tres números de la Clave de Entidad que se reporta,
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a los tres últimos números de la Clave del Tipo de Entidad que reporta <b>Constante = "005"</b> .
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0340</b> .

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


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



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

**A20160307\_AS\_003\_005.0340**

Anexo 121

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	<b>0341</b>	<b>PROCESO :</b>	<b>FINANCIERO</b>
	<b>FUENTE : AFORE</b>		<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	





DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.-</b> Este archivo contiene información de los funcionarios adscritos a las áreas que realizan actividades y labores en materia financiera dentro de las Sociedades de inversión, así como el detalle de las certificaciones en materia financiera que poseen dichos funcionarios.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
TRIMESTRAL	Último día hábil de los meses de marzo, junio, septiembre y diciembre.	522	07:00 a 18:00 Hrs.

**ENCABEZADO**


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Tipo de Archivo		N	4	0	4	7	Identificador de archivo = <b>Constante "0341"</b> . <sup>1</sup>
3	Tipo de Entidad		N	3	0	8	10	Clave de Tipo de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, <b>Constante = "001"</b> . <sup>1</sup>
4	Entidad		N	3	0	11	13	Clave de Entidad que reporta la Información, de acuerdo con el Catálogo de Entidades (AFORES) anexo. <sup>1</sup>
5	Fecha de Información		F	8	0	14	21	Fecha de la información, la cual será el penúltimo día hábil del trimestre que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tamaño del Registro		N	3	0	22	24	Número de caracteres por registro = <b>Constante "522"</b> . <sup>1</sup>
7	Número de Registros		N	5	0	25	29	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	493	0	30	522	Vacios. <sup>6</sup>

**SUBENCABEZADO**

En este subencabezado, se deberá reportar la información relativa a cada cargo o puesto contemplado en los procesos de inversión en la estructura de la Administradora.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "101"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Cargo		N	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador numérico definido por la Administradora, que sea único para cada puesto, y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>1</sup>
3	Cargo		AN	80	0	14	93	Se deberá reportar el nombre del cargo o puesto. <sup>5</sup>
4	Descripción del Cargo		AN	255	0	94	348	Se deberá reportar una breve descripción de las responsabilidades asociadas al cargo o puesto. <sup>5</sup>
5	Área		N	2	0	349	350	Se deberá reportar la Clave de Área a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Áreas. <sup>1</sup>
6	Nombre Área		AN	80	0	351	430	En caso de que se reporte el identificador "99 - Otras áreas de la Administradora" en el campo "Área", se deberá reportar el nombre del Área a la que pertenece el cargo o puesto. <sup>5</sup>
7	Subárea		N	2	0	431	432	Se deberá reportar la Clave de la Subárea a la que pertenece el cargo, de acuerdo con el Catálogo de Subáreas. En caso de que aplique más de una subárea se deberá reportar el identificador "99 - Otras subáreas de la Administradora". <sup>1</sup>

En este subencabezado, se deberá reportar la información relativa a cada cargo o puesto contemplado en los procesos de inversión en la estructura de la Administradora.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
8	Nombre Subárea		AN	80	0	433	512	En caso de que se reporte el identificador "99 - Otras subáreas de la Administradora" en el campo "Subárea", se deberá reportar el nombre de la subárea, o en su caso nombres de las subáreas, a que pertenece el cargo o puesto. <sup>5</sup>
9	ID Cargo del cargo de quien depende		AN	10	0	513	522	Se deberá reportar el "ID Cargo" correspondiente al cargo al cual reporta, o del cual depende directamente en dirección vertical en la estructura de la Administradora. Únicamente para el caso de cargos o puestos que no dependan directamente de otro cargo dentro de la estructura de la Administradora, como el Director General o el Contralor Normativo, este campo se deberá reportar vacío de conformidad con las especificaciones del mismo. <sup>5</sup>

#### DETALLES

**DETALLE 1:** En este detalle se deberá reportar la información del funcionario que ocupa el cargo o puesto reportado en el subencabezado del presente formato.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "301"</b> . <sup>1</sup>
2	ID funcionario		N	10	0	4	13	Se deberá anotar un identificador único por funcionario definido por la Administradora, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo. <sup>1</sup>
3	Nombre		AN	40	0	14	53	Se deberá anotar el nombre del funcionario. <sup>5</sup>
4	Apellido Paterno		AN	40	0	54	93	Se deberá anotar el apellido paterno del funcionario. <sup>5</sup>
5	Apellido Materno		AN	40	0	94	133	Se deberá anotar el apellido materno del funcionario. <sup>5</sup>
6	Correo Electrónico Institucional		AN	50	0	134	183	Se deberá anotar el correo electrónico institucional del funcionario. <sup>5</sup>
7	Fecha de ingreso al cargo		F	8	0	184	191	Se deberá reportar la fecha en la que se tomó posesión del cargo. <sup>3</sup>
8	Fecha de ingreso a la Administradora		F	8	0	192	199	Se deberá reportar la fecha de ingreso del funcionario a la Administradora. <sup>3</sup>
9	Espacios en blanco		AN	323	0	200	522	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de las certificaciones que posee el funcionario ocupante del puesto o cargo.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de archivo = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>
2	ID funcionario		N	10	0	4	13	Se deberá anotar un identificador único por funcionario definido por la Administradora, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID funcionario" del "DETALLE 1". <sup>2</sup>
3	Tipo de Certificación		N	2	0	14	15	Se deberá reportar el identificador correspondiente al tipo de certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo Tipos de Certificaciones. <sup>1</sup>
4	Certificación		N	2	0	16	17	Se deberá reportar el identificador correspondiente a la Certificación que se reporta, de acuerdo con el Catálogo de Certificaciones. <sup>1</sup>
5	Identificador Certificación		AN	50	0	18	67	Se deberá reportar el número o clave de identificación otorgada por la institución certificadora al funcionario, como por ejemplo, el "CFA Institute ID", otorgado por CFA a sus aplicantes. <sup>5</sup>
6	Fecha de emisión de la certificación		F	8	0	68	75	Se deberá reportar la fecha de emisión de la certificación reportada. <sup>3</sup>
7	Fecha fin vigencia		F	8	0	76	83	Se deberá reportar la fecha de fin de la vigencia de la certificación reportada. Para el caso de las certificaciones concluidas con vigencia permanente se deberá llenar con ceros. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	439	0	84	522	Vacios. <sup>6</sup>

**CATÁLOGO (S)**

Catálogo de Entidades (AFORES)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
530	XXI Banorte
534	Profuturo
538	Principal
544	SURA
550	Inbursa
552	Citibanamex
556	Azteca
562	Invercap
568	Coppel
578	PensionISSSTE

Catálogo de Áreas	
Identificador	Descripción
01	Dirección General
02	Contraloría Normativa del proceso de Inversiones
03	Inversiones
04	Riesgos
05	Administración y Finanzas
99	Otras áreas de la Administradora

Catálogo de Subáreas	
Identificador	Descripción
01	Dirección General
02	Contraloría Normativa del proceso de Inversiones
03	Operación de Instrumentos Derivados
04	Inversiones Alternativas
05	Inversiones en Renta Fija
06	Inversiones en Renta Variable
07	Riesgo Mercado
08	Riesgo Crédito
09	Riesgo Liquidez
10	Riesgo Operativo
11	Confirmación
12	Liquidación
13	Contabilidad
14	Compliance y control interno
15	Custodia gestionada por la Administradora
16	Tesorería Siefors
17	Tecnologías de la Información del proceso de inversiones (TI)
18	Área de inversiones (sólo aplica al responsable de inversiones)
19	UAIR (sólo aplica al responsable de riesgos)
99	Otras subáreas de la Administradora

Catálogo Tipos de Certificación	
Identificador	Descripción
01	Certificación general en materia financiera
02	Certificación para operaciones con Derivados
03	Certificación de Funcionarios para Instrumentos Estructurados
04	Certificación general en materia ASG
05	Refrendo a Certificación general en materia financiera
06	Refrendo a Certificación para operaciones con Derivados
07	Refrendo a Certificación de Funcionarios para Instrumentos Estructurados

Catálogo Certificación	
Identificador	Descripción
00	Certificación genérica en materia de inversiones (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
01	Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 1
02	Chartered Financial Analyst (CFA) Nivel 2
03	Chartered Financial Analyst (CFA)
04	Financial Risk Manager (FRM-GARP) Nivel 1
05	Financial Risk Manager (FRM-GARP)
06	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 2 Exámenes
07	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA) 3 Exámenes
08	Professional Risk Manager (PRM-PRMIA)

Catálogo Certificación	
Identificador	Descripción
09	Associate of the Society of Actuaries (ASA) 3 Exámenes
10	Associate of the Society of Actuaries (ASA) 3
11	Fellow of the Society of Actuaries (FSA): Especialización en Quantitative Finance and Investment (QFI)
12	Claritas Investment Certificate (aplicado por CFA Institute) o The CFA Institute Investment Foundations
13	Certificación en Derivados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
14	Certificación en Instrumentos Estructurados (Publicadas en la página de Internet de la Comisión)
15	Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) Nivel 1
16	Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA)
17	<b>Certified Environmental Social and Governance Analyst (CESGA)</b>
18	<b>Certificate in ESG Investing CFA Institute</b>
19	<b>GARP's Sustainability and Climate Risk (SCR)</b>
99	<b>Otros</b>

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

#### POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

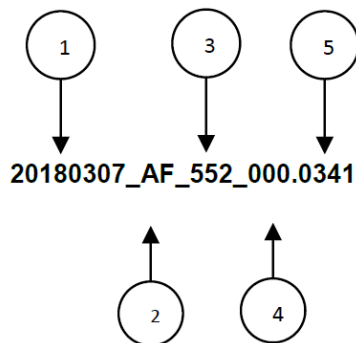
- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

- III. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GnuPG.
- VI. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, <b>Constante = "AF"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la clave tipo de entidad que se reporta conforme al catálogo de Entidades AFORES anexo al documento.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será <b>Constante = "000"</b> )
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0341"</b> .

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

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



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

**20180307\_AF\_552\_000.0341.gpg**

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

**A20180307\_AF\_552\_000.0341**

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


- VII. Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:






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

## Anexo 123






	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	<b>0343</b>	<b>PROCESO :</b>	<b>FINANCIERO</b>
	<b>FUENTE : AFORE</b>		<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene información de los instrumentos eEstructurados en los que invierten los fondos que administra la AFORE, con la información acumulada al cierre del trimestre anterior al de la entrega del formato.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
TRIMESTRAL	Último día hábil de los meses de marzo, junio, septiembre y diciembre.	506	De 07:00 a 18:00 Hrs.

## ENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de registros		N	5	0	4	8	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "506"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0343"</b> . <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	16	18	Clave de Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, <b>Constante = "001"</b> . <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	19	21	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidades (AFORES), anexo. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	22	29	Fecha de la Información al último día hábil del trimestre que se reporta. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	477	0	30	506	Vacios. <sup>6</sup>

## SUBENCABEZADO

<b>SUBENCABEZADO:</b> En este subencabezado se deberán reportar los datos de identificación de los instrumentos Estructurados en los que invierten los fondos que administra la AFORE.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "101"</b> . <sup>1</sup>
2	ISIN Instrumento Estructurado		AN	12	0	4	15	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Instrumento Estructurado reportado. <sup>7</sup>
3	Tipo Valor		AN	4	0	16	19	Clave que le otorgue al tipo de valor el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado. <sup>5</sup>
4	Emisora		AN	7	0	20	26	Clave que le otorgue a la emisora el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado. <sup>5</sup>
5	Serie		AN	7	0	27	33	Clave que le otorgue a la serie el proveedor de precios al Instrumento Estructurado reportado. <sup>5</sup>
6	Ticker Bloomberg del Instrumento Estructurado		AN	20	0	34	53	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Instrumento Estructurado que es reportado. <sup>10</sup>
7	Ticker Reuters de Instrumento Estructurado		AN	20	0	54	73	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Instrumento Estructurado reportado. <sup>11</sup>
8	Espacios en blanco		AN	433	0	74	506	Vacios. <sup>6</sup>





DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información general del Instrumento Estructurado reportado en subcabezado.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Nombre del Administrador del Instrumento Estructurado		AN	70	0	4	73	Se deberá anotar la razón social correspondiente al Administrador del Instrumento Estructurado reportado. <sup>5</sup>
3	Grupo al que pertenece el Administrador		AN	70	0	74	143	En caso de que el Administrador del Instrumento Estructurado pertenezca a un Grupo Financiero o empresarial en este campo se reportará la razón social de dicho Grupo. <sup>5</sup>
4	Nombre del Fiduciario del Instrumento Estructurado		N	3	0	144	146	Se deberá anotar el identificador de la razón social correspondiente al Fiduciario del Instrumento Estructurado, según el "Catálogo de fiduciarios". <sup>1</sup>
5	Representante común del Instrumento Estructurado		N	3	0	147	149	Se reportará el identificador de la razón social del Representante Común del Instrumento Estructurado, según el "Catálogo de Representante Común". <sup>1</sup>
6	Monto máximo de la emisión del Instrumento Estructurado		N	15	2	150	166	Se deberá anotar el monto máximo en pesos de la emisión del Instrumento Estructurado reportado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato. <sup>2</sup>
7	Monto máximo de la emisión en la divisa del Instrumento Estructurado		N	15	2	167	183	Se deberá anotar el monto máximo de la emisión en la divisa del Instrumento Estructurado reportado. <sup>2</sup>
8	Divisa		N	2	0	184	185	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se emitió el Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Divisa" anexo. Cuando no exista identificador para la divisa del Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente. <sup>1</sup>
9	Llamadas de capital <u>y/o derechos de suscripción</u> del Instrumento Estructurado		N	1	0	186	186	Se deberá reportar 1 si el Instrumento Estructurado está sujeto a llamadas de capital y/o derechos de suscripción. En otro caso se deberá anotar 0. <sup>1</sup>
10	Capital llamado del Instrumento Estructurado		N	15	2	187	203	Se reportará el monto total llamado en pesos del Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato. Deberá ser la suma del monto colocado inicialmente más las llamadas de capital y/o derechos de suscripción realizadas por el Instrumento Estructurado y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. <sup>2</sup>
11	Cantidad de títulos en Circulación		N	15	0	204	218	Se reportará el número de títulos en circulación del Instrumento Estructurado (en unidades). <sup>1</sup>
12	Estrategia Preponderante		N	2	0	219	220	Se reportará el sector de la estrategia preponderante de inversión del Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Estrategia Preponderante" determinada con el Monto Invertido de los proyectos o inversiones a la fecha reportada, sin considerar la revaluación de los mismos. Cuando no exista identificador para el sector preponderante de inversión del Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Estrategia Preponderante" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector de la estrategia preponderante. <sup>1</sup>
13	Fecha de Emisión		F	8	0	221	228	Fecha de la emisión del Instrumento Estructurado operado. <sup>3</sup>
14	Tipo de Instrumento Estructurado		N	2	0	229	230	Se reportará el tipo de Instrumento Estructurado según "Catálogo Tipo de Instrumento Estructurado". <sup>1</sup>
15	Valuador Independiente		N	2	0	231	232	Se reportará al valuador independiente de la valuación del instrumento reportada en el periodo según "Catálogo de Valuador Independiente". Cuando no exista identificador para el valuador independiente en el "Catálogo de Valuador Independiente" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el nombre del valuador independiente. <sup>1</sup>

