



BANCO DE MÉXICO

**Formulario relativo a las operaciones de futuros y
forwards, para las Instituciones de Crédito, Casas de
Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)**
Ayudas

CONTENIDO

Ayudas Generales	1
I. Fundamento legal del requerimiento de información	1
II. Objetivo del requerimiento	3
III. Definiciones	3
IV. Cobertura del formulario	4
V. Contenido del formulario.....	4
VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos (residente en Banco de México)	5
VI. Metodologías de confrontas.....	6
VII. Fecha y horario de entrega de la información	6
VIII. Actualización de catálogos o anexos.....	6
IX. Estructura del formulario por sección	7
Ayudas específicas para cada campo del formulario	12
Sección I.- Relativa a las operaciones (futuros) celebradas en mercados reconocidos (bursátiles)	12
Sección II.- Relativa a las operaciones (forwards) celebradas en mercados no reconocidos	15
Sección III.- Relativa a la información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos	23
Sección IV. Relativa a la información de la convalidación de las operaciones (futuros) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.....	26
Sección V.- Relativa a la información de la convalidación de las operaciones (“forwards”) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.....	30
Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario.....	34
Sección I, relativa a las operaciones (futuros) celebradas en mercados reconocidos (bursátiles)	34
Sección II, relativa a las operaciones (forwards) celebradas en mercados no reconocidos ..	36
Sección III.- relativa a los vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	44
Sección IV, relativa a la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.....	47
Sección V, relativa a la convalidación de operaciones (“forwards”) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos	50
Preguntas frecuentes.....	53

Con respecto al reporte del Identificador Único de Producto (UPI) en los formularios de Operaciones Derivadas..... 53

Ayudas Generales

I. Fundamento legal del requerimiento de información

Ley de Instituciones de Crédito, Artículo 97

“Las instituciones de crédito deberán presentar la información y documentación que, en el ámbito de sus respectivas competencias, les soliciten la Secretaría de Hacienda y Crédito Público, el Banco de México, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, la Comisión Nacional para la Protección y Defensa de los Usuarios de Servicios Financieros y el Instituto para la Protección al Ahorro Bancario, dentro de los plazos y a través de los medios que las mismas establezcan”.

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”.

Reglamento Interior del Banco de México, Artículo 25 Bis, fracción I

“La Dirección de Información del Sistema Financiero tendrá las atribuciones siguientes:

I. Recabar, procesar y validar información de carácter financiero, de las entidades financieras y empresas de servicios que forman parte del sistema financiero, de otras autoridades financieras, de empresas y dependencias del sector público y, de empresas no financieras mexicanas y entidades financieras del exterior que puedan representar una amenaza a la estabilidad del sistema financiero. Las atribuciones previstas en esta fracción deben realizarse en coordinación con otras Unidades Administrativas del Banco y, en su caso, con otras autoridades financieras;...”

Circular 3/2012 del Banco de México, Artículo 108

Información al Banco de México.

“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”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Circular 4/2012 del Banco de México, numeral 12.1

Información

“12.1 Las Entidades, los Fondos de Inversión, los Almacenes Generales de Depósito, las Sofomes y las Instituciones de Seguros que celebren Operaciones Derivadas, incluidas aquellas que formen parte de Operaciones Estructuradas documentadas en los títulos que emitan o adquieran, deberán proporcionar la información sobre dichas operaciones, en los términos, forma y plazos que el Banco de México establezca, a través de la Dirección de Información del Sistema Financiero. Al proporcionar la información mencionada, las instituciones financieras referidas deberán indicar su Código LEI, así como el de sus contrapartes que aquellas hayan recabado en cumplimiento a lo dispuesto por el numeral 4, segundo párrafo, de las presentes Reglas. Asimismo, dichas instituciones financieras deberán informar de cualquier modificación realizada a su Código LEI, así como el de sus contrapartes que sea de su conocimiento, a más tardar a los 10 Días Hábiles posteriores a aquel en que se haya hecho efectiva la modificación a su respectivo Código LEI o hayan conocido la modificación al Código LEI de la contraparte de que se trate.

Además, las Entidades deberán proporcionar la información a que se refiere el presente numeral sobre las Operaciones Derivadas que realicen las entidades financieras respecto de las cuales sean propietarias directa o indirectamente de títulos representativos de su capital social con derecho a voto que representen por lo menos el cincuenta y uno por ciento del capital pagado o bien, puedan ejercer el control de aquellas en términos de lo previsto en el artículo 2, fracción III, de la Ley del Mercado de Valores.

