

# FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE REPORTE DE TÍTULOS DE DEUDA, DE LAS INSTITUCIONES DE CRÉDITO Y CASAS DE BOLSA.

## AYUDAS GENÉRICAS

### I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN.

#### **LEY DEL BANCO DE MÉXICO, ARTÍCULO 36.**

"Los intermediarios financieros estarán obligados a suministrar al Banco de México la información que éste les requiera sobre sus operaciones incluso respecto de alguna o algunas de ellas en lo individual, los datos que permitan estimar su situación financiera y, en general, aquella que sea útil al Banco para proveer el adecuado cumplimiento de sus funciones".

#### **Circular 3/2012, Capítulo VII, artículo 108**

Informes a la Dirección de Información del Sistema Financiero.

"Las Instituciones deberán proporcionar a la Dirección General de Asuntos del Sistema Financiero, a la Dirección General de Operaciones de Banca Central, a la Dirección General de Estrategia, Riesgos y Sistemas de Pagos, así como a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México, la información que, en el ámbito de su competencia, dichas unidades administrativas les requieran.

La referida información deberá remitirse en la forma y términos que les den a conocer las mencionadas unidades administrativas".

#### **Circular 115/2002 numeral CB.8**

"Información al Banco de México.

Las casas de bolsa deberán proporcionar al Banco de México la información periódica que el propio Banco les requiera, en la forma y términos que previamente les den a conocer las áreas de dicho Banco facultadas para tales efectos".

### II. OBJETO DEL REQUERIMIENTO.

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para, según sea el caso, determinar diversos indicadores relativos al volumen de las operaciones de reporte de títulos de deuda, medición de la exposición al riesgo en dichos títulos, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.

### III. COBERTURA DEL FORMULARIO

Deberán informarse las operaciones del intermediario realizadas tanto por sus oficinas en la República Mexicana como, en su caso, por las Agencias y Sucursales en el Exterior.

### IV. CONTENIDO DEL FORMULARIO

El formulario está compuesto por tres secciones, en las que deberán reportarse, respectivamente, las siguientes operaciones con títulos de deuda:

#### **1.- Reportos de Títulos de deuda denominados en Moneda Nacional o Udis.**

En esta sección deben reportarse todas las operaciones de reporte (realizadas por cuenta propia) de títulos de deuda, depositados en el INDEVAL, denominados en moneda nacional o Udis.

## 2.- Reportos de Títulos de deuda denominados en Moneda Extranjera.

En esta sección deben reportarse todas las operaciones de reporto (realizadas por cuenta propia) de títulos de deuda denominados en moneda extranjera, depositados en cualquier entidad autorizada para actuar como "Depositaría de Valores" establecida en México o en el Extranjero.

## 3.- Reportos de certificados de depósito emitidos por instituciones Almacenadoras

En esta sección deben informarse las operaciones de reporto de certificados de depósito (de granos u otras materias primas) emitidos por instituciones almacenadoras, vigentes al cierre de cada mes.

## V. CIFRAS A REPORTAR.

La institución deberá enviar un registro por cada reporto (incluyendo aquellas con importe menor a mil pesos), no agrupando operaciones, aun cuando coincidan las características de las mismas. Adicionalmente, las operaciones celebradas internamente entre áreas, por ejemplo, entre la Tesorería y la Mesa de Dinero de la institución, no deben ser informadas, ya que estas operaciones no modifican la posición de riesgo ni la tenencia de títulos de la institución.

Las preguntas que se hacen sobre ciertas características de las operaciones, las diversas instrucciones de llenado del formulario, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo deben considerarse como parte de la normatividad o como una interpretación a ésta 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.

## VI. METODOLOGÍAS DE CONFRONTAS

Las metodologías de las confrontas que se realizan entre la información de este formulario y la de otras fuentes de información, se encuentran en el apartado de ayudas del sistema de acopio denominado SAIF-Web.

A continuación se muestra una imagen para mayor referencia.