**DETALLE 1:** En este detalle se deberá reportar la información general del Instrumento Estructurado reportado en subcabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
16	Serie adicional u optativa		N	1	0	233	233	Si el Instrumento Estructurado corresponde a una serie subsecuente, adicional u optativa de otro Instrumento Estructurado anotar 1. En otro caso se deberá anotar 0. <sup>1</sup>
17	Identificador del Instrumento Estructurado del que es serie adicional		AN	18	0	234	251	Si se indica "1" en el campo "Serie adicional u optativa", entonces en este campo se debe poner el Tipo de Valor, Emisora y Serie del Instrumento Estructurado del que es serie adicional o el primer instrumento estructurado administrado bajo el mismo fideicomiso, respetando el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. En otro caso se deberá llenar con espacios. <sup>5</sup>
18	Observaciones		AN	255	0	252	506	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos de Divisa, Estrategia Preponderante o del Valuador Independiente. <sup>5</sup>



**DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los proyectos o inversiones en los que participa el instrumento reportado en el subcabezado, así como los proyectos o inversiones desinvertidos y los recursos que no han sido invertidos, a la fecha de información.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "302"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Inversión		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar un identificador definido por la Administradora, que sea único para cada proyecto de inversión reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>5</sup> Se deberá considerar cualquier proyecto de inversión, incluyendo los que se encuentren en fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar). El detalle de la composición de estos fondos se reportará en el "Detalle 3" que se presenta más adelante.
3	Identificador de la inversión		AN	18	0	14	31	En caso de que se trate de cuentas de depósito o activos financieros o valores que sean objeto de oferta pública, este campo se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del activo financiero o valor en que el Instrumento Estructurado tenga inversiones, de esta manera se respetarán el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. Para el caso de reportos, este campo se conformará del Tipo de Valor, Emisora y Serie del activo financiero objeto de la operación de reporto al cierre de la fecha de información, respetando el formato de cuatro posiciones para el tipo valor, siete posiciones para la emisora y siete posiciones para la serie. Para el caso de depósitos en efectivo en pesos se deberá considerar que el tipo valor para estos depósitos es "EF", la emisora es "EFECTIV" y la serie "990101". Para el caso de depósitos en efectivo en divisas distintas al peso, se deberá considerar el tipo de valor, emisora y series asignados por el proveedor de precios a la divisa del depósito. En otro caso se deberá llenar con espacios. <sup>5</sup>
4	ISIN del instrumento en que el Instrumento Estructurado tiene inversión		AN	12	0	32	43	En caso de que exista, en particular en el caso de instrumentos objeto de oferta pública, se deberá anotar la clave del ISIN del activo financiero en el que el Instrumento Estructurado mantenga inversiones. En caso de reportos, se deberá anotar la clave del ISIN del activo financiero objeto de la operación de reporto. <sup>7</sup>
5	Empresa o proyecto promovido		AN	70	0	44	113	Se deberá anotar la razón social de la empresa o nombre del proyecto en donde se realizó la inversión. En el caso de instrumentos objeto de oferta pública, se deberá anotar el nombre del emisor o contraparte. En caso de que la inversión sea en un fondo de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) se deberá anotar el nombre del fondo en el que participan y la empresa que lo administra. En caso de que se trate de cuentas de depósito (Fondos de inversión de deuda, reportos, activos financieros de deuda gubernamental, etc.) se deberá anotar "Inversión Permitida o Temporal" <sup>5</sup> .

**DETALLE 2:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los proyectos o inversiones en los que participa el instrumento reportado en el subencabezado, así como los proyectos o inversiones desinvertidos y los recursos que no han sido invertidos, a la fecha de información.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
6	Tipo de proyecto de inversión		N	2	0	114	115	Se deberá anotar el tipo de proyecto de inversión que ha realizado el Instrumento Estructurado según el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión". Cuando no exista identificador para el proyecto de inversión en el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el tipo de proyecto de inversión del que se trate. <sup>1</sup>
7	Sector		N	2	0	116	117	Se deberá anotar el sector al que pertenece la empresa o proyecto promovido o financiado según el "Catálogo Sectorial". Cuando no exista identificador para el sector al que pertenece la empresa o proyecto promovido en el "Catálogo Sectorial" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector al que pertenece. En caso de que se trate de cuentas de depósito se deberá anotar el indicador "00" del "Catálogo Sectorial". <sup>1</sup>
8	Monto Total Invertido		N	10	2	118	129	Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos <sup>22</sup>
9	Monto considerando la valuación independiente		N	10	2	130	141	Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato tomando en cuenta el valor actualizado por efecto de valuación. <sup>2</sup>
10	Participación del Instrumento Estructurado en el proyecto de inversión		N	3	2	142	146	Porcentaje de participación del Instrumento Estructurado en la empresa o proyecto promovido. <sup>2</sup>
11	Participación del proyecto en el Instrumento Estructurado		N	3	2	147	151	Porcentaje de participación destinado a la empresa o proyecto promovido relativo al Monto Máximo de la Emisión (MME) del Instrumento Estructurado. <sup>2</sup>
12	Divisa		N	2	0	152	153	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se realizan la inversión en la empresa o proyecto promovido según el "Catálogo de Divisa". Cuando no exista identificador para la divisa en que se realiza la inversión en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente. <sup>1</sup>
13	País		N	2	0	154	155	Se deberá anotar el País preponderante al que está siendo destinada la inversión según el "Catálogo de Países". Cuando no exista identificador para el país al que está siendo destinada la inversión en el "Catálogo de Países" se deberá utilizar el indicador "36" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el país correspondiente. <sup>1</sup>
14	Observaciones		AN	255	0	156	410	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos Sectorial, Tipo de Proyecto de Inversión, Divisa y Países. <sup>5</sup>
15	Espacios en blanco		AN	96	0	411	506	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 3:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros o proyectos promovidos, que componen los fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) reportados en el detalle 2, en caso de que aplique.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "303"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Inversión		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar el identificador definido por la Administradora para el fondo de inversión reportado en el presente formato, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID Inversión" del "DETALLE 2". <sup>5</sup>



**DETALLE 3:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros o proyectos promovidos, que componen los fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) reportados en el detalle 2, en caso de que aplique.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
3	ID Componente		AN	10	0	14	23	Se deberá reportar un identificador definido por la Administradora, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambio a lo largo del tiempo. <sup>5</sup> Para el caso de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional se deberá reportar el identificador compuesto "INVTMEX" + "XXX", donde "XXX" será el número de inversión comenzando por "001", en caso de existir más de una inversión indirecta en el instrumento deberá asignar el número consecutivo.
4	Empresa o proyecto promovido del fondo de inversión		AN	70	0	24	93	Se deberá anotar el nombre de la empresa o proyecto promovido por el componente del fondo de inversión. <sup>5</sup>
5	Tipo de Componente o Proyecto de Inversión		N	2	0	94	95	Se deberá anotar el tipo de inversión del componente del fondo de inversión según el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión". Cuando no exista identificador para el tipo proyecto de inversión del componente del fondo de inversión en el "Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el tipo de proyecto de inversión del que se trate. <sup>1</sup>
6	Sector del componente o proyecto		N	2	0	96	97	Se deberá anotar el sector al que pertenece el componente del fondo de inversión según el "Catálogo Sectorial" Cuando no exista identificador para el sector al que pertenece el componente del fondo de inversión en el "Catálogo Sectorial" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el sector al que pertenece. <sup>1</sup>
7	Monto Total Invertido		N	10	2	98	109	Se deberá anotar el monto total invertido en pesos en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión. Cuando se trate de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional reportadas con los identificadores compuestos del tipo "INVTMEX" + "XXX" en el ID 3 del presente DETALLE, se reportará el monto total invertido en pesos en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión considerando la inversión total realizada por co-inversionistas y/o fondos paralelos. En ambos casos considerará el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato y, sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. <sup>2</sup>
8	Monto Total Invertido en la divisa del Instrumento Estructurado		N	15	2	110	126	Se deberá anotar el monto total invertido en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión en la divisa del Instrumento Estructurado, sin considerar el valor actualizado por efecto de valuación. <sup>2</sup> Cuando se trate de inversiones con co-inversionistas y/o participación de fondos internacionales y que se realicen en territorio nacional reportadas con los identificadores compuestos del tipo "INVTMEX" + "XXX" en el ID 3 del presente DETALLE, se reportará en la divisa del Instrumento Estructurado el monto total invertido en el activo financiero, o proyecto promovido que compone al fondo de inversión considerando la inversión total realizada por co-inversionistas y/o fondos paralelos.
9	Participación del componente o proyecto en el fondo de inversión		N	3	2	127	131	Porcentaje de participación del componente o proyecto en el fondo de inversión. <sup>2</sup>
10	Participación del fondo de inversión en el proyecto de inversión		N	3	2	132	136	Se deberá anotar la participación del fondo relativo al total del proyecto de inversión o componente. <sup>2</sup>
11	Divisa		N	2	0	137	138	Se deberá anotar el identificador de la Divisa en que se realiza la inversión en el componente o proyecto según el "Catálogo de Divisa". Cuando no exista identificador para la divisa en que se realizan la inversión en el "Catálogo de Divisa" se deberá utilizar el indicador "99" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar la divisa correspondiente. <sup>1</sup>




**DETALLE 3:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los activos financieros o proyectos promovidos, que componen los fondos de inversión (Private equity fund, venture capital fund o similar) reportados en el detalle 2, en caso de que aplique.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
12	País		N	2	0	139	140	Se deberá anotar el País al que está siendo destinado el componente o proyecto del fondo de inversión según el "Catálogo de Países". Cuando no exista identificador para el país al que está siendo destinado el componente o proyecto del fondo de inversión en el "Catálogo de Países" se deberá utilizar el indicador "36" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el país correspondiente. <sup>1</sup>
13	Observaciones		AN	255	0	141	395	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en los Catálogos Sectorial, Tipo de Proyecto de Inversión, Divisa y Países. <sup>5</sup>
14	Espacios en blanco		AN	111	0	396	506	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 4:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los gastos o comisiones devengados del Instrumento Estructurado reportado en subencabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "304"</b> . <sup>1</sup>
2	Número Consecutivo		N	10	0	4	13	Se deberá señalar un número consecutivo para cada concepto de comisión. <sup>1</sup>
3	Clasificación del Pago		N	2	0	14	15	Se deberá anotar el identificador de la clasificación del pago, de acuerdo con el "Catálogo de Clasificación de Pago". <sup>1</sup>
4	Monto pagado		N	15	2	16	32	Se deberá anotar el monto en pesos pagado al Administrador en el periodo de revisión considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato. <sup>2</sup>
5	Concepto de Pago		N	2	0	33	34	Se deberá anotar el concepto del pago realizado mencionado en el punto 2 anterior de acuerdo con el "Catálogo de Concepto de Comisiones". Cuando no exista identificador para el concepto del pago en el "Catálogo de Concepto de Comisiones" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el concepto que describa el pago correspondiente. <sup>1</sup>
6	Observaciones		AN	255	0	35	289	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en el Catálogo de Concepto de Comisiones. <sup>5</sup>
7	Espacios en blanco		AN	217	0	290	506	Vacios. <sup>6</sup>



**DETALLE 5:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los Coinversionistas que participan en cada una de las inversiones o proyectos promovidos reportados en el Detalle 2 por el instrumento Estructurado reportado en subencabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "305"</b> . <sup>1</sup>
2	ID Inversión		AN	10	0	4	13	Se deberá reportar el identificador definido por la Administradora para el proyecto de inversión reportado en el presente, el cual será el mismo que se reporta en el concepto "ID Inversión" del DETALLE 2. <sup>5</sup>
3	Número Consecutivo		N	10	0	14	23	Se deberá señalar un número consecutivo para cada Coinversionista. <sup>1</sup>

**DETALLE 5:** En este detalle, se deberá incorporar la información de los Coinversionistas que participan en cada una de las inversiones o proyectos promovidos reportados en el Detalle 2 por el instrumento Estructurado reportado en subencabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
4	Tipo de Coinversionista		N	2	0	24	25	Se deberá anotar el tipo de coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado de acuerdo con el "Catálogo de Tipo de Coinversionista". Cuando no exista identificador para el tipo de coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado en el "Catálogo de Tipo de Coinversionista" se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo, y en el campo "Observaciones" se deberá indicar el concepto que describa el pago correspondiente. <sup>1</sup> Cuando no exista coinversionista con participación en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado, se deberá utilizar el indicador "99" contenido en el "Catálogo de Tipo de Coinversionista".
5	Participación del Tipo de Coinversionista en el proyecto		N	3	2	26	30	Se deberá reportar el porcentaje de la participación del "Tipo de Coinversionista" reportado en el punto anterior en la empresa o proyecto promovido por el Instrumento Estructurado. En el caso de que existan dos o más coinversionistas que sean parte de un mismo Tipo de Coinversionistas se deberá sumar el porcentaje de participación de todos. <sup>2</sup>
6	Observaciones		AN	255	0	31	285	Se deberán anotar en su caso, características especiales u observaciones con respecto a las características que no estén especificadas en el formato en el Catálogo de Tipo de Coinversionista. <sup>5</sup>
7	Espacios en blanco		AN	221	0	286	506	Vacios. <sup>6</sup>

