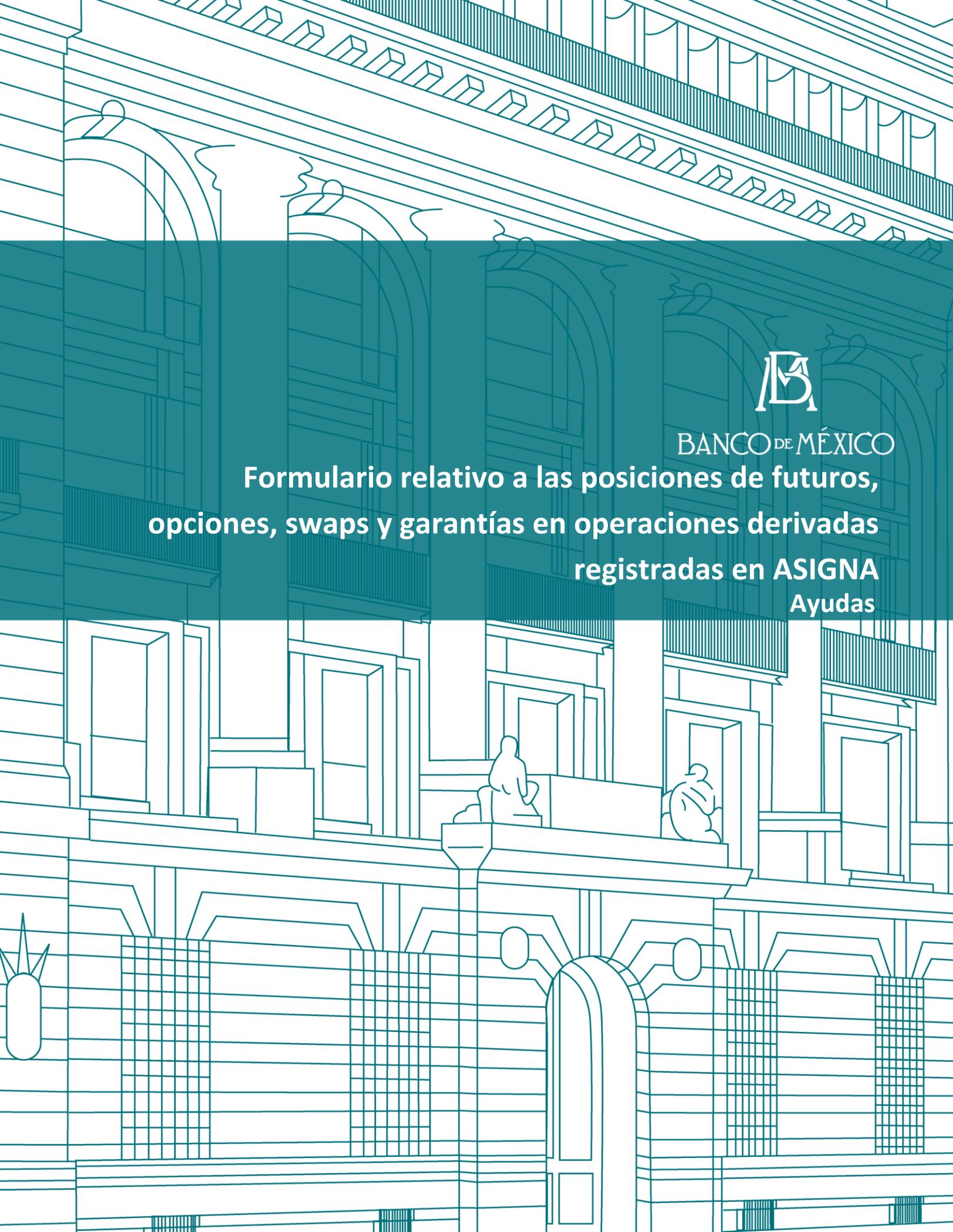




BANCO DE MÉXICO

**Formulario relativo a las posiciones de futuros,  
opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas  
registradas en ASIGNA  
Ayudas**



## CONTENIDO

.....	1
<b>Ayudas Generales</b> .....	1
<b>I. Objetivo del requerimiento</b> .....	1
<b>II. Definiciones</b> .....	1
<b>III. Cobertura del formulario</b> .....	1
<b>IV. Contenido del formulario</b> .....	1
<b>V. Fecha y horario de entrega de la información</b> .....	2
<b>VI. Actualización de catálogos o anexos</b> .....	3
<b>VII. Estructura del formulario por sección</b> .....	3
<b>Ayudas específicas para cada campo del formulario</b> .....	9
<b>Sección I.- Relativa a la posición abierta de futuros</b> .....	9
<b>Sección II.- Relativa a la posición abierta de opciones</b> .....	10
<b>Sección III.- Relativa a la posición abierta de swaps</b> .....	12
<b>Sección IV.- Relativa a la información de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro</b> .....	17
<b>Sección V.- Relativa a los contratos que garantizan operaciones derivadas celebradas en mercados reconocidos (Bursátiles)</b> .....	20
<b>Sección VI. - Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos de swaps</b> .....	22
<b>Sección VII.- Relativa a las Contrapartes “personas morales”, distintas de fideicomisos</b> .....	25
<b>Sección VIII.- Relativa a Contrapartes “fideicomisos”</b> .....	26
<b>Sección IX.- Relativa a Contrapartes “personas físicas”</b> .....	27
<b>Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario</b> .....	28
<b>Sección I, relativa a la posición abierta de futuros</b> .....	28
<b>Sección II, relativa a la posición abierta de opciones</b> .....	30
<b>Sección III, relativa a la posición abierta de swaps</b> .....	32
<b>Sección IV, relativa a la información de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro</b> .....	38
<b>Sección V, relativa a los contratos que garantizan operaciones derivadas celebradas en mercados reconocidos (Bursátiles)</b> .....	41
<b>Sección VI, relativa a vencimientos anticipados, o cesiones de derechos de swaps</b> .....	44
<b>Sección VII, relativa a las Contrapartes “personas morales”, distintas de fideicomisos</b> .....	48
<b>Sección VIII, relativa a Contrapartes “fideicomisos”</b> .....	50

Sección IX, relativa a Contrapartes “personas físicas” ..... 51

# Ayudas Generales

## I. Objetivo del requerimiento

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para, según sea el caso, determinar diversos indicadores relativos a la posición abierta, al volumen de las operaciones y de garantías relativas a operaciones de futuros, swaps y opciones a liquidarse y compensarse en Asigna.

## II. Definiciones

Para efectos de este formulario se entenderá como:

- Catálogo General de Contrapartes (CGC), al Catálogo Único de Contrapartes para las operaciones celebradas por las instituciones de crédito y casas de bolsa, que es administrado por el Banco de México, y utilizado en sus Formularios Aplicables.

## III. Cobertura del formulario

Se deberán elaborar los reportes que correspondan, conforme a lo señalado en la ayuda general siguiente, de las operaciones a liquidarse y compensarse en Asigna.

En el formulario se solicita diversa información respecto de los distintos términos y condiciones de las operaciones, ello con independencia que tales operaciones se apeguen o no a las disposiciones aplicables vigentes.

Las secciones relativas a contrapartes tienen como objetivo principal obtener la información necesaria para identificar de forma única a las partes involucradas en las transacciones financieras que realizan las operaciones, lo que permitirá entre otras cosas, medir y monitorear la exposición de riesgos.

Las preguntas que se hacen sobre ciertos términos y condiciones de las operaciones, las diversas instrucciones de llenado del formulario, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo deberán considerarse como parte de la normatividad o como una interpretación a esta o como un consentimiento o convalidación o autorización de la autoridad para realizar tales operaciones o para realizarlas en términos y condiciones que no se ajusten a las disposiciones aplicables vigentes.

## IV. Contenido del formulario

El formulario deberá contener la posición abierta, movimientos y garantías de todas las operaciones de futuros, swaps y opciones a liquidarse y compensarse en Asigna. El formulario está compuesto por las siguientes secciones:

**Sección I.** Comprende la posición abierta de futuros.

**Sección II.** Comprende la posición abierta de opciones.

### Uso Público

Información de acceso público.

**Sección III.** Comprende la posición abierta de swaps.

**Sección IV.** Comprende la tabla de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro.

**Sección V.** Comprende los contratos de garantía relativos a operaciones derivadas a liquidarse y compensarse en Asigna.

**Sección VI.** Para informar el vencimiento anticipado, o cesión de derechos, de operaciones de swaps que fueron previamente enviada en la sección III.

**Sección VII.** Comprende la información relativa a las contrapartes personas morales.

**Sección VIII.** Comprende la información relativa a las contrapartes fideicomisos.

**Sección IX.** Comprende la información relativa a las contrapartes personas físicas.

## V. Fecha y horario de entrega de la información

Las Secciones I a IV y VI de este formulario deberán enviarse con periodicidad diaria, antes de las 18:00 horas.

La Sección V de este formulario es de periodicidad diaria y la información sobre garantías deberá transmitirse a Banco de México, a más tardar a las 18.00 horas del día hábil bancario inmediato siguiente al que corresponde la información.

Adicionalmente, la Sección VI de este formulario deberá enviarse en la misma fecha del evento de vencimiento anticipado o de cesión de derechos de que se trate; por tanto, todos los registros deben tener la misma fecha de vencimiento anticipado.

En caso de que, la contraparte central se percate que uno o más registros no fueron enviados en su fecha de corte o vencimiento, o que fueron enviados por error, o que alguna característica requiere ser modificada o cambiada, debe enviar todos los registros de la fecha y de la sección que correspondan.

Por su parte, las Secciones VII a IX deberán enviarse en la fecha en que la contraparte central identifique a una persona clienta que no esté incluido en el "CGC", o cuando la contraparte central tenga conocimiento que alguna característica de una persona clienta ya registrado en el "CGC" fue modificada, se deberá enviar la información respectiva en la sección que corresponda

El soporte técnico relacionado con el acceso a personas usuarias, así como la operación del sistema de acopio, es de las 8:00 a las 20:30 de lunes a viernes en días hábiles bancarios.

No obstante, el envío de los paquetes deberá realizarse en un horario de 9:00 a 21:00 horas.

### Uso Público

Información de acceso público.

## VI. Actualización de catálogos o anexos

En caso de que en un determinado Catálogo o Anexo no exista una clave para identificar algún evento o categoría en particular (por ejemplo, un tipo de subyacente en el Anexo “F”, o un socio liquidador en el Anexo “O”), la contraparte central podrá solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevo(s) evento(s) y clave(s), a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx, indicando el catálogo o anexo y el evento o categoría faltante.