## VII.FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN.

Este formulario es de periodicidad diaria. Las operaciones realizadas por la Institución deberán transmitirse al Banco de México, a más tardar a las 9:00 A.M. del día hábil bancario inmediato siguiente al día a que corresponda la información.

## VIII. DETERMINACIÓN DE LA FORMA EN QUE SE ACTUALIZARÁ LA BASE DE DATOS (RESIDENTE EN BANCO DE MÉXICO)

No existirá un esquema de modificaciones para el formulario de REPORTOS, por lo que no podrán llevarse a cabo correcciones por registro, sólo se podrán efectuar en bloque por cada fecha de envío.

**Bloque:** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo (que deben ser todas las operaciones relativas a una misma fecha de concertación, de vencimiento anticipado o de corte), se van a incorporar a la base de datos en "bloque" (Esta opción aplica para todas las secciones del formulario).

## **IX. TRANSMISIONES QUE NO SE APEGUEN AL "TIEMPO Y FORMA", Y RETRANSMISIONES.**

Cuando, por cualquier causa, la información no sea transmitida en "tiempo y forma" o se realicen retransmisiones de información, la Institución deberá manifestar a este Instituto Central las causas que originaron tal situación, y precisar, en el segundo caso, las modificaciones a las cifras, mediante correo electrónico a la dirección [cvtreportos@banxico.org.mx](mailto:cvtreportos@banxico.org.mx).

## **X. ACTUALIZACIÓN DE CATÁLOGOS.**

En caso de que en los Catálogos de Títulos o Contrapartes no exista una clave para identificar algún elemento, las Instituciones podrán solicitar al Banco de México la inclusión de acuerdo a lo siguiente:

- **Títulos.** Deberán ser solicitados mediante un correo electrónico a las direcciones [cvtreportos@banxico.org.mx](mailto:cvtreportos@banxico.org.mx) o [titulos@banxico.org.mx](mailto:titulos@banxico.org.mx) indicando la clave faltante y de ser posible incluyendo el prospecto o carta de características.
- **Contrapartes.** Deberá ser solicitada a través del formulario de Contrapartes (CGC).

## ESTRUCTURAS DE LOS CAMPOS DE CADA SECCIÓN

### ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE TÍTULOS DE DEUDA DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS.

	<b>Campo</b>	<b>Tipo</b>	<b>Descripción</b>
1	Institución	Caracter (6)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).
2	Fecha de Concertación	Fecha	Fecha en que se concertó la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación	Numérico(5,2)	Hora en que se concertó la operación de Reporto.
4	Posición en la Operación	Caracter (1)	Posición de la Institución en la operación (Reportador = A, o Reportado = P).
5	Fecha de Inicio	Fecha	Fecha en que inicia la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento	Fecha	Fecha de vencimiento de la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Reporto	Numérico (12)	Importe de la operación de Reporto (En miles de pesos).
8	Moneda del Precio Unitario	Caracter (3)	Moneda del Precio Unitario de los Títulos (Clave conforme al "Catálogo ISO de Monedas").
9	Tasa Premio	Numérico (8,4)	Tasa de rendimiento pactada como premio de la operación de Reporto (Anualizada y en puntos porcentuales).
10	Tipo de Tasa Premio	Caracter (1)	Tipo de Tasa Premio de la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Tipos de Tasas").
11	Título Objeto del Reporto	Caracter (18)	Clave del título objeto de la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Títulos denominados en MN o UDIS).
12	Precio Unitario de los Títulos	Numérico (19,8)	Precio unitario al que se negociaron los títulos objeto del Reporto (En pesos).
13	Número de Títulos Objeto del Reporto	Numérico (12)	Número de títulos negociados en la operación de Reporto
14	Contraparte del Reporto	Caracter (6)	Contraparte con la que se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC").
15	Corro electrónico	Numérico (2)	Clave de la "Casa de Corretaje" (Corro electrónico) por medio de la cual se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Corros Electrónicos").
16	Tipo de postura	Caracter (2)	Clave de la Postura de la institución en la operación concertada a través de una "Casa de Corretaje" (Clave conforme al "Catálogo de Tipos de Postura").
17	Operación realizada como Banco de Trabajo.	Caracter (1)	Operación realizada como banco de trabajo (T = La institución actuó como "Banco de Trabajo" o P = La institución No actuó como "Banco de Trabajo").
18	Número de identificación de la Operación.	Caracter (37)	Número de Identificación de la operación de Reporto

**ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE TÍTULOS DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.**

	<b>Campo</b>	<b>Tipo</b>	<b>Descripción</b>
1	Institución	Caracter (6)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).
2	Fecha de Concertación	Fecha	Fecha en que se concertó la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación	Numérico(5,2)	Hora en que se concertó la operación de Reporto.
4	Posición en la Operación	Caracter (1)	Posición de la Institución en la operación (Reportador = A, o Reportado = P).
5	Fecha de Inicio	Fecha	Fecha en que inicia la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento	Fecha	Fecha de vencimiento de la operación de Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Reporto	Numérico (12)	Importe de la operación de Reporto (En miles de dólares de los EE.UU.A.).
8	Moneda del Importe del Reporto	Caracter (3)	Moneda del Precio Unitario de los Títulos (Conforme al "Catálogo ISO de Monedas").
9	Tasa Premio	Numérico (8,4)	Tasa de rendimiento pactada como premio de la operación de Reporto (Anualizada y en puntos porcentuales).
10	Tipo de Tasa Premio	Caracter (1)	Tipo de Tasa Premio de la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Tipos de Tasas").
11	Título Objeto del Reporto	Caracter (18)	Clave del título objeto de la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera").
12	Precio Unitario de los Títulos	Numérico (19,8)	Precio unitario al que se negociaron los títulos objeto del Reporto (En unidades de dólar de los EE.UU.A.).
13	Número de Títulos Objeto del Reporto	Numérico (12)	Número de títulos negociados en la operación de Reporto
14	Contraparte del Reporto	Caracter (6)	Clave de la Contraparte con la que se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC").
15	Corro electrónico	Numérico (2)	Clave de la "Casa de Corretaje" (Corro electrónico) por la cual se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al "Catálogo de Corros Electrónicos").
16	Tipo de postura	Caracter (2)	Postura de la institución en la operación concertada a través de una "Casa de Corretaje" (Clave conforme al "Catálogo de Tipos de Postura").
17	Operación realizada como Banco de Trabajo.	Caracter (1)	Operación realizada como banco de trabajo (T = La institución actuó como "Banco de Trabajo" o P = La institución No actuó como "Banco de Trabajo").
18	Número de identificación de la Operación.	Caracter (37)	Número de Identificación de la operación de Reporto

**ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTE DE  
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO EMITIDOS POR ALMACENADORAS**

	<b>Campo</b>	<b>Tipo</b>	<b>Descripción</b>
1	Fecha de corte	Fecha	Fecha del cierre del mes al que corresponden las operaciones de reporte vigentes (Formato AAAA/MM/DD).
2	Institución	Caracter (6)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).
3	Fecha de Concertación	Fecha	Fecha en que se concertó el Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
4	Fecha de Inicio	Fecha	Fecha en que inicia el Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
5	Fecha de vencimiento	Fecha	Fecha en que vence la operación del Reporto (Formato AAAA/MM/DD).
6	Importe del Reporto	Numérico (12)	Importe del Reporto (En miles de pesos).
7	Moneda del Precio Unitario	Caracter (3)	Moneda del Precio Unitario de los Títulos (Clave conforme al "Catálogo de Monedas").
8	Tasa Premio	Numérico (8,4)	Tasa de rendimiento pactada como premio de la operación de Reporto (Anualizada y en puntos porcentuales)
9	Contraparte de la Operación	Caracter (6)	Clave de la Contraparte con la que se concertó el Reporto (conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC").
10	Título Objeto del Reporto	Caracter (18)	Clave del título objeto del Reporto (conforme al "Catálogo de Títulos").
11	Fecha de Vencimiento del Título	Fecha	Fecha en que vence el Título (Formato AAAA/MM/DD).
12	Valor Contable del Título	Numérico (19,8)	Precio del título con el que contablemente se está reconociendo la operación en el balance de la Institución (en miles de pesos)
13	Moneda del Precio Unitario	Caracter (3)	Moneda del Precio Unitario de los Títulos (conforme al "Catálogo ISO de Monedas").
14	Número de identificación de la Operación.	Caracter (37)	Número de Identificación de la operación de Reporto.

**AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LOS CAMPOS DE CADA SECCIÓN**

**AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTE DE TÍTULOS DE DEUDA, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS. EN ESTA SECCIÓN SE DEBEN REPORTAR LAS OPERACIONES DE REPORTE CON TÍTULOS DE DEUDA CUYA MONEDA DE EMISIÓN SEA PESOS O UDIS.**

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

**1. INSTITUCIÓN**

Se deberá anotar el número asignado a la institución que realizó la operación de reporte, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).

**2. FECHA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

Se deberá anotar la fecha de concertación del reporte, independientemente, en su caso, de la fecha "valor" (o fecha de inicio) del mismo.

Las operaciones concertadas con fecha valor deberán informarlas en el reporte relativo al de la fecha de tal concertación.

**3. HORA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la hora en que se concertó la operación de reporte, registrando la hora y los minutos, estos últimos con dos dígitos (en formato de 24 hrs.). Por ejemplo: las 10 de la mañana con 20 minutos = 10.20, las 3 de la tarde con 30 minutos = 15.30, etc... Considerar que la hora de concertación debe estar en el rango de 6:00 a 18:30 hrs.

**4. POSICIÓN DE LA INSTITUCIÓN EN LA OPERACION.**

Se deberá anotar:

**A** Cuando la institución actúe como reportadora.

**P** Cuando la institución actúe como reportada.

**5. FECHA DE INICIO DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se deberá anotar la fecha de inicio del reporte, independientemente de su fecha de concertación (a que se refiere el campo 2).

**6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se anotará la fecha de vencimiento del reporte.

**7. IMPORTE DEL REPORTE (Redondeado a miles sin decimales).**

Se deberá anotar el importe del reporte, sin incluir el premio.

Este importe deberá expresarse en miles de pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la liquidación de la operación.

En su caso, para expresar en pesos el importe de la operación deberá procederse conforme se establece en los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

**8. MONEDA EN LA QUE SE CONCERTÓ LA LIQUIDACIÓN DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave relativa a la moneda de la liquidación de la operación, conforme al "Catálogo de ISO de Monedas".

Por ejemplo, si compran o venden en Reporto Udibonos y la operación se liquida en pesos, en este campo se deberá reportar MXN.

**9. TASA PREMIO DEL REPORTE (En Puntos Porcentuales).**

Se deberá anotar la tasa de rendimiento pactada como premio por realizar la operación de reporte (anualizada, con enteros y cuatro decimales).

**10. TIPO DE TASA DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de rendimiento del reporte, conforme al respectivo "Catálogo de Tipo de Tasa".

**11. CLAVE DEL TÍTULO OBJETO DEL REPORTE.**

Clave de los títulos objeto del reporte, conforme al catálogo de "Títulos de deuda denominados en Moneda Nacional o UDIS".

**12. PRECIO UNITARIO A QUE SE NEGOCIARON LOS TÍTULOS OBJETO DEL REPORTE (en unidades y ocho decimales).**

Se deberá anotar el "Precio Sucio" unitario al que se concertó el reporte de los títulos, expresado en pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación.

**13. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DEL REPORTE.**

Se deberá anotar el número de títulos objeto del reporte, en unidades sin decimales.