**DETALLE 6:** En este detalle, se deberá incorporar la información de las llamadas de capital y/o derechos de suscripción realizados del Instrumento Estructurado reportado en subencabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "306"</b> . <sup>1</sup>
2	Número de llamada de capital y/o derecho de suscripción		N	3	0	4	6	Se deberá señalar un número consecutivo por cada llamada de capital y/o derecho de suscripción realizada del Instrumento Estructurado señalado en el subencabezado, el cual se incrementará por cada nueva llamada de capital, El número de llamada de capital y/o derecho de suscripción deberá iniciar en 1. <sup>1</sup>
3	Fecha de Emisión de la llamada de capital y/o derecho de suscripción		F	8	0	7	14	Fecha de emisión de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. <sup>3</sup>
4	Fecha Ex-Derecho		F	8	0	15	22	Fecha Ex-Derecho de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. <sup>3</sup>
5	Fecha de liquidación de la llamada de capital y/o derecho de suscripción		F	8	0	23	30	Fecha de liquidación de la llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. <sup>3</sup>
6	Cantidad de Títulos		N	15	0	31	45	Cantidad de títulos emitidos en llamada de capital y/o derecho de suscripción del Instrumento Estructurado operado. <sup>1</sup>
7	Valor unitario a mercado		N	9	6	46	60	En este campo se debe poner el valor unitario de mercado de los títulos emitidos en la llamada de capital y/o derecho de suscripción. <sup>2</sup>
8	Monto emitido de la llamada de capital y/o derecho de suscripción		N	15	2	61	77	Monto total de la llamada de capital y/o derecho de suscripción expresada en pesos mexicanos considerando el tipo de cambio FIX a la fecha reportada en el id 7 "Fecha de Información" del encabezado del presente formato y sin considerar cualquier otro valor adicional de la valuación de dichos proyectos. <sup>2</sup>
9	Monto de la llamada de capital y/o derecho de suscripción en la divisa del Instrumento Estructurado		N	15	2	78	94	Monto total de la llamada de capital y/o derecho de suscripción expresada en la divisa de emisión del Instrumento Estructurado. <sup>2</sup>
10	Espacios en blanco		AN	412	0	95	506	Vacios. <sup>6</sup>

CATÁLOGOS(S)

Catálogo de Entidades (AFORE)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
530	XXI Banorte
534	Profuturo
538	Principal
544	SURA
550	Inbursa
552	Citibanamex
556	Azteca
562	Invercap
568	Coppel
578	PensionISSSTE

Catálogo de Países			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
1	Alemania	27	Hungría
2	Australia	28	Letonia
3	Austria	29	Lituania
4	Bélgica	30	Malta
5	Canadá	31	República Checa
6	Dinamarca	32	Suecia
7	España	33	Brasil
8	Estados Unidos de Norteamérica	34	China
9	Finlandia	35	India
10	Francia	36	Otro
11	Grecia	37	Rumanía
12	Países Bajos (Holanda)	38	Noruega
13	Hong Kong	39	Chile
14	Irlanda	40	Israel
15	Italia	41	Bulgaria
16	Japón	42	Colombia
17	Luxemburgo	43	Corea del Sur
18	México	44	Islandia
19	Polonia	45	Perú
20	Portugal	46	Singapur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña	47	Malasia
22	Suiza	48	Nueva Zelanda
23	Chipre	49	Sudáfrica
24	Eslovaquia	50	Tailandia
25	Eslovenia	51	Taiwán
26	Estonia		

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
1	MXP	Peso
2	USD	Dólar Americano
3	UDI	Unidades de Inversión
6	JPY	Yen Japonés
7	EUR	Euros
8	AUD	Dólar Australiano
9	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega

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

Catálogo Sectorial	
Id	Descripción
00	Otros
01	Agricultura, ganadería, aprovechamientos forestal, caza y pesca
02	Minería
03	Electricidad, agua y suministro de gas por ductos al consumidor final
04	Construcción
05	Industrias manufactureras
06	Comercio al por mayor
07	Comercio al por menor
08	Transportes, correos y almacenamiento
09	Información en medios masivos
10	Servicios financieros y de seguros
11	Servicios inmobiliarios y de alquiler de bienes inmuebles e intangibles
12	Servicios profesionales, científicos y técnicos
13	Dirección de corporativos y empresas
14	Servicios de apoyo a los negocios y manejo de desechos y servicios de remediación
15	Servicios educativos
16	Servicios de salud y de asistencia social
17	Servicios de esparcimiento culturales y deportivos, y otros servicios recreativos
18	Servicios de alojamiento temporal y de preparación de alimentos y bebidas
19	Otros servicios excepto actividades del gobierno
20	Actividades del gobierno y de organismos internacionales y extraterritoriales

Catálogo de Tipos de Instrumento Estructurado	
Identificador	Descripción
00	Otro
01	CKD
02	CERPI



Catálogo de Estrategia Preponderante	
Identificador	Descripción
00	Otro
01	Inmobiliario Vivienda
02	Inmobiliario Comercial
03	Inmobiliario mixto
04	Infraestructura y energía en desarrollo
05	Infraestructura y energía en operación
06	Capital Privado
07	Capital Emprendedor
08	Activos Financieros
09	Fondo de Fondos
10	Crédito
11	Inmobiliario Industrial

Catálogo de Valuador Independiente	
Identificador	Descripción
00	Otro
01	414 Capital Inc.
02	Deloitte
03	PricewaterhouseCooper (PwC)
04	KPMG
05	Quantit
06	Valuación, Análisis y Riesgos (VAR)
07	Duff & Phelps

Catálogo de Tipo de Proyecto de Inversión	
Identificador	Descripción
00	Otro
01	Capital
02	Préstamos
03	Deuda
04	Bonos corporativos
05	Bonos de Alto Rendimiento
06	Instrumentos híbridos y deuda convertible
07	Deuda con títulos opcionales (warrants)
08	Financiamientos respaldados con activos (excluyendo carteras de crédito)
09	Deuda mezzanine
10	Carteras de consumo
11	Carteras de empresas
12	Activos emprobleados (Distressed Assets)
13	Portafolios de Créditos en Cartera Vencida
14	Portafolios de Créditos originados por terceros
15	Derechos derivados de contratos de factoraje
16	Derechos de cobro, obligaciones y derechos fideicomisarios
17	Fondo de Fondos
18	Sociedades de inversión de renta fija
19	Sociedades de inversión de renta variable
20	Otras sociedades de inversión
21	Instrumento de Renta Fija negociadas a través de bolsas de valores
22	Instrumento de Renta Variable negociadas a través de bolsas de valores
23	Vehículos de Inversión Inmobiliaria o FIBRAS negociadas a través de bolsas de valores
24	Instrumentos objeto de oferta pública
25	Efectivo
26	Inversión temporal en valores
27	Inversión temporal en sociedades o fondos de inversión permitidos

Catálogo de Representante Común	
Id	Descripción
000	Otro
001	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple.
002	Banco Invex, S.A., Institución de Banca Múltiple
003	Monex Casa de Bolsa, S.A. de C.V., Monex Grupo Financiero
004	Deutsche Bank México, S.A., Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria.
005	The Bank of New York Mellon, S.A., Institución de Banca Múltiple
006	HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple
007	Evercore Casa de Bolsa, S.A. de C.V.
008	Masari Casa de Bolsa, S.A.

Catálogo de fiduciarios	
Id	Descripción
000	Otro
001	Banco Invex, S.A., Institución de Banca Múltiple, Invex Grupo Financiero.
002	Banco Nacional de México, S.A.
003	HSBC México, S.A., Institución de Banca Múltiple
004	The Bank of New York Mellon, S.A., Institución de Banca Múltiple
005	CI Banco, S.A., Institución de Banca Múltiple.
006	Deutsche Bank México, S.A., Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria.
007	Bank of America, S.A.s Institución de Banca Múltiple, División Fiduciaria
008	BBVA Bancomer Servicios, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero BBVA Bancomer, Dirección Fiduciaria.
009	Banco Monex, S.A., Institución de Banca Múltiple, Monex Grupo Financiero
010	Banco Actinver, S.A. Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Actinver

Catálogo de Clasificación de Pago	
Id	Descripción
00	Cuando el pago corresponda a gastos administrativos; previamente pactados, que sean revelados en el Prospecto de Colocación tales como: Comisión por administración, administración de las inversiones o por el desempeño del Administrador, Gastos de Emisión y/o Mantenimiento del Instrumento Estructurado
01	Cuando el pago corresponda a los costos del Proyecto o Inversión, y sea consolidado con el costo de adquisición de los activos subyacentes adquiridos, que no sea pagado a Entidades relacionadas,
02	Cuando el pago corresponda a los gastos relacionados al Proyecto o Inversión, con cargo al Fideicomiso, que no sea pagado a Entidades relacionadas,
03	Cuando el pago corresponda a los costos del Proyecto o Inversión, y sea consolidados con el costo de adquisición de los activos subyacentes, que sea pagado a Entidades relacionadas.
04	Cuando el pago corresponda a los gastos relacionados al Proyecto o Inversión, con cargo al Fideicomiso, que sea pagado a Entidades relacionadas.

Catálogo de Concepto de Comisiones*		
Identificador	Concepto	Descripción Concepto
01	Comisión por Administración (Inversión)	Monto efectivamente pagado durante el período de inversión al administrador por concepto de comisión por administración definido en el prospecto del instrumento estructurado (no incluye los gastos pagados a un tercero por la administración de inversiones). En el caso de Instrumentos Estructurados, que a su vez invierta en otros fondos de inversión, se deberá reportar el monto efectivamente pagado durante el periodo de inversión por concepto de comisión por administración del administrador del Fideicomiso y la comisión por administración pagada a los Fondos Subyacentes.
02	Comisión por Administración. (Desinversión)	Monto efectivamente pagado una vez concluido el periodo de inversión al administrador por concepto de comisión por administración definido en el prospecto del instrumento estructurado.
03	Pagos para administrar las inversiones.	Monto pagado a terceros expertos en materias o áreas que permitan verificar la viabilidad de los proyectos o inversiones del instrumento estructurado; así como los servicios pagados para identificar oportunidades de inversión.
04	Comisión por desempeño pagado al administrador del instrumento estructurado.	Monto pagado al administrador por los rendimientos que produzcan las inversiones aprobadas una vez distribuido el rendimiento preferente (Carried interest/Carry).
05	Pago de derechos para registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL	Monto pagado por los derechos para registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores, e INDEVAL relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.

Catálogo de Concepto de Comisiones*		
Identificador	Concepto	Descripción Concepto
06	Pago para mantener los derechos de registro y listado de CBs en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL.	Monto pagado para mantener los derechos de registro y listado en el RNV, Bolsa de Valores e INDEVAL.
07	Pagos por Intermediación Devengados	Monto acumulado devengado de los gastos de intermediación y colocación relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado, el cual deberá amortizarse o devengarse linealmente en 6 años.
08	Pago al Agente Estructurador por la emisión inicial Devengado	Monto acumulado devengado al Agente Estructurador relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado, el cual deberá amortizarse o devengarse linealmente en 6 años.
09	Pago al Representante Común por la emisión inicial	Monto pagado al Representante Común relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado.
10	Pago al Representante Común por mantenimiento de la emisión	Monto pagado al Representante común por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado.
11	Pago al Fiduciario por emisión inicial	Monto pagado al Fiduciario relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado.
12	Pago al Fiduciario por mantenimiento de la emisión	Monto pagado al Fiduciario por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado.
13	Pago a Auditor Externo por la emisión inicial	Monto pagado al Auditor Externo relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado.
14	Pago a Auditor Externo por mantenimiento de la emisión	Monto pagado al auditor externo por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado.
15	Pago a Asesores Fiscales por la emisión inicial	Monto pagado a los Asesores Fiscales relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
16	Pago a Asesores Fiscales por mantenimiento de la emisión	Monto pagado a los Asesores Fiscales por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado.
17	Pagos Legales de la emisión inicial	Monto pagado por los gastos de asesoría legal relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
18	Pagos Legales por mantenimiento de la emisión	Monto pagado por los gastos de asesoría legal por concepto de mantenimiento del instrumento estructurado.
19	Pagos Legales relacionados con las inversiones	Monto pagado por los gastos o costos de asesoría legal relacionados con las inversiones del instrumento estructurado.
20	Pagos por Promoción e Impresión	Monto pagado por los gastos de promoción e impresión relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
21	Pagos a Otros Asesores por la emisión inicial	Monto pagado a otros asesores relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
22	Pagos a Otros Asesores por mantenimiento de la emisión	Monto pagado a otros asesores relacionados con el mantenimiento del instrumento estructurado.
23	Pagos a Otros Asesores relacionados con las inversiones	Monto pagado a otros asesores relacionados con las inversiones del instrumento estructurado.
24	Pagos por viajes y viáticos	Monto pagado por concepto de viajes o viáticos relacionados con las inversiones del instrumento estructurado.
25	Pago de Honorarios y Gastos Notariales	Monto pagado por concepto de Honorarios y Gastos Notariales relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
26	Pago por Asesoría Contable y/o financiera por la emisión inicial	Monto pagado por concepto de asesoría contable o financiera relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado.
27	Pago por Asesoría Contable y/o financiera por mantenimiento de la emisión	Monto pagado por concepto de asesoría contable o financiera relacionado con el mantenimiento del instrumento estructurado.
28	Pago por Asesoría Contable y/o financiera relacionado con las inversiones	Monto pagado por concepto de asesoría contable y/o financiera relacionado con las inversiones del instrumento estructurado.
29	Pago al Valuador Independiente	Monto pagado al Valuador Independiente por la emisión inicial o por mantenimiento del instrumento estructurado.
30	Pago al Proveedor de Precios	Monto pagado al Proveedor de Precios por la emisión inicial o por mantenimiento del instrumento estructurado.
31	Gastos relacionados con las llamadas de capital y/o derechos de suscripción del instrumento estructurado	Monto pagado por los gastos relacionados con las llamadas de capital y/o derechos de suscripción del instrumento estructurado.
32	Pagos relacionados con el Desarrollo de los proyectos.	Monto pagado por los gastos o costos de Inversión relacionados con el desarrollo de los proyectos inmobiliarios y/o de infraestructura.
33	Pagos relacionados con la Construcción.	Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la construcción de desarrollos inmobiliarios y/o de infraestructura.
34	Pagos relacionados con la adquisición.	Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la adquisición de desarrollos inmobiliarios y/o de infraestructura.
35	Pagos relacionados con el arrendamiento.	Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con el arrendamiento de activos derivado de las inversiones del instrumento estructurado.
36	Pagos relacionados con la contratación y renovación de primas de seguros.	Monto pagado por la contratación y renovación de primas de seguros relacionadas con las inversiones, por ejemplo, seguros contra daños y seguros de propiedad (según aplique).