## VII. Estructura del formulario por sección

**Nota aplicable a todos los “Layouts”:** En el caso de campos tipo “Numérico”, el primer dígito entre paréntesis corresponde al número máximo de posiciones enteras, el punto se considera en la longitud, mientras que el segundo dígito corresponde al número máximo de posiciones decimales. No obstante, si el campo es numérico y tiene asociado algún Catálogo o Anexo, la longitud de dicho campo será de largo fijo,

### Estructura de la Sección I: posición abierta de futuros

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Oper_der	Operador de la posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
2	Pro_ter	Origen de la posición		Alfanumérico	1
3	Cliente	Clave de la persona clienta con posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
4	Fe_corte	Fecha de corte de la posición		Fecha	AAAA/MM/DD
5	Pos_oper	Posición en la pizarra		Alfanumérico	1
6	Pizarra	Clave de la pizarra con posición	Anexo AA Derivados	Alfanumérico	20
7	Fe_vento	Fecha de vencimiento de la pizarra		Fecha	AAAA/MM/DD
8	Socio_liq	Socio liquidador de la posición	Anexo O Derivados	Alfanumérico	6
9	Contrat_vig	Número de contratos vigentes (abiertos) en posición		Numérico	(7,0)
10	Cuenta	Cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20
11	Subcuenta	Sub cuenta de la Cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20

### Estructura de la Sección II: posición abierta de opciones

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Oper_der	Operador de la posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
2	Pro_ter	Origen de la posición		Alfanumérico	1
3	Cliente	Clave de la persona clienta con posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
4	Fe_corte	Fecha de corte de la posición		Fecha	AAAA/MM/DD
5	Pos_oper	Posición en la pizarra		Alfanumérico	1
6	Pizarra	Clave de la pizarra con posición	Anexo AA Derivados	Alfanumérico	20
7	Fe_vento	Fecha de vencimiento de la pizarra		Fecha	AAAA/MM/DD

#### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

8	Socio_liq	Socio liquidador de la posición	Anexo O Derivados	Alfanumérico	6
9	Precio_tasa	Precio Unitario o Tasa de Ejercicio		Numérico	(18,13)
10	Contrat_vig	Número de contratos vigentes (abiertos) en posición		Numérico	(7,0)
11	Vola_opc	Valor de la volatilidad implícita		Numérico	(4,6)
12	Delta	Valor del parámetro "Delta"		Numérico	(2,6)
13	Cuenta	Cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20
14	Subcuenta	Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20

### Estructura de la Sección III: posición abierta de swaps

CAMP O	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Inst	Clave de la entidad que celebró la operación u operador de la posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
2	Fe_con_ope	Fecha de concertación de la operación		Fecha	AAAA/MM/DD
3	Pro_ter	Origen de la posición		Alfanumérico	1
4	Cliente	Clave de la persona cliente que celebró la operación o la contraparte de la operación.	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
5	Fe_corte	Fecha de corte		Fecha	AAAA/MM/DD
6	Tasa_recibir	Valor de la tasa fija a recibir		Numérico	(9,6)
7	Tasa_entregar	Valor de la tasa fija a entregar		Numérico	(9,6)
8	Tasa_var_recib	Tasa de interés variable a recibir	Anexo AF	Alfanumérico	20
9	Tasa_var_ent	Tasa de interés variable a entregar	Anexo AF	Alfanumérico	20
10	Pt_tas_recib	Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a Recibir		Numérico	(9,6)
11	Pt_tas_ent	Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a Entregar		Numérico	(9,6)
12	Tipo_cambio	Tipo de cambio de la operación		Numérico	(18,13)
13	Fe_ini_flu	Fecha de inicio del primer flujo		Fecha	AAAA/MM/DD
14	Fe_ven_ope	Fecha de vencimiento del último flujo		Fecha	AAAA/MM/DD
15	Nu_flu	Número total de flujos del swap		Numérico	(4,0)
16	Frec_pago_recib	Frecuencia de pago de los intercambios a recibir		Numérico	(4,0)
17	Frec_pago_ent	Frecuencia de pago de los intercambios a entregar		Numérico	(4,0)
18	Tipo	Tipo de contrato swap		Alfanumérico	3
19	Origen	Origen de procedencia		Alfanumérico	3
20	Broker	Broker de la operación	Anexo K Derivados	Numérico	2
21	Middleware	Herramienta de negociación	Anexo K Derivados	Numérico	2
22	Num_id	Número de Identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como "Unique Transaction Identifier")		Alfanumérico	52
23	Pos_oper	Posición en la pizarra		Alfanumérico	1
24	Pizarra	Clave de pizarra de la operación	Anexo AA Derivados	Alfanumérico	20
25	Socio_liq	Socio liquidador de la posición	Anexo O Derivados	Alfanumérico	6
26	Contrat_vig	Número de contratos vigentes (abiertos) en posición		Numérico	(7,0)

#### Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA

27	Act_ope	Valuación de la parte activa de la posición		Numérico	(23,8)
28	Pas_ope	Valuación de la parte pasiva de la posición		Numérico	(23,8)
29	Cuenta	Cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20
30	Subcuenta	Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición		Alfanumérico	20

## Estructura de la Sección IV: información de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Inst	Clave de la entidad que celebró la operación u operador de la posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
2	Fe_movimientos	Fecha de movimientos de la posición		Fecha	AAAA/MM/DD
3	Formulario	Tipo de operación del movimiento		Alfanumérico	2
4	Pizarra	Clave de pizarra con posición	Anexo AA Derivados	Alfanumérico	20
5	Pos_oper	Posición en la pizarra a afectar		Alfanumérico	1
6	Movimiento	Movimientos en número de contratos		Numérico	(7,0)
7	Motivo	Motivo del cambio de la posición	Anexo de Movimientos	Alfanumérico	2
8	Precio	Precio de cierre para la determinación del ejercicio de opciones		Numérico	(14,6)
9	Socio_liq	Socio liquidador de la posición	Anexo O Derivados	Alfanumérico	6
10	Pro_ter	Origen de la posición		Alfanumérico	1
11	Num_id	Número de Identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como "Unique Transaction Identifier")		Alfanumérico	52
12	Cliente	Clave de la persona cliente con posición	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
13	Cuenta	Cuenta de la persona cliente		Alfanumérico	20
14	Subcuenta	Sub cuenta de la persona cliente donde registra la posición		Alfanumérico	20

## Estructura de la Sección V: información de los contratos de garantía relativos a operaciones derivadas a liquidarse y compensarse en Asigna

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Inst	Clave de la institución	CGC	Alfanumérico	6
2	Oficina	Oficina que realiza el contrato	Anexo A	Alfanumérico	1
3	Mercado	Mercado	Anexo S	Alfanumérico	3
4	Socio_liq	Socio liquidador	Anexo O	Alfanumérico	6
5	Fe_corte	Fecha de corte		Fecha	AAAA/MM/DD

### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

6	Id_gar	Clave o folio para identificar el contrato de garantía		Alfanumérico	20
7	Con_gta	Número consecutivo para identificar los activos que forman parte del contrato de garantía		Numérico	(3,0)
8	Tip_gta	Tipo de activo en garantía	Anexo AD	Numérico	(2,0)
9	Cve_tit	Clave del valor (título de deuda o acción) en garantía	Anexo AF	Alfanumérico	20
10	Aforo	Porcentaje de aforo aplicable al activo en garantía		Numérico	(5,2)
11	Val_gta	Valor de mercado del activo en garantía		Numérico	(15,0)
12	Mda_gta	Moneda del activo en garantía	Anexo E	Numérico	(3,0)
13	Cuenta	Cuenta de la persona cliente		Alfanumérico	20
14	Cliente	Clave de la persona cliente del contrato de garantía	CGC	Alfanumérico	6

## Estructura de la Sección VI: información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de swaps

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	Inst	Clave del socio operador quien realizó el vencimiento	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
2	Pro_ter	Origen de la operación		Alfanumérico	1
3	Cliente	Clave de la persona cliente que celebró el vencimiento	Anexo P Derivados y CGC	Alfanumérico	6
4	Fe_con_ope	Fecha de concertación de la operación		Fecha	AAAA/MM/DD
5	Fe_ven_ant	Fecha de vencimiento anticipado		Fecha	AAAA/MM/DD
6	Fe_liq_ant	Fecha de liquidación anticipada		Fecha	AAAA/MM/DD
7	Imp_ven	Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos		Numérico	(16,8)
8	Mda_ven	Moneda del importe por vencimiento anticipado o cesión de derechos	Anexo E Derivados	Numérico	(4,0)
9	Pago_ven	La entidad pagó o recibió el importe del vencimiento anticipado o cesión de derechos		Alfanumérico	1
10	Num_cont_ant	Número de contratos que vencen anticipadamente		Numérico	(16,0)
11	Motivo_ven	Motivo del vencimiento anticipado o cesión de derechos	Anexo R Derivados	Numérico	(1,0)
12	Ven_ant	Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos		Alfanumérico	2
13	Num_id	Número de Identificación de la operación (Original) o Identificador Único de Transacción (Original) (denominado en inglés como "Unique Transaction Identifier")		Alfanumérico	52
14	Num_id_nvo	Número de Identificación de la nueva operación o Identificador Único de Transacción Nuevo (denominado en inglés como "Unique Transaction Identifier")		Alfanumérico	52
15	Cuenta	Cuenta donde se encuentra registrada el vencimiento anticipado o cesión de derechos		Alfanumérico	20
16	Subcuenta	Sub cuenta donde se encuentra registrada el vencimiento anticipado o cesión de derechos		Alfanumérico	20

### Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA

## Estructura de la Sección VII: Contrapartes personas morales distintas a fideicomisos

No.	Clave	Tamaño y tipo	Descripción	Catálogo
1	CveBMXC	Ch(6)	Clave de la Contraparte	B
2	Nombrel	Ch(150)	Nombre de la Contraparte	
3	TipoSocM	N(2,0)	Tipo de Sociedad Mercantil	G
4	Id_A	N(1,0)	Tipo de Identificador de la Contraparte	T
5	ID_Oficial	Ch(13)	Clave de Identificador de la Contraparte	
6	TipoEnte	N(2,0)	Tipo de Contraparte	W
7	LEI	Ch(20)	Clave "LEI" (Legal Entity Identifier) de la Contraparte	
8	SCIAN	N(6,0)	Sector de la Contraparte, conforme al Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte (SCIAN)	Y
9	NacContr	Ch(2)	País de Residencia de quien controla a la Contraparte 1/.	Z
10	ResEnt	Ch(2)	País de residencia de la Contraparte	Z
11	IdMatDir	Ch(20)	Clave LEI de la Matriz directa de la Contraparte	
12	IdMatU	Ch(20)	Clave LEI de la Matriz en última instancia de la Contraparte.	
13	FechaMod	Date	Fecha de Alta o Modificación de la Contraparte	

1/ Conforme a la definición de "Control" en la Ley de Instituciones de Crédito, Artículo 22 Bis fracción II.

## Estructura de la Sección VIII: Contrapartes fideicomisos

No.	Campo	Tamaño y tipo	Descripción	Catálogo
1	CveBMXC	Ch(6)	Clave de la Contraparte	B
2	NombreL	Ch(150)	Nombre del Fideicomiso	
3	LEI	Ch(20)	Clave "LEI". (Legal Entity Identifier) de la Contraparte	
4	Id_A	N(1,0)	Tipo de Identificador	T
5	ID_Oficial	Ch(13)	Clave de Identificador	
6	OrigFid	N(1,0)	Origen de los recursos del Fideicomiso	AC
7	TipoFideic	N(1,0)	Tipo de Fideicomiso	AE
8	ResEnt	Ch(2)	País de residencia de la Contraparte	Z
9	FechaMod	Date	Fecha de Alta o Modificación del Fideicomiso	

## Estructura de la Sección IX: Contrapartes personas físicas

No.	Campo	Tamaño y tipo	Descripción	Catálogo
1	CveBMXC	Ch(6)	Clave de la Contraparte	B
2	NombreL	Ch(150)	Nombre de la Contraparte (Persona Física)	
3	Id_A	N(1,0)	Tipo de Identificador de la Contraparte	T

### Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA

4	ID_Oficial	Ch(13)	Clave de Identificador de la Contraparte	
5	ResEnt	Ch(2)	País de residencia de la Contraparte	Z
6	TipoPF	N(1,0)	Tipo de Contraparte	
7	SCIAN	N(6,0)	Sector de la Contraparte, conforme al Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte (SCIAN)	Y
8	FechaMod	Date	Fecha de Alta o Modificación de la Contraparte	

**Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

## Ayudas específicas para cada campo del formulario

La información relativa a las operaciones de futuro o de forward, deberá enviarse conforme a lo siguiente.

### Sección I.- Relativa a la posición abierta de futuros

Los diversos campos del registro de cada operación deberán llenarse conforme a lo siguiente:

#### 1.- Operador de la posición

Se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P y el CGC.

#### 2.- Origen de la operación

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una posición celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una posición celebrada (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona cliente).
- F** Cuando se trate de una posición celebrada por la entidad denominada “operador” en su figura de formador de mercado.

#### 3.- Clave de la persona cliente

En caso de que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 2), se deberá anotar la clave de la persona cliente (o tercera persona) a nombre del cual la institución celebró la operación. Si la operación es por cuenta propia, deberá registrarse la clave de la institución quien realiza la operación.