#### **14. CONTRAPARTE DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave asignada a la contraparte de que se trate, conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC".

Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito, ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) Financiera Rural, v) Sociedades de inversión, vi) instituciones de seguros vii) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, viii) organismos descentralizados del Gobierno Federal, ix) Sociedades Financieras de Objeto Múltiple, Entidades Reguladas, x) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas y xi) Entidades financieras del exterior, deberán identificarse con la clave particular de tales entidades, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deberán identificarse con la clave genérica que les corresponda (de la "000760" a la "000860"), según el citado "Catálogo de Contrapartes".

#### **15. "CORRO ELECTRÓNICO".**

Se deberá anotar la clave asignada al "Sistema para Facilitar las Operaciones con Valores" por medio del cual se concertó la operación de reporto, conforme al "Catálogo de Corros Electrónicos".

Tratándose de operaciones concertadas con instituciones de crédito y casas de bolsa sin utilizar algún "Corro Electrónico", así como operaciones realizadas con contrapartes distintas a dichos intermediarios financieros, en este campo se deberá anotar la clave "80".

#### **16. TIPO DE POSTURA.**

Se deberá anotar, en su caso, la clave del tipo de postura con la cual la institución concertó la operación de reporto en el "Corro Electrónico", conforme al "Catálogo de Tipos de Postura".

En el caso que la operación se haya concertado sin utilizar un "Corro Electrónico" ("80" en campo 12), en este campo se deberá anotar "NA" (No aplica).

#### **17. OPERACIÓN REALIZADA COMO "BANCO DE TRABAJO".**

Se deberá anotar:

**T** En caso que la institución simultáneamente realice dos operaciones (actúa como "Banco de Trabajo" o como "Cruzadora"), una actuando como reportadora y otra actuando como reportada, con dos correspondientes contrapartes que desean realizar la operación de que se trate, pero, por alguna circunstancia, no pueden operar directamente entre ambas.

**P** Tratándose de operaciones de reporto distintas a las antes señaladas.

#### **18. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar un número para identificar a cada operación, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base de que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más operaciones que tengan la misma fecha de concertación. Este campo no aceptará caracteres distintos a números y letras.



**AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTE DE TÍTULOS DE DEUDA DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA. EN ESTA SECCIÓN SE DEBEN REPORTAR LAS OPERACIONES DE REPORTE CON TÍTULOS DE DEUDA CUYA MONEDA DE EMISIÓN SEA MONEDA EXTRANJERA, DISTINTA A PESOS O UDIS.**

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

**1. INSTITUCIÓN.**

Se deberá anotar el número asignado a la institución que realizó la operación de reporte, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).

**2. FECHA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

Se deberá anotar la fecha de concertación del reporte, independientemente, en su caso, de la fecha "valor" (o fecha de inicio) del mismo.

Las operaciones concertadas con fecha valor deberán informarlas en el reporte relativo al de la fecha de tal concertación.

**3. HORA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la hora en que se concertó la operación de reporte, registrando la hora y los minutos, para estos últimos con dos dígitos (en formato de 24 Hrs.). Por ejemplo: las 10 de la mañana con 20 minutos = 10.20, las 3 de la tarde con 30 minutos = 15.30, etc... Considerar que la hora de concertación debe estar en el rango de 6:00 a 18:30 hrs.

**4. POSICIÓN DE LA INSTITUCIÓN EN LA OPERACION.**

Se deberá anotar:

**A** Cuando la institución actúe como reportadora.

**P** Cuando la institución actúe como reportada.

**5. FECHA DE INICIO DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se deberá anotar la fecha de inicio del reporte, independientemente de su fecha de concertación (a que se refiere el campo 2).

**6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL REPORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se anotará la fecha de vencimiento del reporte.

**7. IMPORTE DEL REPORTE (redondeado a miles sin decimales).**

Se deberá anotar el importe del reporte, sin incluir el premio.