Catálogo de Concepto de Comisiones*		
Identificador	Concepto	Descripción Concepto
37	Pagos relacionados con el corretaje inmobiliario	Monto pagado por los gastos o costos de inversiones relacionados con el corretaje inmobiliario.
38	Pagos relacionados con la valuación del inmueble.	Monto pagado por los gastos o costos de inversión relacionados con la valuación del inmueble.
39	Pagos operativos de las inversiones	Monto pagado relacionado con la operación y mantenimiento de los proyectos inmobiliarios y/o de infraestructura.
40	Pagos por Desinversión	Monto pagado por el análisis, implementación y cierre de una potencial desinversión o de una desinversión, incluyendo cualesquiera indemnizaciones pagaderas respecto de esta. Ejemplos: Gastos o costos relacionados con IPO, Brokers, etc.
41	Seguros y Garantías relacionados con el Administrador	Monto pagado por los gastos o costos para cubrir seguros y/o garantías relacionadas con el administrador del instrumento estructurado, por ejemplo, el "Seguro de Responsabilidad Profesional". Esta categoría no se relaciona con los seguros o garantías relacionados con las inversiones realizadas.
42	Impuestos	Monto pagado por concepto de impuestos por la gestión del instrumento estructurado, esta categoría no está relacionada con el pago de impuestos por las inversiones realizadas por el instrumento estructurado.
43	Impuestos relacionados con las inversiones	Monto pagado por concepto de impuestos relacionados con las inversiones realizadas por el instrumento estructurado.
44	Intereses a cargo	Monto pagado por intereses a cargo del instrumento estructurado.
45	Depreciación y amortización	Monto pagado por la depreciación o amortización (cuando aplique).
46	Contraprestación pagada al Comité Técnico	Monto pagado por concepto de cualquier compensación derivada por la gestión del Comité Técnico.
47	Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas	Monto pagado en el desarrollo, negociación y estructuración de una posible Inversión que finalmente no fue realizada, tales como gastos relacionados con la participación en asociaciones industriales, conferencias o juntas similares con fines de evaluar potenciales oportunidades de Inversión, desarrollar ideas de Inversión, y para identificar temas y tendencias en industrias, sectores o geografías, que sean distintos a los pagos de inversiones no viables por disolución, por depósitos o anticipos de efectivo y/o por viajes y viáticos.
48	Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por disolución (break up fees)	Monto pagado por comisiones por disolución (break up fees) pagaderos por el Fideicomiso en relación con, o montos pagados como penalidad por no consumir una Inversión que finalmente no sea realizada.
49	Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por depósitos o anticipos de efectivo	Depósitos o anticipos de efectivo u otros activos que se pierdan en relación con una potencial Inversión que finalmente no sea realizada.
50	Pagos de Inversiones No Viables o No Concretadas por viaje y viáticos	Monto pagado por concepto de viajes o viáticos relacionados con cualquier potencial Inversión que finalmente no sea realizada.
51	Pagos de Intermediación Iniciales	Monto total correspondiente a los gastos de intermediación y colocación relacionados con la emisión inicial del instrumento estructurado.
52	Pago al Agente Estructurador por la emisión inicial	Monto total correspondiente al pago del Agente Estructurador relacionado con la emisión inicial del instrumento estructurado.
00	Otros Pagos	Otros gastos o costos realizados con el instrumento estructurado que no se encuentran en los puntos anteriores.

Catálogo de Tipos de Coinversionista	
Identificador	Descripción
00	Otro
01	Persona Física
02	Empresas
03	Bancos u otras instituciones financieras
04	Aseguradoras
05	Family Office
06	Instituciones de Desarrollo/Organismos multilaterales
07	Fideicomisos/Fundaciones/Universidades
08	Fondo de Capital Privado
09	Fondos de Pensiones
10	Fondos Soberanos
11	Certificados Bursátiles de Capital de Desarrollo (CKD)
12	Certificados Bursátiles Fiduciarios de Proyectos de Inversión (CERPI)
13	Administrador del Instrumento Estructurado o Subsidiaria del mismo o Entidad relacionada del mismo
99	Sin Coinversionista

## VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

## POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO

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

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

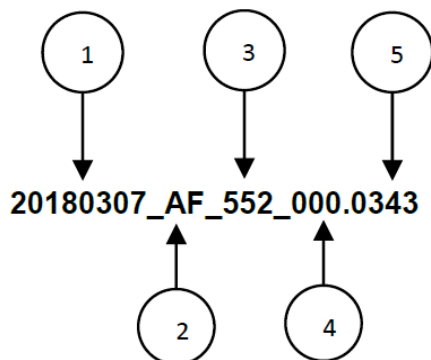
- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

- III. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUpg.
- VI. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, <b>Constante = "AF"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la Clave de Entidades AFORE que se reporta conforme al catálogo de entidades del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será <b>Constante = "000"</b> )
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será <b>Constante = "0343"</b> .

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

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



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

**20180307\_AF\_552\_000.0343.gpg**

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

**A20180307\_AF\_552\_000.0343**

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

- VII. Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:






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

Anexo 141






	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	0345	<b>PROCESO :</b>	<b>FINANCIERO</b>
	<b>FUENTE :</b>	Intermediarios Financieros	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.-</b> Este archivo contiene información de los movimientos y la participación de las Siefiores en Fondos Mutuos que son operados a través de Intermediarios Financieros (Plataformas de Negociación Electrónicas, Administradores o Patrocinadores del Fondo Mutuo) distintos a los Custodios Internacionales y otros aspectos de los Fondos Mutuos.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	147	08:30 a 10:00 Hrs





ENCABEZADO


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = <b>Constante "000"</b> <sup>1</sup>
2	Número de Registros		N	5	0	4	8	Número de registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del Registro		N	3	0	9	11	Número de caracteres por registro = <b>Constante "147"</b> . <sup>1</sup>
4	Tipo de Archivo		N	4	0	12	15	Identificador de archivo (para control del sistema) = <b>Constante "0345"</b> . <sup>1</sup>
5	Fecha de la Información		F	8	0	16	23	Fecha de la operación al cierre del día hábil previo al que se reporta. <sup>3</sup>
6	Tipo de Entidad		N	3	0	24	26	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipo de Entidad anexo.= <b>Constante "034"</b> <sup>1</sup>
7	Entidad		N	3	0	27	29	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo Entidad Contrapartes, anexo. <sup>1</sup>
8	Espacios en blanco		AN	118	0	30	147	Vacios. <sup>6</sup>

SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	Tipo de Entidad Reportada		N	3	0	4	6	Se deberá reporta la Clave del Tipo de Entidades reportada de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo. <sup>1</sup>
3	Entidad Reportada		N	3	0	7	9	Se deberá reportar la Clave de Entidad reportada de acuerdo al Catálogo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
4	Subtipo de Entidad Reportada		N	6	0	10	15	Se deberá anotar la Clave del Subtipo de Entidad reportada de acuerdo al Catálogo de Subtipo de Entidades, anexo. <sup>1</sup>
5	Número de Cuenta del Cliente		AN	20	0	16	35	Se deberá anotar el número de cliente de la Siefiore, únicamente para ser llenado por el Intermediario Financiero. <sup>5</sup>
6	Espacios en blanco		AN	112	0	36	147	Vacios. <sup>6</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: MOVIMIENTOS DE FONDOS MUTUOS EN EL DÍA								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	Entradas/Salidas		AN	1	0	4	4	Se deberá anotar la clave de la operación realizada ("E" para valores recibidos o "S" para valores entregados por la Siefore) <sup>5</sup> .
3	Consecutivo		N	10	0	5	14	Se deberá señalar un número consecutivo para cada movimiento de Fondos Mutuos en el día.
4	Tipo de Movimiento		AN	1	0	15	15	Se deberá anotar la clave que indica el tipo de movimiento realizado de acuerdo al Catálogo de Tipo de Movimiento. <sup>5</sup>
5	Código ISIN Fondo Mutuo		AN	12	0	16	27	Se deberá anotar el código ISIN del Fondo Mutuo. <sup>7</sup>
6	Ticker Bloomberg Fondo Mutuo		AN	20	0	28	47	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado. <sup>11</sup>
7	Ticker Reuters del Fondo Mutuo		AN	20	0	48	67	En caso de que exista, se deberá anotar el Ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado. <sup>12</sup>
8	ID del Administrador		N	6	0	68	73	Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo Entidad Contrapartes". <sup>1</sup>
9	Nombre corto del Administrador		AN	20	0	74	93	Se deberá anotar el nombre corto del Administrador a 20 caracteres siempre y cuando no exista identificador para el Administrador en el "Catálogo Entidad Contrapartes". En otro caso se deberá reportar vacío. <sup>5</sup>
10	Unidades operadas		N	20	6	94	119	Se deberán anotar las unidades operadas del Fondo Mutuo. <sup>2</sup>
11	Monto de Liquidación		N	20	6	120	145	Se deberá anotar el total del monto de liquidación de la operación en la Divisa del Fondo Mutuo. <sup>2</sup>
12	Divisa		N	2	0	146	147	Se deberá anotar el identificador de la Divisa de la operación según el Catálogo de Divisa, anexo. <sup>1</sup>

DETALLE 2: PARTICIPACIÓN EN FONDOS MUTUOS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Es el identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	Código ISIN Fondo Mutuo		AN	12	0	4	15	Se deberá anotar el código ISIN del Fondo Mutuo. <sup>7</sup>
3	Ticker Bloomberg Fondo Mutuo		AN	20	0	16	35	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado. <sup>11</sup>
4	Ticker Reuters del Fondo Mutuo		AN	20	0	36	55	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado. <sup>12</sup>
5	Participación Inicial		N	20	6	56	81	Es la cantidad de unidades iniciales que se tienen en cartera del Fondo Mutuo. (Debe coincidir con la Participación Actual del día anterior). <sup>2</sup>
6	Participación Actual		N	20	6	82	107	Se deberá anotar la cantidad de unidades iniciales que se tienen en cartera del Fondo Mutuo, al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>



DETALLE 2: PARTICIPACIÓN EN FONDOS MUTUOS								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
7	Porcentaje de Participación		N	3	4	108	114	Se deberá anotar el porcentaje de participación actual en relación a los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
8	Valor del Fondo Mutuo		N	20	6	115	140	Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
9	Divisa		N	2	0	141	142	Se deberá anotar el identificador de la Divisa del Fondo Mutuo según el Catálogo de Divisa, anexo. <sup>1</sup>
10	Espacios en blanco		AN	5	0	143	147	Vacios <sup>6</sup>

**CATÁLOGO(S)**

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

Catálogo Entidad Contrapartes		
Clave	Identificador	Descripción
001	900000	Otros
002	900001	Schroders Plc.
003	900002	Blackrock Inc.
004	900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
005	900004	Amundi Asset Management
006	900005	Nomura Holdings, Inc .
008	900007	Wellington Management Company LLP
009	900008	Ninety One PLC
010	900009	Alliance Bernstein
012	950001	Allfunds Bank, S.A.U.
013	950002	Fundvest, Pershing LLC
014	950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB
015	900011	Fidelity International
016	900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
017	900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.
018	900014	Goldman Sachs Asset Management International
019	900015	Morgan Stanley Investment Management Inc

<b>Catálogo Entidad Contrapartes</b>		
<b>Clave</b>	<b>Identificador</b>	<b>Descripción</b>
020	900016	Vanguard Group
021	900017	Natixis
022	900018	WisdomTree Investments, Inc.
023	900019	State Street Corporation
024	900020	DWS Investments
025	900021	Sherpa Capital
026	900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
027	900023	FirstTrust
028	900024	Baillie Gifford
029	900025	UBS AG
030	900026	AXA Investment Managers
031	900027	BNP Paribas Asset Management
032	900028	GAM Holding AG
033	900029	Invesco Capital Management
034	900030	Janus Henderson Investors
035	900031	Jupiter Asset Management Limited
036	900032	NN Investment Partners B.V.
037	900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
038	900034	Columbia Threadneedle Investments
039	900035	UTI Asset Management
040	900036	Nikko Asset Management
041	900037	Global X
042	900038	VanEck
043	900039	KraneShares
044	900040	ProShares
045	900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
046	900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
047	900043	Acadian Asset Management LLC
048	900044	Man Group
049	900045	Berenberg
050	900046	Finamex
051	900047	ODDO BHF Asset Management SAS

<b>Catálogo de Entidades (SIEFORES Básicas)</b>	
<b>Clave de Entidad</b>	<b>Descripción</b>
530	XXI BANORTE
534	PROFUTURO
538	PRINCIPAL
544	SURA
550	INBURSA
552	CITIBANAMEX
556	AZTECA
562	INVERCAP
568	COPPEL
578	PENSIONISSSTE

<b>Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Voluntarias)</b>	
<b>Clave de Entidad</b>	<b>Descripción</b>
634	PROFUTURO
644	SURA
652	CITIBANAMEX
630	XXI BANORTE

<b>Catálogo de Entidades (SIEFORES Aportaciones Complementarias)</b>	
<b>Clave de Entidad</b>	<b>Descripción</b>
334	PROFUTURO

<b>Catálogo de Entidades (SIEFORES Previsión Social)</b>	
<b>Clave de Entidad</b>	<b>Descripción</b>
430	XXI BANORTE