#### 4.- Fecha de corte

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la posición abierta a informar por cada persona cliente, sobre una determinada pizarra, con un mismo socio liquidador y un mismo socio operador (es decir, considerando todas las operaciones de cierre de posición negociadas hasta la fecha de corte).

#### 5.- Posición en la operación

Se deberá anotar:

- C** Cuando la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de compra.
- V** Cuando la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de venta.

#### 6.- Clave de pizarra

#### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Este campo se refiere a la “clave de pizarra” de la posición abierta, para una determinada persona clienta, socio liquidador y socio operador.

#### **7.- Fecha de vencimiento de la pizarra**

Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la pizarra indicada en el campo “clave de pizarra”.

#### **8.-Socio liquidador**

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada socio liquidador que corresponda a la posición vigente en una determinada “clave de pizarra” (campo 6), “operador de la posición” (campo 1) y “persona clienta” (campo 3).

#### **9.-Número de contratos vigentes (abiertos) en posición**

Este campo se refiere al número de contratos abiertos de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 6), “socio liquidador” (campo 8), “operador de la posición” (campo 1) y “persona clienta” (campo 3) de que se trate.

#### **10.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta para el registro, compensación y liquidación de las operaciones.

#### **11.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la subcuenta donde el tenedor del portafolio registra la posición abierta.

## **Sección II.- Relativa a la posición abierta de opciones**

Los diversos campos del registro de cada operación deberán llenarse conforme a lo siguiente:

#### **1.- Operador de la posición**

Se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P y el CGC.

#### **2.- Origen de la operación**

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una posición celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una posición celebrada (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona clienta).
- F** Cuando se trate de una posición celebrada por la entidad denominada “operador” en su figura de formador de mercado.

#### **3.- Clave de la persona clienta**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

En caso de que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 2), se deberá anotar la clave de la persona cliente (o tercera persona) a nombre del cual la institución celebró la operación. Si la operación es por cuenta propia, deberá registrarse la clave de la institución quien realiza la operación.

#### 4.- Fecha de corte

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la posición abierta a informar por cada persona cliente, sobre una determinada pizarra, con un mismo socio liquidador y un mismo socio operador (es decir, considerando todas las operaciones de cierre de posición negociadas hasta la fecha de corte).

#### 5.- Posición en la operación

Se deberá anotar:

- E** Cuando la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de emisión de opciones.
- A** Cuando la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de adquisición de opciones.

#### 6.- Clave de pizarra

Este campo se refiere a la “clave de pizarra” de la posición abierta, para una determinada persona cliente, socio liquidador y socio operador. La clave de la pizarra deberá estar formada por dos dígitos para el activo subyacente, seguido del precio de ejercicio y, finalmente, por una letra indicando el tipo de contrato y mes de vencimiento.

#### 7.- Fecha de vencimiento de la pizarra

Se deberá anotar la fecha de vencimiento de la pizarra indicada en el campo “clave de pizarra”.

#### 8.-Socio liquidador

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada socio liquidador que corresponda a la posición vigente en una determinada “clave de pizarra” (campo 6), “operador de la posición” (campo 1) y “persona cliente” (campo 3).

#### 9.- Precio unitario o tasa de ejercicio

Según sea el caso, se deberá anotar (con enteros y trece decimales) el precio unitario, o la tasa de ejercicio, pactado para el subyacente que se trate, por contrato. En el caso de un precio, éste se deberá anotar en unidades de la moneda en que está expresado, conforme al contrato de que se trate. Tratándose de tasas de interés, éstas deberán anotarse en porcentaje y en términos anuales.

#### 10.-Número de contratos vigentes (abiertos) en posición

Este campo se refiere al número de contratos abiertos de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 6), “socio liquidador” (campo 8), “operador de la posición” (campo 1) y “persona cliente” (campo 3) de que se trate.

#### Uso Público

Información de acceso público.

**11.- Valor de la volatilidad implícita**

Se deberá anotar el valor de la volatilidad implícita (en términos porcentuales y en unidades) en el precio de mercado de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” del campo 6, calculada en la fecha de corte que corresponda (campo 4).

**12.- Valor del parámetro delta**

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” de la opción vigente, relativa a la “clave de pizarra” del campo 6 de que se trate, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 4).

**13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta para el registro, compensación y liquidación de las operaciones.

**14.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la subcuenta donde el tenedor del portafolio registra la posición abierta.

**Sección III.- Relativa a la posición abierta de swaps**

Los diversos campos del registro de cada operación deberán llenarse conforme a lo siguiente:

**1.- Institución u operador de la posición**

Se deberá anotar la clave asignada a la “institución” quien realizó la operación o la clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P y el CGC.

**2.- Fecha de concertación**

Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

**3.- Origen de la operación**

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una posición celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una posición celebrada (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona cliente).
- F** Cuando se trate de una posición celebrada por la entidad denominada “operador” en su figura de formador de mercado.

**4.- Clave de la persona cliente****Uso Público**

Información de acceso público.

Si la operación se realizó directamente en MexDer y en caso de que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave "T" en el campo 3), se deberá anotar la clave de la persona cliente (o tercera persona) a nombre del cual la institución celebró la operación. Si la operación se realizó directamente en MexDer por cuenta propia, deberá registrarse la clave de la institución quien realiza la operación.

En caso de que se trate de una operación originada en mercados extrabursátiles, con liquidación en la cámara, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforme al "Catálogo General de Contrapartes".

#### **5.- Fecha de corte**

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la posición abierta a informar por cada persona cliente, sobre una determinada pizarra, con un mismo socio liquidador y un mismo socio operador (es decir, considerando todas las operaciones de cierre de posición negociadas hasta la fecha de corte).

#### **6.- Valor de la tasa fija a recibir**

En caso de que la operación reciba una tasa fija (claves "1" o "3" en el campo 23), en este campo se debe anotar la tasa fija a recibir, anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 3.264%, se anotará: 3.264.

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave "1" en el campo 23), este campo y el campo 7 no pueden ser simultáneamente igual a "0" (cero).

Tratándose de operaciones que reciban una tasa variable (clave "2" en el campo 23), este campo deberá ser igual a "0" (cero).

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave "3" en el campo 23), este campo deberá ser distinto a "0" (cero).

#### **7.- Valor de la tasa fija a entregar**

En caso de que la operación entregue una tasa fija (claves "1" o "3" en el campo 23), en este campo se debe anotar la tasa fija a entregar, anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 3.264%, se anotará: 3.264.

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave "1" en el campo 23), este campo y el campo 6 no pueden ser simultáneamente igual a "0" (cero).

Tratándose de operaciones que entreguen una tasa variable (clave "2" en el campo 23), este campo deberá ser igual a "0" (cero).

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave "3" en el campo 23), este campo deberá ser distinto a "0" (cero).

#### **8.- Tasa de referencia para determinar la tasa variable a recibir**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a recibir de la operación conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF. Sin embargo, tratándose de operaciones que reciban tasa fija, campo 6 distinto a “0” (cero), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 9 no pueden ser simultáneamente igual a “NA” (No Aplica).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen tasa fija (clave “3” en el campo 23), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

#### **9.- Tasa de referencia para determinar la tasa variable a entregar**

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a entregar de la operación conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF. Tratándose de operaciones que entreguen tasa fija, campo 7 distinto a “0” (cero), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 8 no pueden ser simultáneamente igual a “NA” (No Aplica).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen tasa fija (clave “3” en el campo 23), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

#### **10.- Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a recibir**

En este campo, conforme al contrato de la operación, se deberán anotar los puntos porcentuales a sumar, respetando su signo en caso de ser negativos, para obtener la “tasa variable a recibir”, en enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de que la tasa variable resulte de sumar -0.18% a la LIBOR-EUR a 30 días, en este campo se anotará: “-0.18”; de forma similar, en caso de que la tasa variable resulte de sumar 0.23% a la LIBOR-USD a 28 días, en este campo se anotará: “0.23”.

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a recibir” no requiera sumar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

#### **11.- Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a entregar**

En este campo, conforme al contrato de la operación, se deberán anotar los puntos porcentuales a sumar, respetando su signo en caso de ser negativos, para obtener la “tasa variable a entregar”, en enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de que la tasa variable resulte de sumar -0.18% a la LIBOR-EUR a 30 días, en este campo se anotará: “-0.18”; de forma similar, en caso de que la tasa variable resulte de sumar 0.23% a la LIBOR-USD a 28 días, en este campo se anotará: “0.23”.

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a entregar” no requiera sumar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que entreguen tasa fija, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

**12.- Tipo de cambio de la operación**

Se deberá anotar el tipo de cambio con el que se calcula el notional en pesos de la operación.

Tratándose de operaciones IRS, campo 18 igual a “IRS”, este campo deberá ser cero.

**13.- Fecha de inicio del primer flujo**

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

**14.- Fecha de vencimiento del último flujo**

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

**15.- Número total de flujos del swap**

Se deberá anotar el número total de flujos a recibir y a entregar pactados en la operación. En caso de operaciones que sean restructuradas, cesiones de derechos u otras situaciones que impliquen el cambio de las características pactadas originalmente, en este campo se deberá reportar el remante de los flujos de la operación al momento en que suceda tal acuerdo.

**16.- Frecuencia de pago de los intercambios a recibir**

Se deberá anotar la frecuencia de pagos en días naturales de los intercambios a recibir.

**17.- Frecuencia de pago de los intercambios a entregar**

Se deberá anotar la frecuencia de pagos en días naturales de los intercambios a entregar.

**18.- Tipo de contrato Swap**

Se deberá anotar:

- IRS** Cuando el contrato se refiere a un “*Interest Rate Swap*”.
- CCS** Cuando el contrato se refiere a un “*Cross Currency Swap*”.

**19.- Origen de procedencia**

Se deberá anotar:

- MEX** Cuando la posición abierta se haya operado directamente en MexDer.
- OTC** Cuando la posición abierta no se operó directamente en MexDer, pero la compensación y liquidación se realizará en Asigna.

**20.- Broker de la operación****Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la “sociedades que administran sistemas para facilitar operaciones con valores”, por medio de la cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Plataformas de Negociación” a que se refiere el Anexo K.

Tratándose de operaciones no concertadas a través de dichas sociedades, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

### **21.- Herramienta de negociación**

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la “Herramienta de negociación”, por medio de la cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Plataformas de Negociación” a que se refiere el Anexo K.

Tratándose de operaciones no concertadas a través de dichas herramientas, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

### **22.- Número de identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Se deberá anotar un número para identificar a cada registro. En caso de que la operación tenga asignado un número único (“Unique Swap Identifier” o USI), dicho número debe registrarse en este campo. Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

### **23.- Posición en la operación**

Se deberá anotar:

- 1 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa fija por una tasa variable.
- 2 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa variable por otra tasa variable.
- 3 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa fija por otra tasa fija.

### **24.- Clave de pizarra**

Se deberá anotar la “clave de pizarra” que corresponda a la operación, conforme al “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA.

### **25.-Socio liquidador**

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada socio liquidador que corresponda a la posición vigente en una determinada “clave de pizarra” (campo 24), “operador de la posición” (campo 1) y “persona cliente” (campo 4).

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

**26.-Número de contratos vigentes (abiertos) en posición**

Este campo se refiere al número de contratos abiertos de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 24), “socio liquidador” (campo 25), “operador de la posición” (campo 1) y “persona clienta” (campo 4) de que se trate.

**27.- Valuación de la parte activa de la operación**

Se deberá anotar el valor (expresado en miles de pesos mexicanos con ocho decimales) de la parte activa de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 24).

**28.- Valuación de la parte pasiva de la operación**

Se deberá anotar el valor (expresado en miles de pesos mexicanos con ocho decimales) de la parte pasiva de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 24).

**29.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta para el registro, compensación y liquidación de las operaciones.

**30.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la subcuenta donde el tenedor del portafolio registra la posición abierta.

## Sección IV.- Relativa a la información de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro

Los diversos campos del registro de cada operación deberán llenarse conforme a lo siguiente:

**1.- Institución u operador de la posición**

Se deberá anotar la clave asignada a la “institución” quien realizó la operación o la clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P y el CGC.