[...]

12.4 Para efectos de los reportes de información, deberá identificarse a la transacción, al producto y a las partes involucradas en cada operación, utilizando identificadores únicos de acuerdo a los estándares que para tal efecto establezca el Banco de México. En lo que respecta a la identificación de las partes, en los reportes correspondientes se deberá indicar el Código LEI que corresponda.

Por lo que se refiere a la identificación de las transacciones y de los productos sobre Operaciones Derivadas en mercados extrabursátiles, las Entidades, Fondos de Inversión, Sofomes y Almacenes Generales de Depósito, deberán reportar el UPI y UTI correspondiente”.

Ley General de Organizaciones y Actividades Auxiliares del Crédito, artículo 87-B, octavo párrafo

“Las sociedades financieras de objeto múltiple reguladas y no reguladas, deberán proporcionar la información o documentación que les requieran en el ámbito de su competencia la Secretaría de Hacienda y Crédito Público, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, el Banco de México y la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Comisión Nacional para la Protección y Defensa de los Usuarios de Servicios Financieros, dentro de los plazos que tales autoridades señalen”.

II. Objetivo 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 futuros y forwards, medición de la exposición al riesgo de dichas operaciones por parte de la Entidad, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.

III. Definiciones

Para efectos de este formulario se entenderá como:

- Operaciones, a las operaciones a futuro y las operaciones adelantadas (o “Forward”).
- Día hábil, divisas, fecha de liquidación, liquidación, mercados reconocidos, y subyacente, a lo señalado en la Circular 8/2015 del Banco de México.
- Operaciones en “mercados no reconocidos”, a las operaciones celebradas en mercados distintos a los reconocidos, incluyendo los mercados extrabursátiles (OTC: “Over the counter”).
- Paquetes de derivados (negociados tanto en mercados reconocidos como OTC), a la contratación simultánea de operaciones derivadas, que pueden o no ser de la misma naturaleza, al amparo de una sola transacción. Un caso particular de “paquete de derivados” son los “paquetes de operaciones adelantadas” sobre tasas de interés (es decir, donde todos los derivados en un mismo contrato se refieren a “forwards” sobre tasa de interés) negociados en mercados OTC. Otro caso particular de “paquetes de derivados” son las operaciones “engrapadas” contempladas en el Reglamento Interior del MexDer. En otros mercados reconocidos distintos al MexDer, se entenderá por “paquetes de derivados” a la contratación simultánea de futuros conocida como “strips” “packs”, “bundles” o “blocks”; conforme a lo señalado en las reglas internas de cada mercado en lo particular.
- Operaciones Estructuradas en “mercados no reconocidos”, a los instrumentos en los cuales se tiene un contrato principal, el cual contenga una parte referida a activos o pasivos que no son Operaciones Derivadas, incluyendo de forma enunciativa a las operaciones de crédito, emisiones de bonos u otros instrumentos de deuda, y otra parte representada por una o más Operaciones Derivadas. Un caso particular de “Operaciones Estructuradas” es el “swap cambiario”, el cual consiste en dos operaciones, una de compra y otra de venta (cambiaria - forward), pactadas por la Institución de manera simultánea, sobre un determinado monto de divisas, con la misma contraparte y con diferentes fechas de liquidación. Cabe señalar que en este caso, la suma de los montos negociados en las operaciones de compra, deberá ser igual

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

a la suma de los montos negociados en las operaciones de venta, en una misma transacción o “swap cambiario”.

- Operaciones cuyo subyacente sea una divisa, a los futuros o forwards sobre divisas que se liquiden por entrega física.
- Operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio, a los futuros o forwards sobre divisas que se liquiden por diferencias.

IV. Cobertura del formulario

Se deberán elaborar los reportes que correspondan, conforme a lo señalado en la ayuda general siguiente, de las operaciones celebradas por la Institución (Institución de Crédito, Casa de Bolsa, Sociedad Financiera de Objeto Múltiple Reguladas o Institución de Seguros, según se trate), tanto por cuenta propia, como por cuenta de terceras personas (personas clientes); incluyendo las operaciones celebradas dentro de la República Mexicana, como por sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. También se deberán elaborar los reportes respectivos por cada una de las Entidades Financieras Filiales de la Institución en el exterior.