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	530	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore XXI Banorte Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	534	000090	Siefore Básica de Pensiones	Fondo Profuturo Básico de Pensiones, S.A. de C.V.
002	538	000090	Siefore Básica de Pensiones	Principal Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	544	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Sura Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	550	000090	Siefore Básica de Pensiones	Inbursa Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	552	000090	Siefore Básica de Pensiones	Citibanamex Siefore Básica Pensiones, S.A. de C.V.
002	556	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Azteca Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	562	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Invercap Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	568	000090	Siefore Básica de Pensiones	Siefore Coppel Básica 0, S.A. de C.V.
002	578	000090	Siefore Básica de Pensiones	Más Pensión Siefore Básica de Pensiones, S.A. de C.V.
002	530	001000	Siefore Inicial	Siefore XXI Banorte Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	534	001000	Siefore Inicial	Fondo Profuturo BAS IN, S.A. de C.V., SIEFORE.
002	538	001000	Siefore Inicial	Principal Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	544	001000	Siefore Inicial	Siefore Sura Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	550	001000	Siefore Inicial	Inbursa Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	552	001000	Siefore Inicial	Citibanamex Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	556	001000	Siefore Inicial	Siefore Azteca Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	562	001000	Siefore Inicial	Siefore Invercap Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	568	001000	Siefore Inicial	Siefore Coppel Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	578	001000	Siefore Inicial	Más Pensión Siefore Básica Inicial, S.A. de C.V.
002	530	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore XXI Banorte Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	534	001955	Siefore Básica 55-59	Fondo Profuturo SB 55-59, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001955	Siefore Básica 55-59	Principal Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	544	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Sura Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	550	001955	Siefore Básica 55-59	Inbursa Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	552	001955	Siefore Básica 55-59	Citibanamex Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	556	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Azteca Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	562	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Invercap Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	568	001955	Siefore Básica 55-59	Siefore Coppel Básica 55-9, S.A. de C.V.
002	578	001955	Siefore Básica 55-59	Más Pensión Siefore Básica 55-59, S.A. de C.V.
002	530	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore XXI Banorte Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	534	001960	Siefore Básica 60-64	Fondo Profuturo SB 60-64, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001960	Siefore Básica 60-64	Principal Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	544	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Sura Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	550	001960	Siefore Básica 60-64	Inbursa Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	552	001960	Siefore Básica 60-64	Citibanamex Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	556	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Azteca Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	562	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Invercap Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	568	001960	Siefore Básica 60-64	Siefore Coppel Básica 60-4, S.A. de C.V.
002	578	001960	Siefore Básica 60-64	Más Pensión Siefore Básica 60-64, S.A. de C.V.
002	530	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore XXI Banorte Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	534	001965	Siefore Básica 65-69	Fondo Profuturo SB 65-69, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001965	Siefore Básica 65-69	Principal Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	544	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Sura Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	550	001965	Siefore Básica 65-69	Inbursa Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	552	001965	Siefore Básica 65-69	Citibanamex Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	556	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Azteca Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	562	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Invercap Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	568	001965	Siefore Básica 65-69	Siefore Coppel Básica 65-9, S.A. de C.V.
002	578	001965	Siefore Básica 65-69	Más Pensión Siefore Básica 65-69, S.A. de C.V.
002	530	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore XXI Banorte Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	534	001970	Siefore Básica 70-74	Fondo Profuturo SB 70-74, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001970	Siefore Básica 70-74	Principal Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	544	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Sura Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	550	001970	Siefore Básica 70-74	Inbursa Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	552	001970	Siefore Básica 70-74	Citibanamex Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
002	556	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Azteca Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	562	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Invercap Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	568	001970	Siefore Básica 70-74	Siefore Coppel Básica 70-4, S.A. de C.V.
002	578	001970	Siefore Básica 70-74	Más Pensión Siefore Básica 70-74, S.A. de C.V.
002	530	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore XXI Banorte Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	534	001975	Siefore Básica 75-79	Fondo Profuturo SB 75-79, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001975	Siefore Básica 75-79	Principal Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	544	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Sura Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	550	001975	Siefore Básica 75-79	Inbursa Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	552	001975	Siefore Básica 75-79	Citibanamex Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	556	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Azteca Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	562	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Invercap Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	568	001975	Siefore Básica 75-79	Siefore Coppel Básica 75-9, S.A. de C.V.
002	578	001975	Siefore Básica 75-79	Más Pensión Siefore Básica 75-79, S.A. de C.V.
002	530	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore XXI Banorte Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	534	001980	Siefore Básica 80-84	Fondo Profuturo SB 80-84, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001980	Siefore Básica 80-84	Principal Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	544	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Sura Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	550	001980	Siefore Básica 80-84	Inbursa Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	552	001980	Siefore Básica 80-84	Citibanamex Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	556	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Azteca Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	562	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Invercap Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	568	001980	Siefore Básica 80-84	Siefore Coppel Básica 80-4, S.A. de C.V.
002	578	001980	Siefore Básica 80-84	Más Pensión Siefore Básica 80-84, S.A. de C.V.
002	530	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore XXI Banorte Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	534	001985	Siefore Básica 85-89	Fondo Profuturo SB 85-89, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001985	Siefore Básica 85-89	Principal Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	544	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Sura Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	550	001985	Siefore Básica 85-89	Inbursa Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	552	001985	Siefore Básica 85-89	Citibanamex Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	556	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Azteca Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	562	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Invercap Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	568	001985	Siefore Básica 85-89	Siefore Coppel Básica 85-9, S.A. de C.V.
002	578	001985	Siefore Básica 85-89	Más Pensión Siefore Básica 85-89, S.A. de C.V.
002	530	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore XXI Banorte Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	534	001990	Siefore Básica 90-94	Fondo Profuturo SB 90-94, S.A. de C.V., SIEFORE
002	538	001990	Siefore Básica 90-94	Principal Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	544	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Sura Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	550	001990	Siefore Básica 90-94	Inbursa Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	552	001990	Siefore Básica 90-94	Citibanamex Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	556	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Azteca Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	562	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Invercap Básica 90-94, S.A. de C.V.
002	568	001990	Siefore Básica 90-94	Siefore Coppel Básica 90-4, S.A. de C.V.
002	578	001990	Siefore Básica 90-94	Más Pensión Siefore Básica 90-94, S.A. de C.V.
003	334	000001	Siefore Aportaciones Complementarias Uno	Fondo Profuturo LP, S.A. de C.V, Siefore
004	430	000001	Siefore Previsión Social Uno	Multifondo de Previsión 1 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000002	Siefore Previsión Social Dos	Multifondo de Previsión 2 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000003	Siefore Previsión Social Tres	Multifondo de Previsión 3 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000004	Siefore Previsión Social Cuatro	Multifondo de Previsión 4 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000005	Siefore Previsión Social Cinco	Multifondo de Previsión 5 XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000006	Siefore Previsión Social Seis	Siefore ISSSTELEON, S.A. de C.V.
004	430	000007	Siefore Previsión Social Siete	XXI Banorte Previsión Social Corto Plazo Siefore, S.A. de C.V.
004	430	000008	Siefore Previsión Social Ocho	Siefore ISSEMYM, S.A. de C.V.

Catálogo de Subtipo de Entidades				
Clave de Tipo de Entidad	Clave de Entidad	Clave Subtipo de Entidad	Descripción	Razón Social
004	430	000009	Siefore Previsión Social Nueve	Siefore PMX-SAR S.A. de C.V.
004	430	000010	Siefore Previsión Social Diez	XXI Banorte Previsional Siefore, S.A. de C.V.
017	634	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Fondo Profuturo CP, S.A de C.V, Siefore
017	644	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Siefore SURA AV 3, S.A. de C.V.
017	644	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Siefore SURA AV 2, S.A. de C.V.
017	644	000003	Siefore Aportaciones Voluntarias Tres	Siefore SURA AV 1, S.A. de C.V.
017	652	000002	Siefore Aportaciones Voluntarias Dos	Citibanamex Siefore de Aportaciones Voluntarias Plus, S.A. de C.V.
017	630	000001	Siefore Aportaciones Voluntarias Uno	Ahorro Individual XXI Banorte Siefore, S.A. de C.V.

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

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

**VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO****Validaciones para formato de los datos**

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

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

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

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

Los dos, tres o seis decimales disponibles siempre ocuparán los dos, tres o seis caracteres más a la derecha, si la cantidad no tiene decimales, estos dos, tres o seis caracteres serán CEROS.

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

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

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

<sup>8</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

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

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

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

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

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

<sup>12</sup> El Ticker de Reuters es el identificador asignado por la plataforma Reuters. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

Políticas a seguir en la transmisión de la información

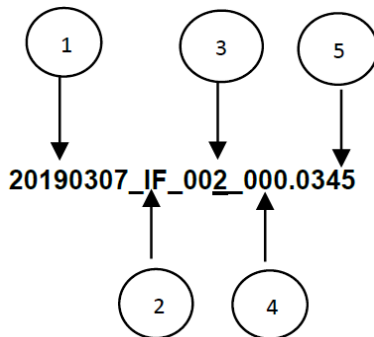
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los Intermediarios Financieros (Plataformas de Negociación Electrónicas, Administradores o Patrocinadores del Fondo Mutuo) distintos a los Custodios Internacionales de las Siefores.
- II. Las rutas en envío y recuperación de acuses a CONSAR para producción serán por SFTP, las cuales serán asignadas a cada Intermediario Financiero (Plataforma de Negociación Electrónica, Administrador o Patrocinador del Fondo Mutuo) una vez que cumplan con los requisitos establecidos en las Disposiciones de carácter general en materia financiera de los Sistemas de Ahorro para el Retiro.
- III. En el caso de los identificadores ISIN, CUSIP y SEDOL se deberán llenar en el siguiente orden:  
 1° ISIN, de no existir éste,  
 2° CUSIP o CINS, de no existir éste,  
 3° SEDOL.  
 Será obligatorio contar con por lo menos uno de ellos.
- IV. El nombre que deberá presentar el archivo a enviar por parte de los Intermediarios Financieros a CONSAR se compone de lo siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. <b>Constante = "IF"</b> .
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la clave del Catálogo de Entidad Contrapartes anexo al documento.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Sólo aplicará para familia de SIEFORES)
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, <b>Constante = 0345</b> .

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


Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la Entidad "Schroders Plc." (Intermediario Financiero), estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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






**A20190307\_IF\_002\_000.0345**

## Anexo 143



	<b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b>	356	<b>PROCESO:</b>	FINANCIERO
	<b>FUENTE:</b>	Intermediarios Financieros	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
<b>Información de Tipo Agregada.</b> - Este archivo contiene Información de la descomposición de vehículos accionarios, inmobiliarios, de deuda y de mercancías en sus distintos componentes, al cierre del tercer día hábil anterior al de entrega del formato.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
SEMANAL	ÚLTIMO DÍA HÁBIL DE LA SEMANA	369	De 7:00 a 18:00 Hrs.


## ENCABEZADO

ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de registros	-	N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro	-	N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = Constante "369". <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0356". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = Constante "034". <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo de Entidad Contrapartes, anexos. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	27	34	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco	-	AN	335	0	35	369	Vacios. <sup>5</sup>

## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	ID Vehículo		AN	12	0	4	15	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de la información, que sea único para cada Vehículo, el cual no deberá presentar cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Espacios en blanco	-	AN	354	0	16	369	Vacios. <sup>5</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: En este detalle se deberá incorporar la información del Vehículo reportado en el Subencabezado.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ISIN Vehículo	-	AN	12	0	4	15	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Vehículo reportado. <sup>6</sup>
3	CUSIP O CINS Vehículo	-	AN	9	0	16	24	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Vehículo reportado. <sup>7</sup>
4	SEDOL Vehículo	-	AN	7	0	25	31	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Vehículo reportado. <sup>8</sup>



DETALLE 1: En este detalle se deberá incorporar la información del Vehículo reportado en el Subencabezado.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
5	Clave Vehículo	-	AN	10	0	32	41	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Vehículo reportado. <sup>4</sup>
6	Ticker Bloomberg Vehículo	-	AN	20	0	42	61	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Vehículo reportado. <sup>9</sup>
7	Ticker Reuters Vehículo	-	AN	20	0	62	81	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Vehículo reportado. <sup>10</sup>
8	ID del Patrocinador	-	N	3	0	82	84	Se deberá anotar el identificador correspondiente al patrocinador que reporta la información, según el "Catálogo de Entidad Contrapartes". <sup>1</sup>
9	Tipo de Vehículo	-	N	2	0	85	86	Se deberá reportar el identificador del tipo de Vehículo que corresponda considerando su naturaleza preponderante según el "Catálogo de Tipos de Vehículo". <sup>1</sup>
10	Nombre descriptivo Vehículo	-	AN	60	0	87	146	Se deberá anotar un nombre descriptivo del Vehículo reportado. <sup>4</sup>
11	Valor del Vehículo	-	N	20	6	147	172	Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Vehículo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
12	Divisa de Cotización	-	N	2	0	173	174	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del vehículo reportado, según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
13	Valor del Fondo Primario	-	N	20	6	175	200	En caso de que el vehículo de inversión sea una serie de un fondo primario reportar el valor de los activos administrados de dicho fondo primario en la divisa de cotización. <sup>2</sup> En caso contrario reportar el "Valor del vehículo" del ID 12 anterior
14	País Regulador	-	N	2	0	201	202	Se reportará el identificador del país regulador del vehículo según el Catálogo de Países. <sup>1</sup>
15	Mercado	-	AN	6	0	203	208	Se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el vehículo conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". Si el vehículo cuenta con más de un mercado de cotización, se deberá reportar el mercado en que cuente con mayor volumen operado. <sup>4</sup>
16	Ratio de Gastos Totales	-	N	3	2	209	213	Se deberá reportar el valor del ratio de gastos totales (Total Expense Ratio) del vehículo al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
17	Nombre del Índice o Subíndice de referencia	-	AN	80	0	214	293	Se deberá reportar el nombre del Índice o Subíndice de referencia que replica el vehículo. <sup>4</sup>
18	Ticker Bloomberg del Índice o Subíndice de referencia	-	AN	20	0	294	313	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice o subíndice de referencia que replica el vehículo reportado. <sup>9</sup>
19	Proveedor del Índice o Subíndice de referencia	-	N	2	0	314	315	Se deberá reportar el ID del proveedor del Índice o subíndice de referencia que replica el vehículo según el Catálogo de "Proveedores de Índices". <sup>1</sup>
20	Observaciones	-	AN	40	0	316	355	En caso de reportar 99 en el campo "Proveedor de Índices" se deberá reportar el nombre de dicho proveedor en el presente campo. <sup>4</sup>
21	Espacios en blanco	-	AN	14	0	356	369	Vacios. <sup>5</sup>

**DETALLE 2:** En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el Subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ID Componente		AN	12	0	4	15	Se deberá reportar un identificador definido por el Proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Tipo de Activo	-	N	2	0	16	17	Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo". <sup>1</sup>
4	Tipo de Activo Subyacente	-	N	2	0	18	19	En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00". <sup>4</sup>