**2.- Fecha de movimientos de la posición**

Se deberá anotar la fecha de movimientos de la posición de futuros, opciones y swaps, con formato AAAA/MM/DD.

**3.- Tipo de operación del movimiento**

Se deberá anotar:

**FU** Cuando el movimiento afecte la posición abierta de futuros.

**Uso Público**

Información de acceso público.

**OP** Cuando el movimiento afecte la posición abierta de opciones.

**SW** Cuando el movimiento afecte la posición abierta de swaps.

#### 4.- Clave de pizarra

Se deberá anotar la “clave de pizarra” que corresponda a la operación, conforme al “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA.

#### 5.- Posición en la operación

Se deberá anotar:

- C** Cuando el movimiento a la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de futuros de compra.
- V** Cuando el movimiento a la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de futuro de venta.
- E** Cuando el movimiento a la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de emisión de opciones.
- A** Cuando el movimiento a la posición abierta para la pizarra corresponda a contratos de adquisición de opciones.
- 1** Cuando el movimiento se trate de una operación de swap en la que se intercambia una tasa fija por una tasa variable.
- 2** Cuando el movimiento se trate de una operación de swap en la que se intercambia una tasa variable por otra tasa variable.
- 3** Cuando el movimiento se trate de una operación de swap en la que se intercambia una tasa fija por otra tasa fija.

#### 6.- Movimientos en número de contratos

Se deberá anotar el número de contratos a aumentar o a disminuir para la determinación de la posición abierta al cierre de la fecha correspondiente a los movimientos.

#### 7.- Motivo del cambio de la posición

Se deberá anotar la clave asignada al motivo del cambio de la posición, conforme al “Catálogo de Movimientos”.

#### 8.- Precio de cierre para la determinación del ejercicio (opciones)

Se deberá anotar (con enteros y seis decimales) el precio o valor del subyacente que se utilizó de referencia para la determinación del ejercicio de contratos de opciones. En el caso de un precio,

#### Uso Público

Información de acceso público.

éste se deberá anotar en unidades de la moneda en que está expresado, conforme al contrato de que se trate. Tratándose de tasas de interés, éstas deberán anotarse en porcentaje y en términos anuales.

Para el caso de movimientos de futuros y swaps, campo 3 igual a “FU” o a “SW”, este campo deberá reportarse como cero “0”.

### 9.-Socio liquidador

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada socio liquidador que corresponda a la posición vigente en una determinada “clave de pizarra” (campo 4), “operador de la posición” (campo 1) y “persona clienta” (campo 12).

### 10.- Origen de la operación

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una posición celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una posición celebrada (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona clienta).
- F** Cuando se trate de una posición celebrada por la entidad denominada “operador” en su figura de formador de mercado.

### 11.- Número de identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)

En el caso de swaps, campo 3 igual a “SW”, se deberá anotar un número para identificar a cada registro. Adicionalmente, si la operación tiene asignado un número único (“Unique Swap Identifier” o USI), dicho número debe registrarse en este campo. Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

Para el caso de movimientos de futuros y opciones, campo 3 igual a “FU” o a “OP”, este campo deberá reportarse vacío.

### 12.- Clave de la persona clienta

Si la operación se realizó directamente en MexDer y en caso de que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 3), se deberá anotar la clave de la persona clienta (o tercera persona) a nombre del cual la institución celebró la operación. Si la operación se realizó directamente en MexDer por cuenta propia, deberá registrarse la clave de la institución quien realiza la operación.

#### Uso Público

Información de acceso público.

En caso de que se trate de una operación originadas en mercados extrabursátiles, con liquidación en la cámara, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforme al “Catálogo General de Contrapartes”.

**13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta para el registro, compensación y liquidación de las operaciones.

**14.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la subcuenta donde el tenedor del portafolio registra la posición abierta.

## **Sección V.- Relativa a los contratos que garantizan operaciones derivadas celebradas en mercados reconocidos (Bursátiles)**

**1.- Clave de la institución**

Se deberá anotar el número asignado para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

**2.- Oficina que realiza el contrato**

Se deberá anotar la clave que corresponda a la oficina que celebró el contrato de garantía a reportar, conforme al “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Anexo A.

**3.- Mercado**

Se deberá anotar la clave del “mercado” relativo al contrato de garantía a reportar, conforme al “Catálogo de Mercados Reconocidos” a que se refiere el Anexo S.

**4.-Socio liquidador**

Se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” con el que se tiene el contrato de garantía a reportar, conforme al “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

**5.- Fecha de corte**

Se deberá anotar la fecha a la que corresponde la información del contrato de garantía a reportar, con formato AAAA/MM/DD.

**6.- Clave o folio para identificar el contrato de garantía**

Se deberá anotar una clave o folio de identificación para el contrato individual a reportar, independientemente si dicho contrato considera un sólo activo o un conjunto de éstos (portafolio). Asimismo, dicho contrato podría estar asociado a una determinada operación derivada, o a un conjunto de dichas operaciones. En caso de que no cuenten con la clave o folio para identificar el contrato de garantía, deberá utilizarse el valor de la persona clienta.

**7.- Número consecutivo para identificar los activos que forman parte del contrato de garantía**

**Uso Público**

Información de acceso público.

Tratándose de contratos de garantía que contemplen dos o más activos, se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán los activos individuales que formen parte de un mismo contrato. Cada grupo de activos relativos a un determinado contrato de garantía (campo 6), deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más activos individuales que tengan la misma fecha de corte (campo 5) y clave o folio para identificar el contrato de garantía (campo 6). En el caso de contratos de garantía constituidos por un único activo, este campo deberá ser igual a 1 (uno).

#### **8.- Tipo de activo en garantía**

Se deberá anotar la clave que corresponda al activo en garantía, conforme al “Catálogo de Tipos de Activos en Garantía” a que se refiere el Anexo AD.

#### **9.- Clave del valor (título de deuda o acción) en garantía**

En caso de que un activo individual del contrato de garantía a reportar, sea un título de deuda (bono, certificado bursátil, certificado de depósito, etc.), título representativo de capital (acción, certificado de participación ordinaria, ADR, GDR, etc.), o título referenciado a acciones (TRAC, ETF, etc.), depositado en algún instituto autorizado para ello, se deberá anotar la “clave” que corresponda a dicho valor, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Tratándose de activos individuales distintos a los mencionados títulos, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

#### **10.-Porcentaje de aforo aplicable al activo en garantía**

Tratándose de contratos de garantía que establezcan que la cobertura se determina como un porcentaje (aforo) del valor de mercado del activo en garantía (equivalente a 1 menos la tasa de descuento), se deberá anotar el porcentaje, con enteros y dos decimales, que corresponde al activo individual de que se trate.

En caso de que el contrato en cuestión no contemple descuento o aforo para el activo individual de que se trate, en este campo se deberá reportar 100 (cien).

#### **11.- Valor de mercado del activo en garantía**

Se deberá anotar el valor razonable del activo relativo al contrato de garantía a reportar a la fecha de corte que corresponda (campo 5), en miles (redondeado sin decimales) de la moneda de denominación de dicho activo. En el caso de garantías personales, deberá reportarse el valor vigente de la cobertura a la fecha de corte (por ejemplo, en el caso de una línea de crédito, el importe disponible de dicha línea a la fecha de corte). Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

#### **12. Moneda del activo en garantía**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Se deberá anotar la clave que corresponda a la moneda en que está expresado (o denominado) el activo o el monto en efectivo relativo al contrato de garantía a reportar, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

### **13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta para el registro, compensación y liquidación de las operaciones sujeta a garantías.

### **14.- Clave de la persona clienta del contrato de garantía**

Se deberá anotar el número asignado para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

## **Sección VI. - Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos de swaps**

### **1.- Clave del socio operador quien realizó el vencimiento**

Se deberá anotar la clave asignada a la “institución” quien realizó el vencimiento de la operación o la clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P y el CGC.

### **2.- Origen de la operación**

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate del vencimiento anticipado (o cesión de derechos) de una operación celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate del vencimiento anticipado (o cesión de derechos) de una operación celebrada por cuenta de una tercera persona (persona clienta).
- F** Cuando se trate del vencimiento anticipado (o cesión de derechos) de una operación celebrada por formador de mercado (persona clienta).

### **3.- Clave de la persona clienta**

Se deberá anotar la clave de la persona clienta (o tercera persona) cuya posición se venció anticipadamente.

### **4.- Fecha de concertación**

Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación (original), con formato AAAA/MM/DD.

### **5.- Fecha de vencimiento anticipado**

Se deberá anotar la fecha efectiva en que la operación fue vencida (o terminada) en forma anticipada (por cualquier motivo) o cedidos sus derechos, con formato AAAA/MM/DD.

### **6.- Fecha de liquidación anticipada**

Se deberá anotar la fecha efectiva en la que se liquidó el importe correspondiente al vencimiento anticipado o la cesión de derechos, con formato AAAA/MM/DD. En el caso de operaciones que

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

contemplan la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, este campo debe reportarse “vacío”.

#### **7.- Importe por el vencimiento anticipado total o cesión de derechos**

Se deberá anotar el importe (cuota o “fee” por vencimiento anticipado) efectivamente pagado o recibido por el vencimiento anticipado total, o cesión de derechos, de la operación de que se trate, en miles y a ocho decimales de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato.

En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, se debe anotar “0” (cero).

#### **8.- Moneda del importe por vencimiento anticipado o cesión de derechos**

En el caso de operaciones donde se reporte exclusivamente el importe (cuota o “fee” por vencimiento anticipado) efectivamente pagado o recibido por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos, se deberá anotar la clave de la moneda en la que están denominados cualquiera de éstos, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, se debe anotar “0” (cero).

#### **9.- La entidad pagó o recibió el importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos**

Se deberá anotar:

- R** Cuando la persona clienta haya efectivamente recibido el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos.
- P** Cuando la persona clienta haya efectivamente pagado el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos.
- N** Cuando la persona clienta no haya recibido ni pagado el importe (cuota o “fee”) por la terminación (o extinción) o vencimiento (total o parcial) anticipado de la operación reportada.

#### **10.- Número de contratos que vencen anticipadamente**

En su caso, se deberá anotar el número de contratos que vencen anticipadamente de forma parcial (en la fecha señalada en el campo 5) en forma parcial (“VP” en el campo 12) de la operación de que se trate.

El número de contratos vencidos anticipadamente para una misma operación, deberán ser menores a la posición abierta del día previo.

Cuando se requiera vencer anticipadamente el saldo de la posición, se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 12).

#### **11.- Motivo del vencimiento anticipado o cesión de derechos**

Se deberá anotar la clave que corresponda al motivo del vencimiento anticipado, o de la cesión de derechos, de la operación, conforme al “Catálogo de Motivo del Vencimiento Anticipado, o de la Cesión de Derechos”, a que se refiere el Anexo R.

#### **12.- Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos**

Se deberá anotar:

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

- VT** Cuando la operación se haya vencido (o terminado) anticipadamente en forma total.
- VP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial.
- CD** Cuando los derechos de la operación se hayan cedido.
- EX** Cuando la operación se haya terminado o extinguido anticipadamente.
- CP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente por compactación de portafolio sólo de una de las personas participantes
- OP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial por compactación de portafolio sólo de una de las personas participantes

En caso de que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en este campo), debido a la renegociación o reestructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 11), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación; considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado parcial.

Por su parte, en el evento que los derechos de una determinada operación sean cedidos, se deberá anotar “CD” en este campo, y la clave “5” en el campo 11.

### **13.- Número de identificación de la operación (original) o Identificador Único de Transacción (Original) (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) original de la operación que haya sido vencida (o terminada) anticipadamente o cedida. Este número (o clave) debe ser el mismo con el que se envió dicha operación a Banco de México.