En particular, las operaciones celebradas internamente entre áreas, por ejemplo, entre la Tesorería y la Mesa de Derivados de la Institución, no deben ser informadas, ya que estas operaciones no modifican la posición de riesgo (mercado y crédito) de la institución.

Las operaciones de compra-venta de divisas (distintas a operaciones adelantadas o “forwards”), así como las operaciones de compra-venta de metales preciosos (distintas a operaciones adelantadas o “forwards”), no deben reportarse en este formulario. Asimismo, las operaciones de compra-venta de Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal de los Estados Unidos Mexicanos (distintas a las operaciones adelantadas o “forwards”) no deben reportarse en este formulario.

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 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 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 vigentes.

V. Contenido del formulario

El formulario deberá contener todas las operaciones a futuro y adelantadas (“Forwards”), una a una, desde su fecha de concertación o transferencia, incluyendo las que deriven del ejercicio de opciones sobre futuros o forwards, y aquellas implícitas en notas, títulos u Operaciones Estructuradas. Al

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

efecto la institución no deberá realizar proceso de consolidación alguno. El formulario está compuesto por las cinco secciones siguientes:

Sección I. Comprende las operaciones (**futuros**) celebradas en **mercados reconocidos**.

Sección II. Comprende las operaciones (**forwards**) celebradas en **mercados no reconocidos**.

Sección III. Para informar el **vencimiento anticipado** o **cesión de derechos de operaciones** que fueron previamente enviadas en la sección II.

Sección IV. Para informar la **convalidación** de las **operaciones (futuros) vigentes a la fecha de corte**, celebradas en **mercados reconocidos**.

Sección V. Para informar la **convalidación** de las **operaciones (forwards) vigentes a la fecha de corte**, celebradas en **mercados no reconocidos**.

VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos (residente en Banco de México)

El SAIF-Web incorpora una funcionalidad para que, previamente a la importación del archivo de que se trate, la Institución determine la forma en que, con los registros contenidos en el propio archivo, se actualizará la base de datos (residente en Banco de México). Para ello, la Institución tendrá que señalar la opción que corresponda:

- Bloque:** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo (que deben ser todas las operaciones relativas a una misma fecha de concertación o transferencia, 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).
- Alta:** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para incorporar a la base registros por operaciones omitidas en envíos anteriores (es decir, dar de alta registros). Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II y III del formulario.
- Baja:** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para eliminar de la base registros por operaciones improcedentes de envíos anteriores. Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II y III.
- Cambios:** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para modificar de la base registros enviados con anterioridad (es decir, se modifica al menos un campo de la operación). Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II y III.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

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

Las Secciones I y II de este formulario deberán enviarse con periodicidad diaria. Todas las operaciones celebradas por la Institución, tanto en la República Mexicana, como en sus Agencias y Sucursales en el exterior, tendrán que reportarse el mismo día en que se concertaron, antes de las 17:30 Horas, y las celebradas por las filiales financieras en el exterior tendrán que reportarse el día hábil bancario inmediato siguiente al de su concertación o transferencia, antes de las 13:00 Horas (utilizando la opción de Bloque a que se refiere la Ayuda General VI).

La Sección III 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), antes de las 17:30 Horas (utilizando la opción de “Bloque” a que se refiere la Ayuda General VI).

En caso que la institución se percate que uno o más registros no fueron enviados en su fecha de concertación, transferencia o vencimiento (o de cesión de derechos), o que fueron enviados por error, o que alguna característica requiere ser modificada o cambiada, debe enviar los registros de alta, baja y/o de cambio que correspondan (ya sea en la Sección I, II y/o III), utilizando las opciones “Alta”, “Baja” o “Cambios”, respectivamente, a que se refiere la Ayuda General VI.

Por su parte, las Secciones IV y V deberán enviarse con periodicidad mensual (con información de las fechas de corte disponibles en el SAIF-Web), a más tardar a las 20:00 horas del tercer día hábil bancario posterior al último día hábil del mes que corresponda (para estas secciones aplica exclusivamente la opción de Bloque a que se refiere la Ayuda General VI).

El soporte técnico relacionado con el acceso a las 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.

VIII. Actualización de catálogos o anexos

En caso 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

en el Anexo "O"), las Instituciones podrán 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.

IX. 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 (excepto en el caso de Catálogos o Anexos que son de largo fijo), mientras que el segundo, al número máximo de posiciones decimales.