Este importe deberá registrarse en miles de dólares de los EE.UU.A., independientemente de la moneda en la que se haya concertado la liquidación de la operación. En el caso de reportos en las que la operación se haya concertado en divisas distintas al dólar de los EE.UU.A., deberá convertirse el importe respectivo a dólares de los EE.UU.A.; para realizar dicha conversión se considerará la cotización que rija para la moneda correspondiente en relación al mencionado dólar en los mercados internacionales, conforme lo establece Banco de México en la regulación aplicable.

**8. MONEDA EN LA QUE SE CONCERTÓ LA LIQUIDACIÓN DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave de la moneda de liquidación de la operación, conforme al "Catálogo de ISO de Monedas".

Por ejemplo, si se compran o venden en Reporto Eurobonos emitidos en USD y la operación se liquida en libras esterlinas, en este campo se deberá reportar GBP.

**9. TASA PREMIO DEL REPORTE (En Puntos Porcentuales).**

Se deberá anotar la tasa de rendimiento pactada como premio por realizar la operación de reporte (anualizada, con enteros y cuatro decimales).

#### **10. TIPO DE TASA DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de rendimiento del reporte, conforme al respectivo "Catálogo de Tipo de Tasa".

#### **11. CLAVE DE LOS TÍTULOS OBJETO DEL REPORTE.**

Clave del título objeto del reporte conforme al "Catálogo de Títulos de Deuda en Moneda Extranjera".

Cuando no exista en dicho catálogo la clave del título objeto de la operación, la Institución deberá transmitir las características del título utilizando la opción "Actualización de Catálogos" en el sistema de acopio ECIM.

#### **12. PRECIO UNITARIO A QUE SE NEGOCIARON LOS TÍTULOS OBJETO DEL REPORTE (en unidades y ocho decimales).**

Se deberá anotar el "Precio Sucio" unitario al que se concertó la operación de reporte, expresado en dólares de los EE.UU.A., independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación. En el caso de operaciones concertadas en divisas distintas a dólares de los EE.UU.A., deberá convertirse el precio unitario a dólares de los EE.UU.A.; para realizar dicha conversión se considerará la cotización que rija para la moneda correspondiente en relación al mencionado dólar en los mercados internacionales, conforme lo establece Banco de México en la regulación aplicable.

#### **13. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DEL REPORTE**

Se deberá anotar el número de títulos objeto del reporte, en unidades sin decimales.

#### **14. CONTRAPARTE DEL REPORTE.**

Se deberá anotar la clave asignada a la contraparte de que se trate, conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC".

Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito, ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) Financiera Rural v) sociedades de inversión, vi) instituciones de seguros vii) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, viii) organismos descentralizados del Gobierno Federal, ix) Sociedades Financieras de Objeto Múltiple, Entidades Reguladas, x) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas y xi) entidades financieras del exterior, deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deberán identificarse con la clave genérica que les corresponda (de la "000760" a la "000860"), según el citado "Catálogo de Contrapartes".

#### **15. "CORRO ELECTRÓNICO".**

Se deberá anotar la clave asignada al "Sistema para Facilitar las Operaciones con Valores" por medio del cual se concertó la operación de reporte, conforme al "Catálogo de Corros Electrónicos".

Tratándose de operaciones concertadas con instituciones de crédito y casas de bolsa sin utilizar algún "Corro Electrónico", así como operaciones realizadas con contrapartes distintas a dichos intermediarios financieros, en este campo se deberá anotar la clave "80".

#### **16. TIPO DE POSTURA.**

Se deberá anotar, en su caso, la clave del tipo de postura con la cual la institución concertó la operación de reporte en el "Corro Electrónico", conforme al "Catálogo de Tipos de Postura".

En el caso que la operación se haya concertado sin utilizar un "Corro Electrónico" ("80" en el campo 15), en este campo se deberá anotar "NA" (No aplica).