### **14.- Número de identificación de la nueva operación Identificador Único de Transacción Nuevo (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

En caso de que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en el campo 12), debido a la renegociación o reestructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 11), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación; considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado total de que se trate. En este campo, se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de dicha nueva operación, tal cual fue informada al Banco de México en la sección que corresponda.

En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, o de vencimientos anticipados en forma parcial o total (distintos a los mencionados anteriormente), este campo debe reportarse “vacío”.

### **15.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la cuenta asignada al tenedor de la posición abierta a vencer.

### **16.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Se deberá anotar la subcuenta donde el tenedor del portafolio registra la posición abierta a vencer.

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

## Sección VII.- Relativa a las Contrapartes “personas morales”, distintas de fideicomisos

Los diversos campos del registro de cada contraparte deberán llenarse conforme a lo siguiente:

### 1.- Clave de la contraparte

En este campo se debe registrar la clave asignada por Banco de México en el “CGC”, a la contraparte (ya sea persona física o moral). Cuando se reporte una nueva contraparte (que no exista en el “CGC”) este campo debe enviarse vacío. Por su parte, cuando cambie alguna característica de una contraparte ya registrada en el CGC, este campo debe tener la clave correspondiente a la contraparte que se desea modificar.

### 2.- Nombre de la contraparte

Se deberá anotar el nombre completo de la Contraparte a reportar. El nombre no debe incluir abreviaciones, signos, comas o puntos, ni las siglas del tipo de sociedad mercantil.

### 3.- Tipo de sociedad mercantil

Se deberá anotar la clave que corresponda al tipo de Sociedad Mercantil de la Contraparte de que se trate, conforme al “Catálogo de Tipo de Sociedad Mercantil” a que se refiere el Anexo “G”.

### 4.- Tipo de identificador de la contraparte

Se deberá anotar el tipo de identificador de la Contraparte que se reporta, y que aplica al campo 5, conforme a las claves del catálogo “Tipo de Identificador” a que se refiere el Anexo “T”.

### 5.- Clave de identificador de la contraparte

Se deberá indicar la clave de identificador oficial que corresponda a la Contraparte de que se trate, conforme a lo reportado en el campo anterior.

### 6.- Tipo de contraparte

Se deberá anotar el tipo que corresponde a la Contraparte, conforme al catálogo de “Tipos de Contraparte” a que se refiere el Anexo “W”.

### 7.- Clave “LEI” (Legal Entity Identifier) de la contraparte

En su caso, deberá indicarse el Código LEI para aquellas Contrapartes que cuenten con dicho identificador, y que haya sido registrado y validado por la misma contraparte. Si no se tiene un Código LEI, en éste campo deberá reportarse “ND” (No Disponible).

### 8.- Sector de la contraparte, conforme al sistema de clasificación industrial de América del Norte (SCIAN)

Tratándose de Contrapartes que por sus características de negocio puedan clasificarse en distintas actividades industriales, deberá indicarse en este campo la clave de sector (SCIAN) de la actividad principal (la que aporta el mayor porcentaje de ingresos) que realice la Contraparte de que se trate, considerando al efecto las claves del “Catálogo de Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte”, a que se refiere el Anexo “Y”.

### 9.- País de residencia de quien controla a la contraparte

#### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Se deberá registrar el país de residencia de la persona o entidad quien *controla* a la Contraparte que se está reportando, conforme al “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”. Por *control* se debe entender lo señalado en el artículo 22 Bis Fracción II de la Ley de Instituciones de Crédito (L.I.C.).

#### **10.- País de residencia de la contraparte**

Se deberá anotar la clave que corresponda al país de residencia de la Contraparte de que se trate, conforme al “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”.

#### **11.- Clave “LEI” de matriz directa de la contraparte**

Para aquellas Contrapartes que tengan una matriz directa, deberá indicarse el Código LEI que corresponda a dicha matriz (la cual haya sido validada por la Contraparte de que se trate). En caso de que no se cuente con este Código deberá reportarse la clave correspondiente conforme al “CGC”. Lo anterior implica que la información de la matriz directa debe enviarse en forma previa al Banco de México en la Sección I o II, según corresponda. Si la contraparte no tiene una matriz directa, deberá indicarse “NA” (No Aplica).

#### **12.- Clave “LEI” de la matriz en última instancia de la contraparte**

Para aquellas Contrapartes que tengan una matriz de última instancia, deberá indicarse el Código LEI que corresponda a dicha matriz (la cual haya sido validada por la Contraparte de que se trate). En caso de que no se cuente con este Código deberá reportarse la clave correspondiente conforme al “CGC”. Lo anterior implica que la información de la matriz de última instancia debe enviarse en forma previa en la Sección I o II, según corresponda. Si la contraparte no tiene una matriz en última instancia, deberá indicarse “NA” (No Aplica).

#### **13.- Fecha de alta o modificación de la contraparte**

Cuando se reporte una nueva contraparte (que no exista en el “CGC”), en este campo deberá registrarse la fecha en la que se firmó el contrato correspondiente, con formato AAAA/MM/DD. Por su parte, cuando se reporte la modificación de alguna característica de una contraparte ya existente en el “CGC”, en este campo deberá registrarse la fecha de la modificación correspondiente, en el campo que corresponda la característica que fue modificada, y en el resto de los campos la información vigente que corresponda, conforme al “CGC”.

## **Sección VIII.- Relativa a Contrapartes “fideicomisos”**

Los diversos campos del registro de cada fideicomiso deberán llenarse conforme a lo siguiente:

#### **1.- Clave de la contraparte**

En este campo se debe registrar la clave asignada por Banco de México, en el “CGC” al fideicomiso correspondiente. Sin embargo, cuando se reporte un nuevo fideicomiso (que no exista en el “CGC”) este campo debe enviarse vacío. Por su parte, cuando cambie alguna característica de un fideicomiso ya registrado en el “CGC”, este campo debe tener la clave correspondiente al fideicomiso que se desea modificar.

#### **2.- Nombre del fideicomiso**

Se deberá anotar el nombre completo del fideicomiso tal como aparece en el acta constitutiva correspondiente, sin abreviaciones, comas o puntos.

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

**3.- Clave “LEI” (Legal Entity Identifier) del fideicomiso**

Se deberá indicar la clave de identificador oficial que corresponda al Fideicomiso de que se trate.

**4.- Tipo de identificador de la contraparte**

Se deberá anotar el tipo de identificador del fideicomiso que se reporta, y que aplica al campo 4, conforme a las claves del catálogo “Tipo de Identificador” a que se refiere el Anexo “T”.

**5.- Clave de identificador de la contraparte**

Se deberá indicar la clave de identificador oficial que corresponda al fideicomiso de que se trate, conforme a lo reportado en el campo anterior.

**6.- Origen de los recursos del fideicomiso**

Conforme al origen de los recursos que se aportan al fideicomiso, deberá anotarse la clave que corresponda de acuerdo con las claves del catálogo “Origen de los recursos del fideicomiso”, a que se refiere al Anexo “AC”.

**7.- Tipo de fideicomiso**

Se deberá anotar el tipo de fideicomiso, conforme a las finalidades estipuladas en el contrato respectivo, y de acuerdo con el catálogo de “Tipo de Fideicomiso” a que se refiere el Anexo “AE”.

**8.- País de residencia de la contraparte**

Se deberá anotar la clave que corresponda al país de residencia de la Contraparte de que se trate, conforme al “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”.

**9.- Fecha de alta o modificación del fideicomiso**

Cuando se reporte un nuevo fideicomiso (que no exista en el “CGC”), en este campo se deberá registrarse la fecha en la que se firmó el contrato de administración correspondiente, con formato AAAA/MM/DD. Por su parte, cuando se reporte la modificación de alguna característica de un fideicomiso ya existente en el “CGC”, en este campo se deberá registrar la fecha de la modificación correspondiente, en el campo que corresponda la característica que fue modificada, y en el resto de los campos la información vigente que corresponda, conforme al “CGC”.

**Sección IX.- Relativa a Contrapartes “personas físicas”**

Los diversos campos del registro de cada persona física deberán llenarse conforme a lo siguiente:

**1.- Clave de la contraparte**

En este campo se debe registrar la clave asignada por Banco de México, en el “CGC”. Cuando se reporte una nueva contraparte (que no exista en el “CGC”) este campo debe enviarse vacío. Por su parte, cuando cambie alguna característica de una contraparte ya registrada en el “CGC”, este campo debe tener la clave que corresponda a la contraparte que se desea modificar.

**2.- Nombre de la contraparte (personas físicas)**

Se deberá anotar el nombre completo de la persona física, indicando primeramente los apellidos, seguido del nombre o nombres. No deben incluirse abreviaciones, signos, comas o puntos.

**3.- Tipo de identificador de la contraparte****Uso Público**

Información de acceso público.

Se deberá anotar el tipo de identificador de la Contraparte que se reporta, y que aplica al campo 4, conforme a las claves del catálogo “Tipo de Identificador”, a que se refiere el Anexo “T”.

#### 4.- Clave de identificador de la contraparte

Se deberá indicar la clave de identificador oficial que corresponda a la persona física de que se trate, conforme a lo reportado en el campo anterior.

#### 5.- País de residencia de la contraparte

Se deberá anotar la clave que corresponda al país de residencia de la persona física de que se trate, conforme al “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”.

#### 6.- Tipo de contraparte

Deberá indicarse:

- 1.- Cuando la Contraparte sea una persona física **SIN** actividad empresarial
- 2.- Cuando la Contraparte sea una persona física **CON** actividad empresarial

#### 7.- Sector de la contraparte, conforme al sistema de clasificación industrial de América del Norte (SCIAN)

En el caso de personas físicas con actividad empresarial (clave 2 en el campo 6) deberá indicarse la clave de sector (SCIAN) de la actividad principal (la que aporta el mayor porcentaje de ingresos) que realice la Contraparte de que se trate, considerando al efecto las claves del “Catálogo de Sistema de Clasificación Industrial de América de Norte”, a que se refiere el Anexo “Y”.

Para el caso de personas físicas sin actividad empresarial (clave 1 en el campo 6), en este campo deberá reportarse “0” (cero, equivalente a No Aplica).

#### 8.- Fecha de alta o modificación de la contraparte

Cuando se reporte una nueva contraparte (que no exista en el “CGC”) en este campo deberá registrarse la fecha en la que se firmó el contrato correspondiente, con formato AAAA/MM/DD. Por su parte, cuando se reporte la modificación de alguna característica de una contraparte ya existente en el “CGC”, en este campo deberá registrarse la fecha de la modificación correspondiente, en el campo que corresponda, la característica que fue modificada, y en el resto de los campos la información vigente que respectiva, conforme al “CGC”.

## Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario

A. *Validaciones registro por registro.*

### Sección I, relativa a la posición abierta de futuros

#### 1.- Operador de la posición

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de

#### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P, o en el “Catálogo General de Contrapartes”. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”. Si la clave proviene del “Catálogo General de Contrapartes” deberá corresponder a instituciones de crédito; es decir, aquellas claves con tipo de ente igual a “4” o “5” y Residencia igual a “N”.

## 2.- Origen de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P”, “T” o “F”, según sea el caso.

En caso de que se utilice la clave “F” en este campo, la clave anotada en el campo 1 deberá estar comprendida en el “Catálogo de Formadores de Mercado”, en el campo Clave a que se refiere el Anexo AQ; considerando que la fecha de corte, campo 4, debe ser mayor o igual a la fecha de inicio (fe\_ini) y menor o igual a la fecha de vencimiento (fe\_ven) para alguno de los registros de dicho catálogo. Sin embargo, la contraparte central podrá solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevas claves y vigencias al catálogo AQ, a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx.

## 3.- Clave de la persona clienta

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberá estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo “P” o en el “Catálogo General de Contrapartes”.

Adicionalmente, si el campo 2 es igual a “P” o “F” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 1. En caso de que el campo 2 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 1.

## 4.- Fecha de corte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente esta fecha debe ser mayor o igual a la “Fecha de inicio de cotización” y menor o igual a la “Fecha de vencimiento”, conforme a los campos respectivos del Anexo AA, que correspondan a la pizarra registrada en el campo 6.