Estructura de la Sección I: operaciones (futuros) celebradas en mercados reconocidos (BURSÁTILES)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARACTER	1
3	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
4	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
5	MERCADO	MERCADO	ANEXO S	CARACTER	3
6	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
7	POS_OPER	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARACTER	1
8	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
9	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARACTER	2
10	NUMCONTRAT	NÚMERO DE CONTRATOS		NUMÉRICO	(6,0)
11	PRECIOENT	PRECIO UNITARIO O TASA DE ENTREGA		NUMÉRICO	(13,6)
12	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
13	PAQ	LA OPERACIÓN FORMA PARTE DE UN "PAQUETE"	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
14	ID_PAQ	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	20
15	CONSEC_PAQ	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
16	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
17	OPER_DER	OPERADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO P	CARACTER	6
18	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
19	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Estructura de la Sección II: operaciones (forwards) celebradas en mercados no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARACTER	1
3	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FE_INI_OPE	FECHA DE INICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FE_VEN_OPE	FECHA DE VENCIMIENTO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	DIASLIQ	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(2,0)
8	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	NUMÉRICO	(2,0)
9	POS_OPER	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARACTER	1
10	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARACTER	2
11	IMPBASE	IMPORTE BASE DEL CONTRATO		NUMÉRICO	(15,0)
12	MDAIMP	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADO EL IMPORTE BASE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
13	NUMSUBY	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(9,0)
14	PRECIOENT	PRECIO UNITARIO O TASA DE ENTREGA		NUMÉRICO	(13,6)
15	LIQUIDA	FORMA DE LIQUIDACIÓN		CARACTER	1
16	MDALIQUIDA	MONEDA DE LIQUIDACIÓN	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
17	QUANTO	EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		CARACTER	1
18	TC_QUANT	TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		NUMÉRICO	(13,6)
19	TIP_VEN	VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		CARACTER	1
20	TER_OPE	TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
21	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
22	ID_PAQ_EST	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	20
23	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
24	SUBY	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARACTER	3
25	CVE_TIT	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
26	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	20
27	MDASUBY	MONEDA DEL SUBYACENTE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
28	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
29	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
30	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
31	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

32	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
33	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
34	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
35	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52
36	UPI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	12

Estructura de la Sección III: información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	FECVEN_A	FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO		FECHA	AAAA/MM/DD
4	FECLIQ_A	FECHA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		FECHA	AAAA/MM/DD
5	IMP_VEN	IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		NUMÉRICO	(15,0)
6	MDA_VEN	MONEDA DEL IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
7	VEN_PAR	IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO PARCIAL		NUMÉRICO	(15,0)
8	PAG_VENA	LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		CARACTER	1
9	MOT_VENA	MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS	ANEXO R	NUMÉRICO	(1,0)
10	VEN_ANT	INDICADOR DE VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		CARACTER	2
11	LIQUIDA	FORMA DE LIQUIDACIÓN		CARACTER	1
12	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
13	NUM_ID_CP	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA NUEVA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
14	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
15	UTI_O	UTI ORIGINAL		ALFANUMÉRICO	52
16	UTI_N	UTI NUEVO		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Estructura de la Sección IV: información sobre la convalidación de operaciones (futuros) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	PRO_TER	ORIGEN DE LA POSICIÓN		CARACTER	1
3	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	POS_OPER	POSICIÓN POR PIZARRA		CARACTER	1
6	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
7	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR	ANEXO O	CARACTER	6
8	CONTRAT_VIG	NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES (ABIERTOS)		NUMÉRICO	(6,0)
9	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA POSICIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
10	PAQ_FUT	LA POSICIÓN ES PARTE DE UN "PAQUETE", CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.		NUMÉRICO	(1,0)
11	ID_PAQ	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE POSICIONES QUE FORMAN PARTE DE UN "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	20
12	CONSEC_PAQ	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA POSICIÓN QUE FORMA PARTE DE UN " PAQUETE "		NUMÉRICO	(3,0)
13	ACT_OPE	VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA POSICIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
14	PAS_OPE	VALUACION DE LA PARTE PASIVA DE LA POSICIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
15	DUR_ACT	DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA POSICIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
16	DUR_PAS	DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA POSICIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
17	ID_GAR_VG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA POSICIÓN		ALFANUMÉRICO	20
18	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20

Estructura de la Sección V: información sobre la convalidación de operaciones (forwards) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

3	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
4	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
5	POS_OPER	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARACTER	1
6	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
7	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE", CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.		NUMÉRICO	(1,0)
8	ID_PAQ_EST	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE "		ALFANUMÉRICO	20
9	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE "		NUMÉRICO	(3,0)
10	ACT_OPE	VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
11	PAS_OPE	VALUACION DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
12	DUR_ACT	DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
13	DUR_PAS	DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
14	ID_GAR_VG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
15	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
16	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52
17	UPI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER"),		ALFANUMÉRICO	12

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

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 las operaciones (futuros) celebradas en mercados reconocidos (bursátiles)

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

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 LA OPERACIÓN

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

3.- ORIGEN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una operación celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una operación celebrada por la institución (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona cliente).