## **17. OPERACIÓN REALIZADA COMO "BANCO DE TRABAJO".**

Se deberá anotar:

**T** En caso que la institución simultáneamente realice dos operaciones (actúa como "Banco de Trabajo" o como "Cruzadora"), una actuando como reportadora y otra actuando como reportada, con dos correspondientes contrapartes que desean realizar la operación de que se trate, pero, por "X" circunstancia, no pueden operar directamente entre ambas.

**P** Tratándose de operaciones de reporto distintas a las antes señaladas.

## **18. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar un número para identificar a cada operación, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más operaciones que tengan la misma fecha de concertación. Este campo no aceptará caracteres distintos a números y letras.

## **AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE CERTIFICADOS DE DEPÓSITO EMITIDOS POR ALMACENADORAS**

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

### **1. FECHA DE CORTE (Con Formato AAAA/MM/DD).**

Se deberá anotar la fecha del cierre del mes al que corresponden las operaciones de reporto vigentes.

### **2. INSTITUCIÓN.**

Se deberá anotar el número asignado a la institución que realizó la operación de reporto, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).

### **3. FECHA DE CONCERTACIÓN (Con Formato AAAA/MM/DD).**

Se deberá anotar la fecha de concertación del reporto, independientemente, en su caso, de la fecha "valor" (o fecha de inicio) del mismo.

Las operaciones concertadas con fecha valor deberán informarlas en el reporte relativo al de la fecha de tal concertación.

### **4. FECHA DE INICIO (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se deberá anotar la fecha de inicio del reporto, independientemente de su fecha de concertación (a que se refiere el campo 4).

### **5. FECHA DE VENCIMIENTO (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se anotará la fecha de vencimiento del reporto.

### **6. IMPORTE DEL REPORTE (redondeado a miles sin decimales).**

Se deberá anotar el importe del reporto, sin incluir el premio.

Este importe deberá expresarse en miles de pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación.

En su caso, para expresar en pesos el importe de la operación deberá procederse conforme se establece en los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

## **7. MONEDA DEL PRECIO UNITARIO**

Se deberá anotar la clave de la moneda en que se concertó el precio unitario a que se negociaron los títulos objeto del reporte, conforme al "Catálogo ISO de Monedas".

## **8. TASA PREMIO (En Puntos Porcentuales).**

Se deberá anotar la tasa de rendimiento pactada como premio por realizar la operación de reporte (anualizada, con enteros y cuatro decimales).

## **9. CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar la clave asignada a la contraparte de que se trate, conforme al "Catálogo de Contrapartes CGC".

Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito, ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) Financiera Rural v) sociedades de inversión, vi) instituciones de seguros vii) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro y viii) organismos descentralizados del Gobierno Federal; deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deberán identificarse con la clave genérica que les corresponda (de la "000760" a la "000860"), según el citado "Catálogo de Contrapartes".

## **10. TÍTULO OBJETO DEL REPORTE.**

Clave del título objeto del reporte conforme al "Catálogo de certificados de Depósito emitidos por Almacenes Generales de Depósito".

Cuando no exista en dicho catálogo la clave del título objeto de la operación, la Institución deberá transmitir las características del nuevo título a las direcciones de correo electrónico [cvtreportos@banxico.org.mx](mailto:cvtreportos@banxico.org.mx) o [titulos@banxico.org.mx](mailto:titulos@banxico.org.mx).

## **11. FECHA DE VENCIMIENTO DEL TÍTULO (Con Formato AAAA/MM/DD).**

En este campo se anotará la fecha en que vence el título objeto del reporte.

## **12. VALOR CONTABLE DEL TÍTULO (en unidades y ocho decimales).**

En este campo se anotará el precio del título con el que contablemente se está reconociendo la operación en el balance de la Institución.

## **13. MONEDA DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar la clave de la moneda en que se concertó la operación de reporte, conforme al "Catálogo de ISO de Monedas".

## **14. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar un número para identificar a cada operación, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más operaciones que tengan la misma fecha de concertación. Este campo no aceptará caracteres distintos a números y letras.