## 5.- Posición en la pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “C” o “V”.

## 6.- Clave de pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “pizarra” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (campo “Mercado” (mdo) del Anexo AA) debe ser igual a “MEX”. Adicionalmente, el campo “OFF” (off1) del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra, debe ser igual a “1”.

### Uso Público

Información de acceso público.

**7.- Fecha de vencimiento de la pizarra**

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente esta fecha debe ser mayor o igual al campo “Fecha de corte”. Asimismo, la fecha reportada en este campo deberá ser igual a la fecha de vencimiento (fe\_ven) del Anexo AA que corresponda a la clave de pizarra reportada en el campo 6.

**8.- Socio liquidador**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”.

**9.- Número de contratos vigentes (abiertos) en posición**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

Cuando el subyacente (campo “suby”) de la pizarra reportada en el campo 6 a que hace referencia el catálogo AA sea igual “TDM”, este campo deberá ser menor o igual a 360 mil.

Cuando el subyacente (campo “suby”) de la pizarra reportada en el campo 6 a que hace referencia el catálogo AA sea igual “ACM”, este campo deberá ser menor o igual a 442 mil.

**10.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

**11.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

**Sección II, relativa a la posición abierta de opciones****1.- Operador de la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P, o en el “Catálogo General de Contrapartes”. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”. Si la clave proviene del “Catálogo General de Contrapartes” deberá corresponder a instituciones de crédito; es decir, aquellas claves con tipo de ente igual a “4” o “5” y Residencia igual a “N”.

**2.- Origen de la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P”, “T” o “F”, según sea el caso.

**Uso Público**

Información de acceso público.

En caso de que se utilice la clave “F” en este campo, la clave anotada en el campo 1 deberá estar comprendida en el “Catálogo de Formadores de Mercado”, en el campo Clave a que se refiere el Anexo AQ; considerando que la fecha de corte, campo 4, debe ser mayor o igual a la fecha de inicio (fe\_ini) y menor o igual a la fecha de vencimiento (fe\_ven) para alguno de los registros de dicho catálogo. Sin embargo, la contraparte central podrá solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevas claves y vigencias al catálogo AQ, a través de un correo electrónico a la dirección [derivados@banxico.org.mx](mailto:derivados@banxico.org.mx).

### **3.- Clave de la persona clienta**

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberá estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo “P” o en el “Catálogo General de Contrapartes”.

Adicionalmente, si el campo 2 es igual a “P” o “F” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 1. En caso de que el campo 2 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 1.

### **4.- Fecha de Corte**

Este campo no podrá reportarse vacío.

### **5.- Posición en la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”.

### **6.- Clave de Pizarra**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave reportada por las instituciones en este campo debe tener el siguiente formato “XY123456Z”; es decir, un largo máximo de 8 caracteres, de los cuales los dos primeros y el último deben ser letras mayúsculas, mientras que el resto deben ser exclusivamente números. Adicionalmente, el resultado de concatenar dichas dos primeras letras con la última letra forma una clave nueva que debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA. Por ejemplo, si la clave reportada en este campo es “IP45500F”; entonces la clave nueva generada conforme a lo señalado anteriormente debe ser “IPF”; la cual debe estar comprendida en el Anexo AA. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Anexo AA) debe ser igual a “MEX”.

### **7.- Fecha de vencimiento de la pizarra**

Este campo no podrá reportarse vacío.

### **8.- Socio liquidador**

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”.

#### **9.- Precio unitario o tasa de ejercicio**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor a 150 mil.

#### **10.- Número de contratos vigentes (abiertos) en posición**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

Cuando el subyacente (campo “suby”) de la pizarra reportada en el campo 6 a que hace referencia el catálogo AA sea igual “TDM”, este campo deberá ser menor o igual a 360 mil.

Cuando el subyacente (campo “suby”) de la pizarra reportada en el campo 6 a que hace referencia el catálogo AA sea igual “ACM”, este campo deberá ser menor o igual a 442 mil.

#### **11.- Valor de la Volatilidad Implícita**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor que “0” (cero).

#### **12.- Valor de la Delta**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno.

#### **13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

#### **14.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

### **Sección III, relativa a la posición abierta de swaps**

#### **1.- Institución u operador de la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la “Institución” o de la entidad denominada “Operador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P, o en el “Catálogo General de Contrapartes”. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”. Si la clave proviene del “Catálogo General de Contrapartes” deberá corresponder

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

a instituciones de crédito, casas de bolsa o a la Financiera; es decir, aquellas claves con tipo de ente igual a “4”, “5”, “6”, o “30” y Residencia igual a “N”.

## 2.- Fecha de concertación

Este campo no podrá reportarse vacío.

## 3.- Origen de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P”, “T” o “F”, según sea el caso.

En caso de que se utilice la clave “F” en este campo, la clave anotada en el campo 1 deberá estar comprendida en el “Catálogo de Formadores de Mercado”, en el campo Clave a que se refiere el Anexo AQ; considerando que la fecha de corte, campo 5, debe ser mayor o igual a la fecha de inicio (fe\_ini) y menor o igual a la fecha de vencimiento (fe\_ven) para alguno de los registros de dicho catálogo. Sin embargo, la contraparte central podrá solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevas claves y vigencias al catálogo AQ, a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx.

## 4.- Clave de la persona cliente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberá estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo “P” o en el “Catálogo General de Contrapartes”.

Adicionalmente, si el campo 3 es igual a “P” o “F” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 1. En caso de que el campo 3 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 1.

## 5.- Fecha de corte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada deberá ser mayor o igual a la fecha de concertación de la operación (campo 2).

## 6.- Valor de la tasa fija a recibir

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que se reciba una tasa fija (campo “23-Posición en la Operación” igual a “1” o “3”), el valor numérico debe ser igual o mayor que cero y menor que quince. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso de que el valor reportado esté fuera del rango anterior debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar la tasa fija con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

### Uso Público

Información de acceso público.

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 7 no pueden ser simultáneamente igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen una tasa variable (Clave “2” en el campo “23-Posición en la Operación”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave “3” en el campo 23), este campo deberá ser distinto a “0” (cero).

#### **7.- Valor de la tasa fija a entregar**

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que se entregue una tasa fija (campo “23-Posición en la Operación” igual a “1” o “3”, el valor numérico debe ser igual o mayor que cero y menor que quince. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso de que el valor reportado esté fuera del rango anterior debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar la tasa fija con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 6 no pueden ser simultáneamente igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen una tasa variable (Clave “2” en el campo “23-Posición en la Operación”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave “3” en el campo 23), este campo deberá ser distinto a “0” (cero).

#### **8.- Tasa de referencia para determinar la tasa variable a recibir**

Este campo no deberá reportarse vacío. En caso de que se reciba una tasa variable, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF. Sin embargo, tratándose de operaciones que reciban tasa fija, campo 6 distinto a “0” (cero), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 9 no pueden ser simultáneamente igual a “NA” (No Aplica).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen una tasa variable (Clave “2” en el campo “23-Posición en la Operación”), este campo y el campo 9 no pueden ser igual a “NA”.

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave “3” en el campo 23), este campo deberá ser igual a “NA”.

#### **9.- Tasa de referencia para determinar la tasa variable a entregar**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no deberá reportarse vacío. En caso de que se entregue una tasa variable, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF. Sin embargo, tratándose de operaciones que entreguen tasa fija, campo 7 distinto a “0” (cero), se deberá anotar la clave “NA” (No Aplica).

Tratándose de operaciones que se intercambia una tasa fija por una tasa variable (clave “1” en el campo 23), este campo y el campo 8 no pueden ser simultáneamente igual a “NA” (No Aplica).

Tratándose de operaciones que reciban y entreguen una tasa variable (Clave “2” en el campo “23- Posición en la Operación”), este campo y el campo 8 no pueden ser igual a “NA”.

Tratándose de operaciones que se intercambie una tasa fija por otra tasa fija (clave “3” en el campo 23), este campo deberá ser igual a “NA”.

#### **10.- Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a recibir**

Este campo no deberá reportarse vacío y podrá ser negativo. En caso de que el campo 8 (“Tasa variable a recibir”) sea distinto de “NA” este campo podrá ser distinto de “0” (cero).

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser mayor o igual que menos diez (-10) y menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso de que el valor reportado se encuentre fuera del rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el valor de la tasa fija a recibir (campo 6) sea mayor que cero, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

#### **11.- Puntos porcentuales aplicables a la tasa variable a entregar**

Este campo no deberá reportarse vacío y podrá ser negativo. En caso de que el campo 9 (“Tasa variable a entregar”) sea distinto de “NA” este campo podrá ser distinto de “0” (cero).

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser mayor o igual que menos diez (-10) y menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso de que el valor reportado se encuentre fuera del rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el valor de la tasa fija a entregar (campo 7) sea mayor que cero, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

#### **12.- Tipo de cambio de la operación**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no deberá reportarse vacío. Adicionalmente, cuando la clave del tipo de Swap (campo 18) sea igual a “CCS”, este campo deberá ser mayor que “0” (cero). Cuando se trate de operaciones “IRS”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

### 13.- Fecha de inicio del primer flujo

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD, y puede corresponder a un día inhábil bancario.

### 14.- Fecha de vencimiento del último flujo

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de inicio del primer flujo (campo 13) y a la fecha de concertación de la operación (Campo 2). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer las siguientes condiciones,

$$|Fe_{ven\_ope} - (Fe_{ini\_flu} + Nu_{flu} * Freq_{pago\_recib})| \leq \text{al campo 16},$$

$$|Fe_{ven\_ope} - (Fe_{ini\_flu} + Nu_{flu} * Freq_{pago\_ent})| \leq \text{al campo 17}$$

Donde:

$Fe_{ven}$  es el valor de este campo,

$Fe_{ini}$  es el valor del campo 13,

$Nu_{flu}$  es el valor del campo 15,

$Freq_{pago\_recib}$  es el valor del campo 16 del registro,

$Freq_{pago\_ent}$  es el valor del campo 17 del registro.

### 15.- Número total de flujos del swap

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser igual o mayor que uno. Adicionalmente, cuando este campo sea igual a “1”, se debe mostrar la siguiente advertencia (o diagnóstico no grave): “Favor de confirmar el número total de flujos con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Asimismo, el valor del resultado de extraer la cadena “X1” de la clave de pizarra, campo 24, debe corresponder al valor reportado en este campo.

### 16.- Frecuencia de pago del importe a recibir

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser igual o mayor que uno.

Adicionalmente, si el campo 15 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días del campo 13 (“Fecha de inicio del primer flujo”) y el campo 14 (“Fecha de vencimiento”).

#### Uso Público

Información de acceso público.

Si este campo es mayor o igual que “730” se enviará el diagnóstico no grave “Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en este campo”.

#### **17.- Frecuencia de pago del importe a entregar**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser igual o mayor que uno.

Adicionalmente, si el campo 15 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días del campo 13 (“Fecha de inicio del primer flujo”) y el campo 14 (“Fecha de vencimiento”).

Si este campo es mayor o igual que “730” se enviará el diagnóstico no grave “Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en este campo”.

#### **18.- Tipo de contrato Swap**

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “IRS” y “CCS”.

#### **19.- Origen de procedencia**

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “MEX” y “OTC”.

#### **20.- Broker de la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Plataformas de Negociación” a que se refiere el Anexo K.

#### **21.- Herramienta de negociación**

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Plataformas de Negociación” a que se refiere el Anexo K.

#### **22.- Número de identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2). Si el campo origen de procedencia (campo 19) es igual a “OTC” se deberá registrar el Identificador Único de Transacción.

#### **23.- Posición en la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “1”, “2” o “3”.

#### **24.- Clave de la pizarra**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “pizarra” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Catálogo Pizarra AA. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Catálogo AA) debe ser igual a “MEX”. Adicionalmente, la columna “swaps1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “1”.