4.- CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso 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 o el Código LEI, siempre y cuando dicha persona cumpla con lo señalado en el numeral cuatro inciso b) de la Circular 4/2012, lo anterior conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Si la operación es por cuenta propia, deberá registrarse el Código LEI de la institución (campo 19).

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

5.- MERCADO

Se deberá anotar la clave del “mercado” dónde se realizó la operación, conforme al “Catálogo de Mercados Reconocidos” a que se refiere el Anexo S.

6.- FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Si la operación a registrar se refiere a una transferencia, se deberá anotar la fecha a partir de la cual surta efecto la transferencia hacia la institución, como resultado de cualquier acto en el que no haya un vencimiento contractual de la operación original.

7.- POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- C** Cuando se trate de una operación de compra.
- V** Cuando se trate de una operación de venta.

8.- 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. Para operaciones celebradas en el MEXDER. La pizarra deberá estar en el “Boletín Diario” publicado por dicho mercado, adicionalmente si ésta no se encuentra en el Anexo AA, se deberá solicitar con anticipación su inclusión, en caso de que una operación realizada en el MEXDER no cumpla con estas características, favor de comunicarse con la Oficina del Registro de Operaciones Derivadas para su aclaración.

9.- OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la “clave” que corresponda a la operación conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

10.- NÚMERO DE CONTRATOS

Se deberá anotar el número de contratos negociados en la operación, de compra o venta, según sea el caso (en unidades).

11.- PRECIO UNITARIO O TASA DE ENTREGA

Según sea el caso, se deberá anotar (con enteros y hasta seis decimales) el precio unitario del subyacente por contrato, o de la tasa de entrega pactada, en la fecha de concertación.

En el caso de dicho 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 (con enteros y hasta seis decimales).

12.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar un número para identificar a cada registro, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la Institución internamente para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4). En caso que la operación tenga asignado un número único o identificador único se deberá registrar en este campo.

13.- LA OPERACIÓN ES PARTE DE UN “PAQUETE”

En caso que la operación individual haya sido contratada como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en la Ayuda General III, se deberá anotar la clave que corresponda (claves

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

“23” o “24”) conforme al “Catálogo de Operaciones Estructuradas o Paquetes de Derivados” a que se refiere el Anexo J.

Sí la operación no fue contratada de acuerdo a lo anterior, se deberá anotar la clave “90” (No aplica).

14.- CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” (claves “23” o “24” en el campo 13), se deberá anotar la clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte de la misma transacción. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinada transacción deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de operaciones que no fueron contratadas como “paquete” (“90” en el campo 13), en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

15.- NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” (claves “23” o “24” en el campo 13), se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las operaciones individuales que formen parte de una misma transacción. Cada grupo de operaciones relativas a una determinada transacción, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma fecha de concertación (campo 6) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una transacción (campo 14).

Tratándose de operaciones que no fueron contratadas como “paquete” (“90” en el campo 13), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

16.-SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” por medio del cual se liquidará la operación, conforme al “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

17.-OPERADOR DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Operador o Facilitador” por medio del cual se concertó la operación en el mercado a que se refiere el campo 5, conforme al “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P.

18.-CÁMARA DE COMPENSACIÓN

Se deberá anotar la clave asignada a la “Cámara de Compensación” por medio de la cual se liquidará la operación celebrada en el mercado a que se refiere el campo 5, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

19.-CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B” de acuerdo a la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la Circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección II.- Relativa a las operaciones (forwards) celebradas en mercados no reconocidos

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

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 LA OPERACIÓN

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

3.- CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4.- FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN

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

Si la operación a registrar se refiere a una transferencia, se deberá anotar la fecha a partir de la cual surta efecto la transferencia hacia la institución, como resultado de cualquier acto en el que no haya un vencimiento contractual de la operación original.