**DETALLE 2:** En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el Subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
5	ISIN	-	AN	12	0	20	31	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado. <sup>6</sup>
6	CUSIP O CINS	-	AN	9	0	32	40	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado. <sup>7</sup>
7	SEDOL	-	AN	7	0	41	47	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado. <sup>8</sup>
8	Clave	-	AN	10	0	48	57	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado. <sup>4</sup>
9	Ticker Bloomberg	-	AN	20	0	58	77	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al componente reportado. <sup>9</sup>
10	Ticker Reuters	-	AN	20	0	78	97	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al componente reportado. <sup>10</sup>
11	Nombre descriptivo del componente	-	AN	48	0	98	145	Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado. <sup>4</sup>
12	ISIN subyacente	-	AN	12	0	146	157	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>6</sup>
13	CUSIP O CINS subyacente	-	AN	9	0	158	166	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>7</sup>
14	SEDOL subyacente	-	AN	7	0	167	173	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>8</sup>
15	Clave subyacente	-	AN	10	0	174	183	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
16	Ticker Bloomberg subyacente	-	AN	20	0	184	203	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>9</sup>
17	Ticker Reuters subyacente	-	AN	20	0	204	223	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>10</sup>
18	Nombre descriptivo subyacente	-	AN	50	0	224	273	Para el caso en el que el componente que se reporta sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
19	País	-	N	2	0	274	275	En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países. <sup>1</sup>
20	Nombre País	-	AN	20	0	276	295	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
21	Mercado	-	AN	4	0	296	299	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>

**DETALLE 2:** En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Vehículo reportado en el Subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Vehículo. El nivel de descomposición de cada uno de los Vehículos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
22	País Regulador	-	N	2	0	300	301	En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el valor, conforme al "Catálogo de Países". En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, e deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países. <sup>1</sup>
23	Nombre País Regulador	-	AN	20	0	302	321	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En otro caso se deberán reportar espacios vacíos <sup>4</sup>
24	Divisa de cotización	-	N	2	0	322	323	Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas". <sup>1</sup>
25	Clave divisa	-	AN	3	0	324	326	En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes". En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
26	Sector	-	AN	20	0	327	346	Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo. <sup>4</sup>
27	Influencia	-	N	3	6	347	355	Se deberá anotar la influencia o peso del Componente dentro del vehículo, medido en puntos porcentuales. Para el caso de los instrumentos derivados deberá reportar la influencia con relación al valor notacional y en el sentido en el que vaya la posición (Si es larga el valor de la influencia deberá ser positivo y si es corta el valor de la influencia deberá ser un valor negativo) <sup>2</sup>
28	Calificadora Componente primera	-	N	3	0	356	358	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
29	Calificación Homologada del Componente primera	-	N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
30	Calificadora Componente segunda	-	N	3	0	363	365	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
31	Calificación Homologada del Componente segunda	-	N	4	0	366	369	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>

## CATÁLOGO(S)

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

Catálogo Entidad Contrapartes		
Clave	Identificador	Descripción
001	900000	Otros
002	900001	Schroders Plc.
003	900002	Blackrock Inc.
004	900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
005	900004	Amundi Asset Management
006	900005	Nomura Holdings, Inc .
008	900007	Wellington Management Company LLP
009	900008	Ninety One PLC
010	900009	Alliance Bernstein
012	950001	Allfunds Bank, S.A.U.
013	950002	Fundvest, Pershing LLC
014	950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB
015	900011	Fidelity International
016	900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
017	900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.
018	900014	Goldman Sachs Asset Management International
019	900015	Morgan Stanley Investment Management Inc
020	900016	Vanguard Group
021	900017	Natixis
022	900018	WisdomTree Investments, Inc.
023	900019	State Street Corporation
024	900020	DWS Investments
025	900021	Sherpa Capital
026	900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
027	900023	FirstTrust
028	900024	Baillie Gifford
029	900025	UBS AG
030	900026	AXA Invesment Managers
031	900027	BNP Paribas Asset Management
032	900028	GAM Holding AG
033	900029	Invesco Capital Management
034	900030	Janus Henderson Investors
035	900031	Jupiter Asset Management Limited
036	900032	NN Investment Partners B.V.
037	900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
038	900034	Columbia Threadneedle Investments

Catálogo Entidad Contrapartes		
Clave	Identificador	Descripción
039	900035	UTI Asset Management
040	900036	Nikko Asset Management
041	900037	Global X
042	900038	VanEck
043	900039	KraneShares
044	900040	ProShares
045	900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
046	900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
047	900043	Acadian Asset Management LLC
048	900044	Man Group
049	900045	Berenberg
050	900046	Finamex
051	900047	ODDO BHF Asset Management SAS

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
01	MXP	Peso
02	USD	Dólar Americano
03	UDI	Unidades de Inversión
06	JPY	Yen Japonés
07	EUR	Euros
08	AUD	Dólar Australiano
09	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipos de Activo	
Identificador	Descripción
00	No aplica
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Inmobiliario <sup>11</sup>
05	Instrumentos Financieros Derivados
06	Vehículos de Inversión <sup>12</sup>
07	Fondo Mutuo
08	Reportos
09	Préstamo de Valores
10	Efectivo
99	Otro

Catálogo de Tipos de Activos subyacentes	
Identificador	Descripción
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Inmobiliario <sup>11</sup>
05	Divisas
99	Otro

Catálogo de Tipos de Vehículo	
Identificador	Descripción
01	Accionario
02	Inmobiliario <sup>11</sup>
03	Mercancías
04	Renta Fija
05	Mixto
99	Otro

Catálogo de Países				
Identificador	Descripción		Identificador	Descripción
01	Alemania		27	Hungría
02	Australia		28	Letonia
03	Austria		29	Lituania
04	Bélgica		30	Malta
05	Canadá		31	República Checa
06	Dinamarca		32	Suecia
07	España		33	Brasil
08	Estados Unidos de Norteamérica		34	China
09	Finlandia		35	India
10	Francia		36	Otro
11	Grecia		37	Rumanía
12	Países Bajos (Holanda)		38	Noruega
13	Hong Kong		39	Chile
14	Irlanda		40	Israel
15	Italia		41	Bulgaria
16	Japón		42	Colombia
17	Luxemburgo		43	Corea del Sur
18	México		44	Islandia
19	Polonia		45	Perú
20	Portugal		46	Singapur
21	Reino Unido de la Gran Bretaña		47	Malasia
22	Suiza		48	Nueva Zelanda
23	Chipre		49	Sudáfrica
24	Eslovaquia		50	Tailandia
25	Eslovenia		51	Taiwán
26	Estonia		52	Croacia

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México
99	Otra	

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
Calificaciones Corto Plazo en Escala Local						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			HR D			1056
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045
CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048
D	D	D	HR D (G)		D	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055

Proveedores de Índices			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
01	FTSE	17	InteractiveData
02	Barclays	18	SocieteGeneral
03	NYSE	19	IPOX
04	ICE	20	Stoxx
05	BolsaMexico	21	JohnHancock
06	WisdomTree	22	BolsaJapon
07	CRSP	23	Morningstar
08	BolsaAlemania	24	BolsaFrancia
09	SPDJJ	25	Russell
10	Nasdaq	26	ScientificBeta
11	MSCI	27	Solactive
12	GoldmanSachs	28	SSGA
13	BolsaEspana	29	Valmer
14	INDXX	30	Tokio Stock Exchange
15	iBoxx	99	Otro
16	ISE		

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apóstrofes; en caso de no existir, se anotará un espacio vacío. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

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

<sup>6</sup> ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

1 y 2: corresponden al prefijo del país.

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

<sup>7</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.



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

<sup>8</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Oficial List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

<sup>9</sup> El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

<sup>11</sup> Hace referencia a FIBRAS, REITS o similares.

<sup>12</sup> Hace referencia a ETFs de cualquier tipo de subyacente o Vehículos inmobiliarios.

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

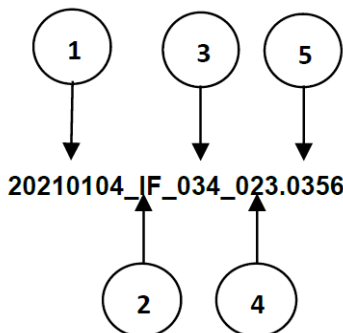
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. ÉL envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del protocolo de transferencia de archivos SFTP.
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Vehículos.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	Tipo de Dato	Descripción
1	8 DÍgitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 DÍgitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. Constante = "IF".
3	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la 'Clave' del Catálogo tipo de entidad anexo al documento. Constante: 034
4	3 DÍgitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la 'Clave' del Catálogo Entidad Contraparte anexo al documento.
5	4 DÍgitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = 0356.

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


Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la entidad State Street Corporation (Intermediario Financiero) estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

**A20210104\_IF\_034\_023.0356**

## Anexo 144

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO:</b>	0357	<b>PROCESO:</b>	FINANCIERO
	<b>FUENTE:</b>	Intermediarios Financieros	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	



DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
Información de Tipo Agregada. - Este archivo contiene la última información pública disponible de la composición de Fondos Mutuos, al cierre del último día hábil correspondiente a dos meses anteriores a la entrega del formato.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
MENSUAL	QUINTO DÍA HÁBIL DEL MES	369	De 7:00 a 18:00 Hrs.

## ENCABEZADO

ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato de transmisión.


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de registros	-	N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro	-	N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = Constante "369". <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0357". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad que reporta la información, de acuerdo al Catálogo de Tipos de Entidad anexo = Constante "034". <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad que reporta la Información de acuerdo al Catálogo Entidad Contrapartes, anexos. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	27	34	Fecha de la Información que se reporta. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco	-	AN	335	0	35	369	Vacios. <sup>5</sup>

## SUBENCABEZADO

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "101". <sup>1</sup>
2	ID Fondo Mutuo		AN	12	0	4	15	Se deberá reportar un identificador definido por el proveedor de la información, que sea único para cada Fondo Mutuo, y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Espacios en blanco	-	AN	354	0	16	369	Vacios. <sup>5</sup>

## DETALLE(S)

DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información del Fondo Mutuo reportado en el Subencabezado.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "301". <sup>1</sup>
2	ISIN Fondo Mutuo	-	AN	12	0	4	15	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del Fondo Mutuo reportado. <sup>6</sup>
3	CUSIP O CINS Fondo Mutuo	-	AN	9	0	16	24	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS Fondo Mutuo reportado. <sup>7</sup>

DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información del Fondo Mutuo reportado en el Subencabezado.								
Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
4	SEDOL Fondo Mutuo	-	AN	7	0	25	31	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del Fondo Mutuo reportado. <sup>8</sup>
5	Clave Fondo Mutuo	-	AN	10	0	32	41	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del Fondo Mutuo reportado. <sup>4</sup>
6	Ticker Bloomberg Fondo Mutuo	-	AN	20	0	42	61	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al Fondo Mutuo reportado. <sup>9</sup>
7	Ticker Reuters Fondo Mutuo	-	AN	20	0	62	81	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al Fondo Mutuo reportado. <sup>10</sup>
8	ID del Administrador	-	N	3	0	82	84	Se deberá anotar el identificador correspondiente al administrador que reporta la información, según el "Catálogo de Entidad Contrapartes". <sup>1</sup>
9	Tipo de Fondo Mutuo	-	N	2	0	85	86	Se deberá reportar el identificador del tipo de Fondo Mutuo que corresponda considerando su naturaleza preponderante, según el "Catálogo de Tipos de Vehículo". <sup>1</sup>
10	Nombre descriptivo del Fondo Mutuo	-	AN	60	0	87	146	Se deberá anotar un nombre descriptivo del Fondo Mutuo reportado. <sup>4</sup>
11	Valor del Fondo Mutuo	-	N	20	6	147	172	Se deberá reportar el valor a mercado de los activos administrados (AUMS) del Fondo Mutuo en la divisa de cotización al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
12	Valor Unitario	-	N	10	6	173	188	En este campo se debe reportar el precio unitario de cada acción del Fondo Mutuo a la fecha del reporte de información. <sup>2</sup>
13	Valor del Fondo Primario	-	N	20	6	189	214	En caso de que el fondo mutuo sea una serie de un fondo primario reportar el valor de los activos administrados de dicho fondo primario en la divisa de cotización. <sup>2</sup> En caso contrario reportar el "Valor del Fondo Mutuo" del ID 12 anterior
14	Divisa del Fondo Mutuo	-	N	2	0	215	216	Se deberá reportar el identificador de la divisa asociada al Fondo Mutuo reportado de conformidad con el "Catálogo de Divisa". <sup>1</sup>
15	Ratio de Gastos Totales	-	N	3	4	217	223	Se deberá reportar el valor del ratio de gastos totales (Total Expense Ratio) del Fondo Mutuo al cierre de la fecha de reporte de información. <sup>2</sup>
16	País regulador	-	N	2	0	224	225	Se deberá indicar el país de origen del organismo encargado de regular el Fondo Mutuo, conforme al "Catálogo de Países". En caso contrario se deberá utilizar el indicador "36" del Catálogo de Países. <sup>1</sup>
17	Nombre País regulador	-	AN	20	0	226	245	En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor. En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos. <sup>4</sup>
18	Nombre del Índice o Subíndice de referencia	-	AN	50	0	246	295	Se deberá reportar el nombre del Índice o Subíndice de referencia del Fondo Mutuo. <sup>4</sup>
19	Ticker Bloomberg del Índice o Subíndice de referencia	-	AN	20	0	296	315	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al índice o subíndice del Fondo Mutuo. <sup>9</sup>
20	Proveedor del Índice o Subíndice de referencia	-	N	2	0	316	317	Se deberá reportar el ID del proveedor del índice o subíndice del Fondo Mutuo según el Catálogo de "Proveedores de Índices". <sup>1</sup>
21	Observaciones	-	AN	40	0	318	357	En caso de reportar 99 en el campo "Proveedor de Índices" se deberá reportar el nombre de dicho proveedor en el presente campo. <sup>4</sup>
22	Espacios en blanco	-	AN	12	0	358	369	Vacios. <sup>5</sup>