#### **25.- Socio liquidador**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”.

#### **26.- Número de contratos vigentes (abiertos) en posición**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

#### **27.- Valuación de la parte activa de la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

#### **28.- Valuación de la parte pasiva de la operación**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

#### **29.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

#### **30.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

## **Sección IV, relativa a la información de los movimientos que afectan la posición abierta de futuros, opciones y swaps entre un día hábil y otro**

**VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO.** Los registros que la institución reporte en la Sección IV (en su fecha de movimiento) deberán corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con alguno de los registros enviados un día hábil anterior o con alguno de los registros enviados el mismo día de la fecha de movimiento (campo 2) en las Secciones I a III.

#### **1.- Institución u operador de la posición**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la “Institución” o la clave de la entidad denominada “Operador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P, o en el “Catálogo General de Contrapartes”. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”. Si la clave proviene del “Catálogo General de Contrapartes” deberá corresponder a instituciones de crédito, casas de bolsa o a la Financiera; es decir, aquellas claves con tipo de ente igual a “4”, “5”, “6” o “30” y Residencia igual a “N”.

## 2.- Fecha de movimientos

Este campo no podrá reportarse vacío.

## 3.- Formulario

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “FU”, “OP” o “SW”, según sea el caso.

## 4.- Clave de pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “pizarra” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Catálogo Pizarra AA. Adicionalmente,

- La columna “off1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “1” si el formulario al que pertenece el movimiento (campo 3) es igual a “FU”. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Catálogo AA) debe ser igual a “MEX”.
- La columna “opto1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “1” si el formulario al que pertenece el movimiento (campo 3) es igual a “OP”. Para realizar dicha verificación, La clave reportada por las instituciones en este campo debe tener el siguiente formato “XY123456Z”; es decir, un largo máximo de 8 caracteres, de los cuales los dos primeros y el último deben ser letras mayúsculas, mientras que el resto deben ser exclusivamente números. Adicionalmente, el resultado de concatenar dichas dos primeras letras con la última letra forma una clave nueva que debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA. Por ejemplo, si la clave reportada en este campo es “IP45500F”; entonces la clave nueva generada conforme a lo señalado anteriormente debe ser “IPF”; la cual debe estar comprendida en el Anexo AA. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Anexo AA) debe ser igual a “MEX”.
- La columna “swaps1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “1” si el formulario al que pertenece el movimiento (campo 3) es igual a “SW”. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Catálogo AA) debe ser igual a “MEX”.

### Uso Público

Información de acceso público.

## 5.- Posición en la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Se deberá anotar,

- La clave “C” o “V”, cuando el formulario (campo 3) es igual a “FU”.
- La clave “A” o “E”, cuando el formulario (campo 3) es igual a “OP”.
- La clave “1”, “2” o “3”, cuando el formulario (campo 3) es igual a “SW”.

## 6.- Movimientos en número de contratos

Este campo no podrá reportarse vacío, y el valor absoluto de este campo deberá ser mayor a cero. Adicionalmente, el número de contratos vigentes (abiertos) en posición a la fecha de movimiento (campo 2) en las Secciones I a III, según corresponda el formulario (campo 3), deberá ser el resultado del número de contratos vigentes (abiertos) en la posición reportada un día hábil anterior a la fecha de movimiento (campo 2) en las Secciones I a III, más el número de contratos del movimiento (campo 6) conforme a los campos “llave” para las Secciones I y II; Clave de la entidad con posición, Origen de la posición, Clave de la persona cliente con posición, Posición en la pizarra, Clave de la pizarra, Socio liquidador, Cuenta y Sub cuenta o los campos “llave” para la Sección III; Clave de la entidad, Clave de la persona cliente y Número de identificación de la operación.

## 7.- Motivo del cambio de la posición

Este campo no podrá reportarse vacío, y el valor que se anote deberá estar comprendido en el “Catálogo de Movimientos”. Adicionalmente, si el formulario (campo 3) es distinto del valor “SW” no podrán reportarse las claves “VP”, “VT”, “SP” ni “ST”. Asimismo, si el formulario (campo 3) al que pertenece el movimiento es distinto de “OP” no podrán reportarse las claves “EA” ni “EX”.

## 8.- Precio de cierre para la determinación del ejercicio (opciones)

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, si el formulario (campo 3) al que pertenece el movimiento es distinto del valor “OP”, este deberá reportarse como cero “0”. Si el formulario (campo 3) es igual a “OP” y el motivo de cambio de posición (campo 7) es igual a “EA” o “EX” este campo deberá ser mayor a cero “0”.

## 9.- Socio liquidador

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”.

## 10.- Origen de la operación

### Uso Público

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P”, “T” o “F”, según sea el caso.

En caso de que se utilice la clave “F” en este campo, la clave anotada en el campo 1 deberá estar comprendida en el “Catálogo de Formadores de Mercado”, en el campo Clave a que se refiere el Anexo AQ; considerando que la fecha de movimiento, campo 2, debe ser mayor o igual a la fecha de inicio (fe\_ini) y menor o igual a la fecha de vencimiento (fe\_ven) para alguno de los registros de dicho catálogo. Sin embargo, la contraparte central podrá solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevas claves y vigencias al catálogo AQ, a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx.

#### **11.- Número de identificación de la operación o Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Este campo podrá ir vacío. Este campo no podrá ir vacío si el formulario (campo 3) es igual al valor “SW”.

#### **12.- Clave de la persona clienta**

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberá estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo “P” o en el “Catálogo General de Contrapartes”.

Adicionalmente, si el campo 10 es igual a “P” o “F” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 1. En caso de que el campo 10 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 1.

#### **13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

#### **14.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

## **Sección V, relativa a los contratos que garantizan operaciones derivadas celebradas en mercados reconocidos (Bursátiles)**

### **1.- Clave de la Institución**

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

### **2.- Oficina que realiza el contrato**

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Anexo A. Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución tenga “Agencias o Sucursales en el Extranjero” (conforme al “Catálogo de Instituciones con Agencias y/o Sucursales en el Extranjero”, si la institución del campo 1 no aparece en dicho catálogo, entonces este campo no puede ser igual a “A”). Se deberá anotar “F” en el caso de que la clave de institución (del campo 1) corresponda a una “Entidad Filial Financiera del Exterior”. Se podrá anotar “R” sólo en el caso que la clave de institución del “campo 1” corresponda a una institución de banca múltiple (campo 1 inicia con “040”), una institución de banca de desarrollo (campo 1 inicia con “037”), una casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o una SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

### **3.- Mercado**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave del “mercado” que se anote deberá ser igual a “MEX”.

### **4.- Socio liquidador**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda al socio liquidador de este campo, debe ser igual a “MEX”.

### **5.- Fecha de Corte**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a reportar.

### **6.- Clave o folio para identificar el Contrato de Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser distinto de “NA”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el campo persona cliente (campo 14). Adicionalmente, el valor de este campo deberá estar incluido (conforme los campos “llave”: persona cliente y fecha de corte) en alguno de los registros de los formularios de posición abierta (campo 3 y campo 4, Sección I), Opto (campo 3 y campo 4, Sección II) o Swaps (campo 4 y campo 5, Sección III); sin embargo, en caso de que el contrato de garantía no tenga asociado alguna operación vigente deberá comunicarse a [derivados@banxico.org.mx](mailto:derivados@banxico.org.mx).

### **7.- Número consecutivo para identificar los Activos que forman parte del Contrato de Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe iniciar en “1” (uno), y continuar en forma secuencial (2, 3, 4, 5, etc.) para los registros que tengan la misma clave o folio en el campo “6-Clave o folio para identificar el contrato de garantía”. Adicionalmente, este número no podrá ser

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

el mismo para dos o más registros que tengan la misma fecha de corte (campo 5) y clave o folio para identificar el contrato de garantía (campo 6).

#### **8.- Tipo de Activo en Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Tipos de Activos en Garantía” a que se refiere el Anexo AD.

#### **9.- Clave del Valor (Título de deuda o acción) en Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la clave del campo 8 (“Tipo de Activo en Garantía”) corresponda a un título de deuda, título representativo de capital, o título referenciado a acciones (es decir, cuando el texto de la columna “Clase de Activo en Garantía” del “Anexo AD”, que corresponda a la clave reportada en el campo “8 - Tipo de Activo en Garantía” sea igual a “Títulos de Deuda” o “Acciones”), entonces la clave que se registre en este campo debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Títulos de Deuda, Acciones, Tasas de Interés y Tipos de Cambio” a que se refiere el Anexo AF, y ser distinta de “NA”. Asimismo, la “Clase Subyacente” (columna “clase\_subyacente” del Anexo AF) que corresponda al valor de este campo, debe ser similar (considerando como equivalentes “Acciones” Vs. “Acción Individual” y “Títulos de Deuda” Vs. “Títulos deuda/Títulos referenciados”) al texto de la columna “activo” del Anexo AD, que corresponda a la clave registrada en el campo “8-Tipo de Activo en Garantía”. Por ejemplo, si el valor de este campo es igual a “MX0MGO000078”, que de acuerdo a la columna “clase\_subyacente” del Anexo AF es igual a “Títulos deuda”, este valor debe ser equivalente al que corresponda a la columna “activo” del Anexo AD (igual a “Títulos de deuda”, cuando el campo “8-Tipo de Activo en Garantía” sea igual a “6”).

Si la clave del campo “8-Tipo de Activo en Garantía” es distinta de un título de deuda o un título representativo de capital (es decir, cuando el texto de la columna “Clase de Activo en Garantía” en el “Anexo AD”, que corresponda a la clave reportada en el campo “8 - Tipo de Activo en Garantía”, sea diferente de “Títulos de Deuda” o “Acciones”), este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

#### **10.- Porcentaje de aforo aplicable al Activo en Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá estar comprendido entre 30 y 100.

#### **11.- Valor de Mercado del Activo en Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno.

#### **12.- Moneda del Activo en Garantía**

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero).

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

Adicionalmente, en caso de que el campo “8-Tipo de Activo en Garantía” sea igual a alguna de las claves siguientes: “2”, “4”, “5”, “7”, “11”, “13”, “17”, “19”, “28”, “30”, “32”, “41”, “43”, “44”, “45” o “48”, entonces este campo debe ser distinto de las claves “484” y “979”.

De la misma forma, en caso de que el campo “8-Tipo de Activo en Garantía” sea igual a alguna de las claves siguientes: “1”, “3”, “6”, “10”, “12”, “16”, “18”, “27”, “29”, “31”, “40”, “42” o “47”, entonces este campo debe ser igual a las claves “484” o “979”.

### 13.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

### 14.- Clave de la persona clienta del contrato de garantía

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberán estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo General de Contrapartes”.

## Sección VI, relativa a vencimientos anticipados, o cesiones de derechos de swaps

**VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO.** Los registros que la institución reporte en la Sección VI (en su fecha de vencimiento) deberán corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con los registros enviados un día hábil anterior de la fecha de vencimiento en la Sección III y en la misma fecha de vencimiento en la Sección IV.

### 1.- Institución u operador de la posición

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la “Institución” o la clave de la entidad denominada “Operador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P, o en el “Catálogo General de Contrapartes”. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser igual a “MEX”. Si la clave proviene del “Catálogo General de Contrapartes” deberá corresponder a instituciones de crédito, casas de bolsa o a la Financiera; es decir, aquellas claves con tipo de ente igual a “4”, “5”, “6” o “30” y Residencia igual a “N”.

Este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VI, con los correspondientes de las Secciones III y IV.

### 2.- Origen de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P”, “T” o “F”, según sea el caso.

### 3.- Clave de la persona clienta

#### Uso Público

Información de acceso público.

**Formulario relativo a las posiciones de futuros, opciones, swaps y garantías en operaciones derivadas registradas en ASIGNA**

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México deberá estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo “P” o en el “Catálogo General de Contrapartes”.

Adicionalmente, si el campo 2 es igual a “P” o “F” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 1. En caso de que el campo 2 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 1.

Este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VI, con los correspondientes de la Sección III, enviados el día previo, y con los de la Sección IV con fecha de información igual a la fecha de fecha de vencimiento, campo 5 de esta sección.

#### **4.- Fecha de concertación**

Este campo no podrá reportarse vacío. Este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VI, con los correspondientes de la Sección III.

#### **5.- Fecha de vencimiento anticipado**

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de concertación (campo 4) y menor que la “Fecha de Vencimiento” de la operación, reportada un día hábil anterior a la fecha reportada en este campo, que tenga los mismos campos “llave”; Clave de la Institución, Clave de la persona cliente, Fecha de concertación y Número de identificación en la Sección III.

Este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VI, con los correspondientes de la Sección IV.

#### **6.- Fecha de liquidación anticipada**

Este campo podrá reportarse vacío. La fecha registrada deberá ser igual o mayor a la “Fecha de vencimiento anticipado” (campo 5).

#### **7.- Importe por el vencimiento anticipado total o cesión de derechos**

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que el campo 12, “Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos”, sea igual a “EX”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 12, “Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos”, es distinto de “EX”, este campo debe ser igual o mayor que “0” (cero). Asimismo, si el campo 9, “La entidad pagó o recibió el importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos”, es igual a “N”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

#### **8.- Moneda del importe por vencimiento anticipado o cesión de derechos**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que el campo 7, “Importe por el vencimiento anticipado total o cesión de derechos”, sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 7 es mayor que “0” (cero), la clave de este campo debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero).

#### **9.- La entidad pagó o recibió el importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos**

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “R”, “P” o “N”.

#### **10.- Número de contratos que vencen anticipadamente**

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser mayor a cero “0”. Adicionalmente, si el campo 12, “Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos”, es igual a “VP”, entonces este campo debe ser mayor que cero y menor al campo 26, “Número de contratos vigentes (abiertos) en posición”, de la Sección III reportado un día hábil anterior a la fecha de vencimiento que corresponda el registro de esta Sección VI, conforme a los campos “llave”; Clave de la entidad (campo 1), Clave de la persona cliente (campo 3), Fecha de concertación (campo 4) y Número de identificación (campo 13).

Adicionalmente, si el campo 12, “Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos”, es igual a “VT”, entonces este campo debe ser igual al campo 26, “Número de contratos vigentes (abiertos) en posición”, de la Sección III reportado un día hábil anterior a la fecha de vencimiento que corresponda el registro de esta Sección VI, conforme a los campos “llave”; Clave de la entidad (campo 1), Clave de la persona cliente (campo 3), Fecha de concertación (campo 4) y Número de identificación (campo 13).

Este campo deberá ser igual al campo 6, “Movimiento en número de contratos”, reportado en la Sección IV, conforme a los campos “llave”; Clave de la entidad (campo 1), Clave de la persona cliente (campo 3), Fecha de vencimiento anticipado (campo 5) y Número de identificación (campo 13), para la “llave” de la Sección IV la fecha a utilizarse deberá ser el campo 2, “Fecha de movimiento”.

#### **11.- Motivo del vencimiento anticipado o cesión de derechos**

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Motivo de la Vencimiento anticipado”, a que se refiere el Anexo R. Adicionalmente, si el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “CD”, entonces este campo debe ser igual a “5”.

Si el campo 12, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “CP” u “OP”, entonces este campo deberá de ser igual a “4”.

#### **12.- Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos**

### **Uso Público**

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “VT”, “VP”, “CD”, “CP”, “OP” o “EX”.

Adicionalmente, si el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “5”, este campo debe ser igual a “CD”.

Si el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “8” o “9”, este campo debe ser igual a “EX”.

Asimismo, si el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “1”, “2”, “3” o “4”, este campo debe ser igual a “VT” o “VP”.

Finalmente, cuando el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “7”, este campo debe ser igual a “VT”.

### **13.- Número de identificación de la operación (original) o Identificador Único de Transacción (Original) (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 4) y fecha de vencimiento anticipado (campo 5).

Adicionalmente, este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VI, con los correspondientes de las Secciones III y IV.

### **14.- Número de identificación de la nueva operación o Identificador Único de Transacción Nuevo (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)**

Este campo podrá reportarse vacío. Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 12, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” o “EX”. También debe ser vacío cuando el campo 12, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea igual a “VT” y el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea distinto de “7”.

Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 12, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea igual a “VT” y el campo 11, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “7”.

### **15.- Cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

### **16.- Sub cuenta donde se encuentra registrada la posición**

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

## Sección VII, relativa a las Contrapartes “personas morales”, distintas de fideicomisos

### A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

#### 1.- Clave de la contraparte

En caso de una nueva contraparte este campo debe ser vacío. Por su parte, cuando se reporte alguna modificación, la clave que se reporte debe estar comprendida en el Anexo “B”.

#### 2.- Nombre de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar exclusivamente letras mayúsculas y números, sin acentos, y no debe contener signos o símbolos (por ejemplo: “+”, “-”, “#”, “%”, “\*”, “&”, etc.), ni comas o puntos. La longitud del nombre será de un mínimo de 2 caracteres hasta un máximo de 150.

#### 3.- Tipo de sociedad mercantil

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “Tipo de Sociedad” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Tipo de Sociedad Mercantil” a que se refiere el Anexo “G”.

#### 4.- Tipo de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “Tipo de identificador” que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo de “Tipo de Identificador”, a que se refiere el Anexo “T”, y ser distinta de las claves “2” y “4”.

#### 5.- Clave de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la clave del campo 4 sea igual a “1”, este campo debe tener una longitud de 12 caracteres y éstos deberán ser exclusivamente letras mayúsculas o números.

#### 6.- Tipo de contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “tipo de contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo de “Tipos de Contraparte” a que se refiere el Anexo “W”. Asimismo, la clave anterior no podrá ser igual a “25”, “44” ni “45”.

#### 7.- Clave “LEI” (Legal Entity Identifier) de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la contraparte cuente con “Código LEI”, este campo debe tener una longitud de 20 caracteres que sean exclusivamente letras y/o números. En

#### Uso Público

Información de acceso público.

caso de que la contraparte no cuente con Código LEI, este campo debe ser igual a “ND” (No Disponible).

#### **8.- Sector de la contraparte, conforme al Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte (SCIAN)**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “sector de la contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Sistema de Clasificación Industrial de América de Norte”, a que se refiere el Anexo “Y” y ser distinta de “0” (cero).

#### **9.- País de residencia de quien controla a la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “país de residencia” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”. En caso de que la contraparte no tenga una empresa o persona que la controle, este campo debe ser igual a “ND” (equivalente a No Aplica).

#### **10.- País de residencia de la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “país de residencia” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”. Asimismo, si la clave del campo 4 es igual a “1”, este campo debe ser igual a “MX”, en caso de que dicha clave sea igual a “3”, este campo debe ser diferente de “MX”.

#### **11.- Clave “LEI” de matriz directa de la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la Matriz de la contraparte cuente con Código LEI, este campo debe tener una longitud de 20 caracteres que sean exclusivamente letras y/o números. En caso de que la Matriz de la contraparte no cuente con Código LEI, entonces la clave que se reporte deberá estar comprendida en el Anexo “B”. Si la contraparte no tiene una matriz directa este campo debe ser igual a “NA” (No Aplica).

#### **12.- Clave “LEI” de la matriz en última instancia de la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la Matriz en última instancia de la contraparte cuente con Código LEI, este campo debe tener una longitud de 20 caracteres que sean exclusivamente letras y/o números. En caso de que la Matriz de la contraparte no cuente con Código LEI, entonces la clave que se reporte deberá estar comprendida en el Anexo “B”. Si la contraparte no tiene una matriz de última instancia este campo debe ser igual a “NA” (No Aplica).

#### **13.- Fecha de alta o modificación de la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá tener formato AAAA/MM/DD.

#### **Uso Público**

Información de acceso público.

## Sección VIII, relativa a Contrapartes “fideicomisos”

### A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

#### 1.- Clave de la contraparte

En caso de una nueva contraparte este campo debe ser vacío. Por su parte, cuando se reporte alguna modificación, la clave que se reporte debe estar comprendida en el Anexo “B”.

#### 2.- Nombre del fideicomiso

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar exclusivamente letras mayúsculas y números, sin acentos, y no debe contener signos o símbolos (por ejemplo: “+”, “-”, “#”, “%”, “\*”, “&”, etc.), ni comas o puntos. La longitud del nombre será de un mínimo de 2 caracteres hasta un máximo de 150.

#### 3.- Clave “LEI” (Legal Entity Identifier) del fideicomiso

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que el fideicomiso cuente con Código LEI, este campo debe tener una longitud de 20 caracteres que sean exclusivamente letras y/o números. En caso de no cuente con Código LEI, este campo debe ser igual a “ND” (No Disponible).

#### 4.- Tipo de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “Tipo de identificador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de “Tipo de Identificador”, a que se refiere el Anexo “T”, y ser distinta de las claves “2” y “4”.

#### 5.- Clave de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la clave del campo 4 sea igual a “1”, este campo debe tener una longitud de 12 caracteres y éstos deberán ser exclusivamente letras mayúsculas y números.

#### 6.- Origen de los recursos del fideicomiso

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “origen de los recursos” que se anote deberá estar comprendida en el “Origen de los recursos del fideicomiso”, a que se refiere el Anexo “AC”.

#### 7.- Tipo de fideicomiso

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “Tipo de fideicomiso” que se anote deberá estar comprendida en el “Tipo de Fideicomiso”, a que se refiere el Anexo “AE”.

#### 8.- País de residencia de la contraparte

### Uso Público

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “país de residencia” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”. Asimismo, si la clave del campo 4 es igual a “1”, este campo debe ser igual a “MX”, en caso de que dicha clave sea igual a “3”, este campo debe ser diferente de “MX”.

#### 9.- Fecha de alta o modificación del fideicomiso

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá tener formato AAAA/MM/DD.

## Sección IX, relativa a Contrapartes “personas físicas”

### A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

#### 1.- Clave de la contraparte

En caso de una nueva contraparte este campo debe ser vacío. Por su parte, cuando se reporte alguna modificación, la clave que se reporte debe estar comprendida en el Anexo “B”.

#### 2.- Nombre de la contraparte (personas físicas)

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar exclusivamente letras mayúsculas, sin acentos, y no debe contener signos o símbolos (por ejemplo: “+”, “-”, “#”, “%”, “\*”, etc.), ni comas o puntos.

#### 3.- Tipo de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “Tipo de identificador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de “Tipo de Identificador”, a que se refiere el Anexo “T”, y ser distinta de “3”.

#### 4.- Clave de identificador de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la clave del campo 3 sea igual a “1”, este campo debe tener una longitud de 13 caracteres, que sean exclusivamente letras mayúsculas y números. Si la clave del campo 3 es igual a “4”, este campo debe tener una longitud de 18 caracteres, que sean exclusivamente letras mayúsculas y números.

#### 5.- País de residencia de la contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “país de residencia” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Países” a que se refiere el Anexo “Z”. Asimismo, si la clave del campo 3 es igual a “1”, este campo debe ser igual a “MX”, en caso de que dicha clave sea igual a “2”, este campo debe ser diferente de “MX”.

#### 6.- Tipo de contraparte

### Uso Público

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío y aceptará únicamente los valores “1” o “2”, según sea el caso. Si este campo es igual a “2”, el campo 7 deberá ser distinto de cero.

**7.- Sector de la contraparte, conforme al Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte (SCIÁN)**

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, en caso de que la clave del campo 6 sea igual a “1”, este campo debe ser igual a “0” (cero) u “814”. En caso de que la clave del campo 6 sea igual a “2”, este campo deberá contener una clave comprendida en el catálogo del Sistema de Clasificación Industrial de América del Norte (SCIÁN) a que se refiere el Anexo “Y” y ser distinta de “0” (cero) u “814”.

**8.- Fecha de alta o modificación de la contraparte**

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá tener formato AAAA/MM/DD.

**Uso Público**

Información de acceso público.



BANCO DE MÉXICO

Junio 2018

[www.banxico.org.mx](http://www.banxico.org.mx)