DETALLE 2: En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Fondo Mutuo del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Fondo Mutuo. El nivel de descomposición de cada uno de los Fondo Mutuos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "302". <sup>1</sup>
2	ID Componente		AN	12	0	4	15	Se deberá reportar un identificador definido por el proveedor de información, que sea único para cada componente reportado en el presente formato y que no presente cambios a lo largo del tiempo. <sup>4</sup>
3	Tipo de Activo	-	N	2	0	16	17	Se deberá anotar el identificador del tipo de activo correspondiente al componente reportado, conforme al "Catálogo de Tipos de Activo". <sup>1</sup>
4	Tipo de Activo Subyacente	-	N	2	0	18	19	En caso de que el Tipo de Activo reportado se trate de un Derivado, se deberá anotar el identificador del tipo de activo subyacente del derivado conforme al "Catálogo de Tipos de Activos subyacentes", en otro caso, reportar en "00". <sup>1</sup>
5	ISIN	-	AN	12	0	20	31	En caso de que exista, se deberá anotar la clave del ISIN del componente reportado. <sup>6</sup>
6	CUSIP O CINS	-	AN	9	0	32	40	En caso de que exista, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del componente reportado. <sup>7</sup>
7	SEDOL	-	AN	7	0	41	47	En caso de que exista, se deberá anotar la clave SEDOL del componente reportado. <sup>8</sup>
8	Clave	-	AN	10	0	48	57	En caso de que exista, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del componente reportado. <sup>4</sup>
9	Ticker Bloomberg	-	AN	20	0	58	77	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al componente reportado. <sup>9</sup>
10	Ticker Reuters	-	AN	20	0	78	97	En caso de que exista, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al componente reportado. <sup>10</sup>
11	Nombre descriptivo del componente	-	AN	48	0	98	145	Se deberá anotar un nombre descriptivo del componente reportado. <sup>4</sup>
12	ISIN subyacente	-	AN	12	0	146	157	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave ISIN del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>6</sup>
13	CUSIP O CINS subyacente	-	AN	9	0	158	166	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave CUSIP o el CINS del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>7</sup>
14	SEDOL subyacente	-	AN	7	0	167	173	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave SEDOL del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>8</sup>
15	Clave subyacente	-	AN	10	0	174	183	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar la clave de cotización (pizarra) del subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>
16	Ticker Bloomberg subyacente	-	AN	20	0	184	203	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Bloomberg al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>9</sup>
17	Ticker Reuters subyacente	-	AN	20	0	204	223	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar el ticker que asigna Reuters al subyacente del componente reportado en caso de que exista. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>10</sup>
18	Nombre descriptivo subyacente	-	AN	50	0	224	273	Para el caso en el que el componente que se reporte sea un derivado, se deberá anotar un nombre descriptivo para subyacente del componente reportado. Se deberá dejar vacío en otro caso. <sup>4</sup>

DETALLE 2: En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Fondo Mutuo del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Fondo Mutuo. El nivel de descomposición de cada uno de los Fondo Mutuos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
19	País	-	N	2	0	274	275	<p>En caso de que el componente sea un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del valor, conforme al "Catálogo de Países".</p> <p>En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar el identificador correspondiente al país de origen del emisor del subyacente, conforme al "Catálogo de Países".</p> <p>En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.<sup>1</sup></p>
20	Nombre País	-	AN	20	0	276	295	<p>En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.</p> <p>En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.<sup>4</sup></p>
21	Mercado	-	AN	4	0	296	299	<p>En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el componente reportado, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".</p> <p>En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá anotar la clave del mercado en que cotiza el subyacente, conforme al estándar "ISO10383 - Market Identifier Codes (MIC)".</p> <p>En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.<sup>4</sup></p>
22	País Regulador	-	N	2	0	300	301	<p>En caso de que el componente sea un valor o mercancía, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado de regular el valor, conforme al "Catálogo de Países".</p> <p>En caso de que el componente sea un derivado cuyo subyacente es un valor, se deberá indicar el país de origen del organismo encargado regular el subyacente conforme al "Catálogo de Países".</p> <p>En caso contrario se deberá utilizar el indicador "00" del catálogo de países.<sup>1</sup></p>
23	Nombre País Regulador	-	AN	20	0	302	321	<p>En caso de que el identificador del país reportado en el campo "País Regulador" sea 36, se deberá indicar el nombre del país de origen del emisor del valor.</p> <p>En otro caso se deberán reportar espacios vacíos.<sup>4</sup></p>
24	Divisa de cotización	-	N	2	0	322	323	<p>Se reportará el identificador de la divisa de cotización del componente reportado, según el "Catálogo de Divisas".<sup>1</sup></p>
25	Clave divisa	-	AN	3	0	324	326	<p>En caso de que la clave reportada en el campo "Divisa de cotización" sea 99, se deberá indicar la clave de la divisa de cotización del componente reportado, conforme al estándar "ISO4217 - Currency codes".</p> <p>En caso contrario se deberán reportar espacios vacíos.<sup>4</sup></p>
26	Sector	-	AN	20	0	327	346	<p>Se deberá indicar el nombre descriptivo del sector al que pertenece el componente reportado. Los criterios bajo los cuáles se asigna el presente sector deben mantenerse sin cambios a lo largo del tiempo salvo en el caso en el que exista alguna justificación para realizar cambios al mismo.<sup>4</sup></p>
27	Influencia	-	N	3	6	347	355	<p>Se deberá anotar la influencia o porcentaje de participación del Componente dentro del Fondo Mutuo, medido en puntos porcentuales.<sup>2</sup></p> <p>Para el caso de los instrumentos derivados deberá reportar la influencia con relación al valor notional y en el sentido en el que vaya la posición (Si es larga el valor de la influencia deberá ser positivo y si es corta el valor de la influencia deberá ser un valor negativo).</p>

DETALLE 2: En este detalle se deberá incorporar la información de los activos financieros que componen al Fondo Mutuo del subencabezado, así como la influencia que cada componente tiene dentro del Fondo Mutuo. El nivel de descomposición de cada uno de los Fondo Mutuos debe ser el de mayor granularidad, de tal manera que cada componente no pueda ser descompuesto a su vez en otros activos financieros, salvo para el caso en el que se reporten instrumentos financieros derivados.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
28	Calificadora Componente primera	-	N	3	0	356	358	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del Componente primera" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
29	Calificación Homologada del Componente primera	-	N	4	0	359	362	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>
30	Calificadora Componente segunda	-	N	3	0	363	365	Se deberá anotar el identificador correspondiente a la calificadora que emite la calificación reportada en el concepto "Calificación Homologada del componente segunda" de acuerdo al catálogo de Calificadoras. En otro caso se deberá anotar 000. <sup>1</sup>
31	Calificación Homologada del Componente segunda	-	N	4	0	366	369	Se deberá anotar el identificador de la calificación que corresponde al componente conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En caso de que el componente sea un derivado, un reporto o préstamo de valores, se deberá anotar el identificador conforme al Catálogo de Calificaciones Homologadas correspondiente a la contraparte o a la cámara de compensación en la cual se realice la liquidación. Esta deberá ser la segunda calificación mínima crediticia de acuerdo a las disposiciones de carácter general que establecen el régimen de inversión. En otro caso se deberá anotar 0000. <sup>1</sup>

## CATÁLOGO(S)

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

Catálogo Entidad Contrapartes		
Clave	Identificador	Descripción
001	900000	Otros
002	900001	Schroders Plc.
003	900002	Blackrock Inc.
004	900003	Franklin Templeton Investment Management Ltd.
005	900004	Amundi Asset Management
006	900005	Nomura Holdings, Inc .
008	900007	Wellington Management Company LLP
009	900008	Ninety One PLC
010	900009	Alliance Bernstein
012	950001	Allfunds Bank, S.A.U.
013	950002	Fundvest, Pershing LLC
014	950003	MFEX Mutual Funds Exchange AB
015	900011	Fidelity International
016	900012	J.P. Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.
017	900013	Pictet Asset Management (Europe) S.A.
018	900014	Goldman Sachs Asset Management International
019	900015	Morgan Stanley Investment Management Inc
020	900016	Vanguard Group
021	900017	Natixis
022	900018	WisdomTree Investments, Inc.
023	900019	State Street Corporation
024	900020	DWS Investments
025	900021	Sherpa Capital
026	900022	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria (BBVA)
027	900023	FirstTrust
028	900024	Baillie Gifford
029	900025	UBS AG
030	900026	AXA Invesment Managers
031	900027	BNP Paribas Asset Management
032	900028	GAM Holding AG
033	900029	Invesco Capital Management
034	900030	Janus Henderson Investors
035	900031	Jupiter Asset Management Limited
036	900032	NN Investment Partners B.V.
037	900033	Pacific Investment Management Company LLC ("PIMCO")
038	900034	Columbia Threadneedle Investments
039	900035	UTI Asset Management
040	900036	Nikko Asset Management
041	900037	Global X
042	900038	VanEck
043	900039	KraneShares
044	900040	ProShares
045	900041	Brown Advisory (Ireland) Limited
046	900042	Robeco Institutional Asset Management B.V.
047	900043	Acadian Asset Management LLC
048	900044	Man Group
049	900045	Berenberg
050	900046	Finamex
051	900047	ODDO BHF Asset Management SAS

Catálogo de Divisa		
Id	Clave	Descripción
01	MXP	Peso
02	USD	Dólar Americano
03	UDI	Unidades de Inversión
06	JPY	Yen Japonés
07	EUR	Euros
08	AUD	Dólar Australiano
09	CAD	Dólar Canadiense
10	CHF	Franco Suizo
11	GBP	Libra Esterlina
12	HKD	Dólar Hong Kong
13	DKK	Corona Danesa
14	SEK	Corona Sueca
15	NOK	Corona Noruega
16	BRL	Real Brasileño
17	ILS	Shekel Israelí
18	CLP	Peso Chileno
19	INR	Rupia
20	CNY	Renminbi chino
21	PLN	Zloty Polaco
22	CZK	Corona checa
23	HUF	Florín Húngaro
24	RON	Leu Rumano
25	LVL	Lats Letones
26	LTL	Litas Lituanas
27	EEK	Corona Estonia
28	BGN	Lev Búlgaro
29	ISK	Corona Islandesa
30	COP	Peso Colombiano
31	KRW	Won Surcoreano
32	PEN	Nuevo Sol Peruano
33	SGD	Dólar de Singapur
99	OTR	Otras Divisas

Catálogo de Tipos de Activo	
Identificador	Descripción
00	No aplica
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Inmobiliario <sup>11</sup>
05	Instrumentos Financieros Derivados
06	Vehículos de Inversión <sup>12</sup>
07	Fondo Mutuo
08	Reportos
09	Préstamo de Valores
10	Efectivo
99	Otro

Catálogo de Tipos de Activos subyacentes	
Identificador	Descripción
01	Acción
02	Mercancías
03	Renta Fija
04	Inmobiliario <sup>11</sup>
05	Divisas
99	Otro

Catálogo de Tipos de Vehículo	
Identificador	Descripción
01	Accionario
02	Inmobiliario <sup>11</sup>
03	Mercancías
04	Renta Fija
05	Mixto
99	Otro



Catálogo de Países					
Identificador	Descripción		Identificador	Descripción	
01	Alemania		27	Hungría	
02	Australia		28	Letonia	
03	Austria		29	Lituania	
04	Bélgica		30	Malta	
05	Canadá		31	República Checa	
06	Dinamarca		32	Suecia	
07	España		33	Brasil	
08	Estados Unidos de Norteamérica		34	China	
09	Finlandia		35	India	
10	Francia		36	Otro	
11	Grecia		37	Rumanía	
12	Países Bajos (Holanda)		38	Noruega	
13	Hong Kong		39	Chile	
14	Irlanda		40	Israel	
15	Italia		41	Bulgaria	
16	Japón		42	Colombia	
17	Luxemburgo		43	Corea del Sur	
18	México		44	Islandia	
19	Polonia		45	Perú	
20	Portugal		46	Singapur	
21	Reino Unido de la Gran Bretaña		47	Malasia	
22	Suiza		48	Nueva Zelanda	
23	Chipre		49	Sudáfrica	
24	Eslovaquia		50	Tailandia	
25	Eslovenia		51	Taiwán	
26	Estonia		52	Croacia	

Catálogo de Agencias Calificadoras		
Identificador	Descripción	Abreviación
1	Standard & Poor's, S.A. de C.V.	S&P
4	Fitch México, S.A. de C.V.	FITCH
5	Moody's de México SA de CV	MOODY'S
6	HR Ratings de México S.A. de C.V.	HR Ratings
7	Verum, Calificadora de Valores, S.A.P.I. de C.V.	Verum
8	DBRS Ratings México, Institución Calificadora de Valores S.A. de C.V.	DBRS Ratings México
99	Otra	

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Local						
AAA (mex)	AAA.mx	mxAAA	HR AAA	AAA/M	AAA.MX	1000
AA+ (mex)	AA+.mx	mxAA+	HR AA+	AA+/M	AA.MX(alto)	1001
AA (mex)	AA.mx	mxAA	HR AA	AA/M	AA.MX	1002
AA- (mex)	AA-.mx	mxAA-	HR AA-	AA-/M	AA.MX(bajo)	1003
A+ (mex)	A+.mx	mxA+	HR A+	A+/M	A.MX(alto)	1004
A (mex)	A.mx	mxA	HR A	A/M	A.MX	1005
A- (mex)	A-.mx	mxA-	HR A-	A-/M	A.MX(bajo)	1006
BBB+ (mex)	BBB+.mx	mxBBB+	HR BBB+	BBB+/M	BBB.MX(alto)	1007
BBB (mex)	BBB.mx	mxBBB	HR BBB	BBB/M	BBB.MX	1008

Catálogo de Calificaciones Homologadas						
Fitch IBCA	Moody's	Standard & Poor's	HR Ratings	VERUM	DBRS Ratings México	Identificador
BBB- (mex)	BBB-.mx	mxBBB-	HR BBB-	BBB-/M	BBB.MX(bajo)	1009
BB+ (mex)	BB+.mx	mxBB+	HR BB+	BB+/M	BB.MX(alto)	1010
BB (mex)	BB.mx	mxBB	HR BB	BB/M	BB.MX	1011
BB- (mex)	BB-.mx	mxBB-	HR BB-	BB-/M	BB.MX(bajo)	1012
B+ (mex)	B+.mx	mxB+	HR B+	B+/M	B.MX(alto)	1013
B (mex)	B.mx	mxB	HR B	B/M	B.MX	1014
B- (mex)	B-.mx	mxB-	HR B-	B-/M	B.MX(bajo)	1015
CCC+ (mex)	CCC+.mx	mxCCC+	HR C+		CCC.MX(alto)	1016
CCC (mex)	CCC.mx	mxCCC			CCC.MX	1017
CCC- (mex)	CCC-.mx	mxCCC-			CCC.MX(bajo)	1018
CC (mex)	CC.mx	mxCC	HR C	C/M	CC.MX	1019
C (mex)	C.mx	mxC	HR C-		C.MX	1020
D (mex)		mxD	HR D	D/M	D.MX	1021
Calificaciones Corto Plazo en Escala Local						
F1+ (mex)	ML A-1.mx	mxA-1+	HR+1	1+/M	R-1.MX(alto)	1022
F1 (mex)	ML A-2.mx	mxA-1	HR1	1/M	R-1.MX(medio)	1023
F2 (mex)	ML A-3.mx	mxA-2	HR2	2/M	R-1.MX(bajo)	1024
F3 (mex)		mxA-3	HR3	3/M	R-2.MX - R-3.MX	1025
B (mex)	ML B.mx	mxB	HR4	4/M	R-4.MX - R-5.MX	1026
C (mex)	ML C.mx	mxC	HR5	D/M	D.MX	1027
			HR D			1056
Calificaciones Mediano y Largo Plazo en Escala Global						
AAA	Aaa	AAA	HR AAA (G)		AAA	1028
AA+	Aa1	AA+	HR AA+ (G)		AA(high)	1029
AA	Aa2	AA	HR AA (G)		AA	1030
AA-	Aa3	AA-	HR AA- (G)		AA(low)	1031
A+	A1	A+	HR A+ (G)		A(high)	1032
A	A2	A	HR A (G)		A	1033
A-	A3	A-	HR A- (G)		A(low)	1034
BBB+	Baa1	BBB+	HR BBB+ (G)		BBB(high)	1035
BBB	Baa2	BBB	HR BBB (G)		BBB	1036
BBB-	Baa3	BBB-	HR BBB- (G)		BBB(low)	1037
BB+	Ba1	BB+	HR BB+ (G)		BB(high)	1038
BB	Ba2	BB	HR BB (G)		BB	1039
BB-	Ba3	BB-	HR BB- (G)		BB(low)	1040
B+	B1	B+	HR B+ (G)		B(high)	1041
B	B2	B	HR B (G)		B	1042
B-	B3	B-	HR B- (G)		B(low)	1043
CCC+	Caa1	CCC+	HR C+ (G)		CCC(high)	1044
CCC	Caa2	CCC			CCC	1045
CCC-	Caa3	CCC-			CCC(low)	1046
CC	Ca	CC	HR C (G)		CC	1047
C	C	C	HR C- (G)		C	1048
D	D	D	HR D (G)		D	1049
Calificaciones Corto Plazo en Escala Global						
F1+	P-1	A-1+	HR+1 (G)		R-1(high)	1050
F1		A-1	HR1 (G)		R-1(middle)	1051
F2	P-2	A-2	HR2 (G)		R-1(low)	1052
F3	P-3	A-3	HR3 (G)		R-2 - R-3	1053
B			HR4 (G)		R-4 - R-5	1054
C			HR5 (G)		D	1055

Proveedores de Índices			
Identificador	Descripción	Identificador	Descripción
01	FTSE	17	InteractiveData
02	Barclays	18	SocieteGeneral
03	NYSE	19	IPOX
04	ICE	20	Stoxx
05	BolsaMexico	21	JohnHancock
06	WisdomTree	22	BolsaJapon
07	CRSP	23	Morningstar
08	BolsaAlemania	24	BolsaFrancia
09	SPDJI	25	Russell
10	Nasdaq	26	ScientificBeta
11	MSCI	27	Solactive
12	GoldmanSachs	28	SSGA
13	BolsaEspana	29	Valmer
14	INDXX	30	Tokio Stock Exchange
15	iBoxx	99	Otro
16	ISE		



### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

<sup>4</sup> Dato alfanumérico. Debe estar justificado a la izquierda, con mayúsculas sin acentos y sin apóstrofes; en caso de no existir, se anotará un espacio vacío. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios; en el caso de existir una ñ debe ser el código ASCII "ALT+0209" de Windows. Todos los caracteres deberán estar en mayúsculas.

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

<sup>6</sup> ISIN o "International Securities Identification Number" el cual consta de 12 caracteres donde:

1 y 2: corresponden al prefijo del país.

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

<sup>7</sup> CUSIP o "Committee on Uniform Securities Identification Procedures" o CINS "CUSIP International Numbering System", el CINS es el CUSIP internacional y tienen el mismo formato, los instrumentos que no cuentan con CUSIP cuentan con CINS y constan de 9 caracteres.

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

<sup>8</sup> SEDOL o "Stock Exchange Daily Official List" es la clave asignada por la Internacional Stock Exchange of London para activos internacionales y consta de 7 caracteres.

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

<sup>9</sup> El ticker Bloomberg es el identificador asignado por la plataforma Bloomberg. Deberá estar justificado a la izquierda, en caso de no existir, se anotará un CERO. Si la longitud del dato real es menor a la especificada, se llenarán los espacios vacíos con blancos o espacios.

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

<sup>11</sup> Hace referencia a FIBRAS, REITS o similares.

<sup>12</sup> Hace referencia a ETFs de cualquier tipo de subyacente o Vehículos inmobiliarios.

**POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

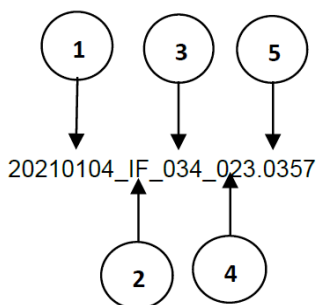
La información que será transmitida a la Comisión en base a este formato, se sujetará a las siguientes políticas:

- I. El envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través del protocolo de transferencia de archivos SFTP.
- II. Este formato de transmisión de información por proceso deberá ser enviado por el Proveedor de los Fondos Mutuos.
- III. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	Tipo de Dato	Descripción
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipo de Entidad anexo al documento. Constante = "IF".
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la clave del Catálogo tipo de entidad anexo al documento. Constante = "034".
4	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la 'Clave' del Catálogo Entidad Contraparte anexo al documento.
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número constante para este caso será, Constante = "0357".

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


Para ejemplificarlo a continuación se presenta el caso en que la entidad State Street Corporation (Intermediario Financiero) estuviera enviando su información, el nombre del archivo tiene que ser de la siguiente manera:



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

A20210104\_IF\_034\_023.0357

Anexo 148

	<b>FORMATO DEL ARCHIVO :</b>	<b>0358</b>	<b>PROCESO :</b>	<b>FINANCIERO</b>
	<b>FUENTE :</b>	<b>AFORE</b>	<b>ACTUALIZACIÓN:</b>	

DESCRIPCIÓN DEL FORMATO			
Información de Tipo Agregada.- Este archivo contiene los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores.			
PERIODICIDAD DE ENVÍO	PERÍODO DE RECEPCIÓN	LONGITUD DEL REGISTRO	HORARIO DE TRANSMISIÓN
DIARIO	DIARIO	129	07:00 a 10:00 Hrs.




**ENCABEZADO**

ENCABEZADO: Contiene información sobre las características del formato de transmisión


Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		N	3	0	1	3	Identificador de registro (para control del sistema) = Constante "000". <sup>1</sup>
2	Número de registros	:	N	10	0	4	13	Número de Registros que contiene el archivo incluyendo el encabezado. <sup>1</sup>
3	Tamaño del registro	:	N	3	0	14	16	Número de caracteres por registro = Constante "129". <sup>1</sup>
4	Tipo de archivo		N	4	0	17	20	Identificador de archivo (para control del sistema) = Constante "0358". <sup>1</sup>
5	Tipo de Entidad		N	3	0	21	23	Clave del Tipo de Entidad Siefore que reporta la información, de acuerdo con el Catálogo de Tipos de Entidades del Catálogo General Apartado Circular 19, Constante = "001". <sup>1</sup>
6	Entidad		N	3	0	24	26	Clave de Entidad AFORE a que corresponda la Información de acuerdo a los Catálogos de Entidades (AFORE), anexos. <sup>1</sup>
7	Fecha de información		F	8	0	27	34	Fecha de la Información a que se reporta que corresponde al cierre del día hábil anterior al de entrega del formato. <sup>3</sup>
8	Espacios en blanco		AN	95	0	35	129	Vacios. <sup>5</sup>

**DETALLES**

DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información de los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
1	Tipo de Registro		AN	2	0	1	2	Identificador de registro Constante "301" <sup>4</sup> .
2	Tipo de Mercado		AN	2	0	3	4	Se deberá reportar "MD" cuando se refiera a instrumentos de Mercado de Deuda o "MC" cuando se refiera a instrumentos de Mercado de Capitales. <sup>4</sup>
3	ISIN		AN	12	0	5	16	Se deberá anotar la clave del ISIN <sup>5</sup> .
4	CUSIP o CINS		AN	9	0	17	25	Se deberá anotar la clave del CUSIP o el CINS <sup>6</sup> .
5	SEDOL		AN	7	0	26	32	Se deberá anotar la clave del SEDOL <sup>7</sup> .
6	Tipo de Valor		AN	4	0	33	36	Tipo de Valor <sup>4</sup> .
7	Emisora		AN	7	0	37	43	Nombre de la Emisora <sup>4</sup> .
8	Serie		AN	7	0	44	50	Serie de la Emisora. Para los instrumentos cuya serie refleje la fecha de

DETALLE 1: En este detalle se deberá reportar la información de los precios de Activos Objeto de Inversión que se encuentren en cartera de las SIEFORES en caso de que el precio de estos no pueda ser proporcionado por el Proveedor de precios o Custodio derivado de la cancelación o baja de su listado en una Bolsa de Valores.

Id	Concepto	Dato	Tipo	Longitud		Posición		Observaciones
				Ent.	Dec.	De:	A:	
								vencimiento del mismo, la serie reportada deberá ser consistente con la información recibida por esta Comisión de Ineval. <sup>4</sup> .
9	Consecutivo		AN	10	0	51	60	Clave que se le otorgó como consecutivo al activo <sup>4</sup> .
10	Precio Sucio		N	9	6	61	75	Precio de valuación en pesos calculado por la AFORE, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
11	Precio Limpio		N	9	6	76	90	En caso de que el ID 2 "Tipo de Mercado" sea "MD", se deberá indicar el Precio Sucio devengando los intereses al día de valuación, en pesos, computado por la AFORE, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> . En otro caso deberán reportar el Precio de valuación en pesos calculado por la AFORE, deberá ser 24hrs <sup>2</sup> .
12	Intereses		N	6	6	91	102	En caso de que el ID 2 "Tipo de Mercado" sea "MD", se deberá indicar el Factor de Interés en pesos que se aplica al título de acuerdo a las características del mismo calculado al día de valuación por la AFORE <sup>2</sup> . En otro caso deberán reportar ceros <sup>2</sup>
13	Días por Vencer		N	6	0	103	108	Son los días que faltan para el vencimiento de la emisión <sup>1</sup> .
14	Tasa de descuento		N	3	6	109	117	Tasa de Descuento de la Emisión <sup>2</sup> .
15	Tasa de Rendimiento		N	6	6	118	129	Para el caso de instrumentos de deuda se deberá anotar la tasa de rendimiento al vencimiento del instrumento. En otro caso 0. <sup>2</sup>

#### CATÁLOGO(S)

Catálogo de Entidades (AFORE)	
Clave Tipo de Entidad	Descripción
530	XXI Banorte
534	Profuturo
538	Principal
544	SURA
550	Inbursa
552	Citibanamex
556	Azteca
562	Invercap
568	Coppel
578	PensionISSSTE

#### VALIDACIONES GENERALES DEL PROCESO

##### Validaciones para formato de los datos

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

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

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

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

DD = día

MM = mes

AAAA = año

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

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

1 y 2: corresponden al prefijo del país

3: corresponde al identificador de región

4 al 9: corresponden al identificador del emisor

10 y 11: corresponden al identificador de la emisión

12: dígito verificador

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

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

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

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

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

#### **POLÍTICAS GENERALES DEL PROCESO**

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

1° ISIN, de no existir éste,

2° CUSIP o CINS, de no existir éste,

3° SEDOL.

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

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

#### **POLÍTICAS ESPECÍFICAS DEL PROCESO**

Políticas a seguir en la transmisión de la información

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

- I. La transmisión del envío de los formatos de transmisión de información por proceso será a través de la red privada mediante el software Connect:Direct o algún otro compatible con este.
- II. Podrán realizar transmisiones las veces que les sea necesario al directorio de RECEPCION. Sin embargo, dentro de los 30 minutos anteriores al término del horario de transmisión, podrán efectuar

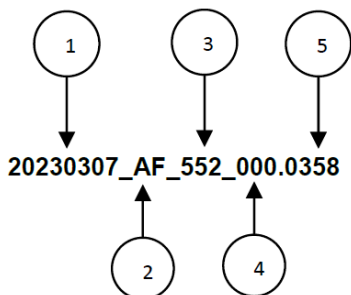
las retransmisiones que requieran al directorio de RETRANSMISION, siempre y cuando se haya realizado previamente un envío de información al directorio de RECEPCION, sin importar que éste haya sido aceptado o rechazado. Si la transmisión del archivo se efectúa fuera del horario de transmisión especificado y/o en una fecha no correspondiente a su envío normal, el archivo deberá ser transmitido al directorio de RETRANSMISION y se validará con previa autorización de las áreas de Vigilancia.

- III. Las entidades correspondientes comprometidas a transmitir el formato de transmisión de información por proceso serán los sujetos obligados (AFORES).
- IV. La comisión notificará, en su oportunidad, los cambios y adiciones correspondientes a los catálogos.
- V. El archivo deberá enviarse encriptado y comprimido utilizando el programa GNUUpG.
- VI. El nombre que deberá presentar el archivo al ser transmitido a la Comisión, es el siguiente;

No.	TIPO DE DATO	DESCRIPCIÓN
1	8 Dígitos Numéricos	En donde la entidad deberá incluir la Fecha de Envío en que está transmitiendo el archivo en formato "AAAAMMDD".
2	2 Dígitos Alfanuméricos	Estos representarán la abreviación del Tipo de Entidad que transmite, Conforme al Catálogo de Tipos de Entidad del Catálogo General Apartado Circular 19 vigente, Constante = "AF".
3	3 Dígitos Numéricos	Los cuales serán conforme a la clave de entidad que se reporta conforme al catálogo de Entidades AFORES anexo al documento.
4	3 Dígitos Numéricos	Estos establecen la Clave de Subtipo de Entidad que se reporta (*Solo aplicará para familia de SIEFORES, para las demás entidades será Constante = "000")
5	4 Dígitos Numéricos	Para definir el tipo de archivo que se está transmitiendo, en donde cada formato ya tiene estipulado un número, para este caso será Constante = "0358".

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

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



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

**A20180307\_AF\_552\_000.0358**

- VII. Las rutas de envío a CONSAR para producción serán:

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

La ruta de envío a CONSAR para pruebas será:

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