5.- FECHA DE INICIO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

En el caso de “forwards” tipo “americano” o “window”, se deberá anotar la fecha de inicio a partir de la cual se puede liquidar la operación, conforme a las condiciones contratadas, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones distintas a las anteriores (incluyendo los “forwards” tipo “europeo”), esta fecha deberá ser la misma que la de concertación (campo 4).

6.- FECHA DE VENCIMIENTO

En el caso de “forwards” tipo “americano” o “window”, se deberá anotar la última fecha (vencimiento) en la que puede liquidarse la operación, conforme a las condiciones contratadas, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones distintas a las anteriores (incluyendo los “forwards” tipo “europeo”), esta fecha corresponde a la fecha de vencimiento (o realización) de la operación.

7.-NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN

Se deberá anotar, en su caso, el número de días hábiles, posteriores a la fecha de vencimiento para liquidar los derechos y obligaciones estipulados en la operación de que se trate.

En caso que la liquidación se realice en la misma fecha de vencimiento de la operación, se deberá reportar “0” (cero) en este campo.

8.-TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Se deberá anotar la “clave” del tipo del producto derivado (Taxonomía ISDA) que corresponda a la operación (claves del “1” al “12”), conforme al “Catálogo de Tipo de Producto Derivado” a que se refiere el Anexo C.

9.- POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- C** Cuando se trate de una operación de compra.
- V** Cuando se trate de una operación de venta.

10.- OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la “clave” que corresponda a la operación conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

11.- IMPORTE BASE DEL CONTRATO

Se deberá anotar el “importe base” que corresponda a la operación, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o una tasa de interés, este campo debe ser igual al producto del campo 13 (número de unidades del subyacente) por el campo 14 (Precio unitario o tasa de entrega) dividido entre mil.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

12.- MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL IMPORTE BASE

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el “importe base” que corresponda a la operación (campo 11), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

13.- NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, se deberá anotar el número de unidades del subyacente de que se trate, considerando la unidad de cotización internacional que corresponda. Por ejemplo, onzas para oro y plata, “*bushels*” para maíz, trigo, avena y soya, unidades de índice para índices accionarios, etc.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio o una tasa de interés este campo deberá ser igual a “0” (cero).

14.- PRECIO UNITARIO O TASA DE ENTREGA

Según sea el caso, se deberá anotar el precio unitario por cada unidad de subyacente, o tasa de entrega pactada en la operación.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y hasta seis decimales) de la moneda en que está expresado, conforme al contrato de que se trate. Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y hasta seis decimales.

15.- FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación invariablemente sea liquidada mediante entrega del subyacente.
- D** Cuando la operación invariablemente sea liquidada “por diferencias”.
- M** Cuando la operación pueda liquidarse por entrega del subyacente, o por diferencias, a solicitud de la contraparte.

16.- MONEDA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar la clave de la moneda con que se liquidará el subyacente o, en su caso, “la diferencia”, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E. En particular, tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, la moneda de este campo deberá corresponder al tipo de cambio a que se refiere el campo 14 (Precio unitario). En caso que el subyacente sea una tasa de interés, la moneda de este campo debe ser la misma que la moneda del importe base (campo 12).

17.- EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”). Esto sucede cuando la moneda de liquidación es diferente de la moneda

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio).

- N** Cuando la operación no contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”); y por tanto, la moneda de liquidación es igual a la moneda de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio).

18.- TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Tratándose de operaciones que contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “S” en el campo 17, se deberá anotar dicho tipo de cambio (expresado en unidades de la moneda de liquidación por unidad de la moneda del subyacente, con enteros y hasta seis decimales).

Tratándose de operaciones que no contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “N” en el campo 17, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

19.- VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Se deberá anotar:

- A** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada del mismo, ya sea en forma parcial (en dos o más “parcialidades”) o total, conforme al precio o la tasa de entrega pactada. En particular, esta condición aplica para las operaciones conocidas como “window forward” y/o “forward americano”.
- E** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada del mismo, ya sea en forma parcial o total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado. En particular, esta condición aplica para las operaciones conocidas como “forward europeo”.

20.- TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- M** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de mercado predeterminadas (precio del subyacente, etc.).
- C** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de crédito predeterminadas (calidad crediticia de la contraparte, etc.).
- N** Cuando el contrato respectivo no contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes.

21.- LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”

En caso que la operación individual haya sido contratada como parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, conforme a lo señalado en la Ayuda General III, se deberá anotar la clave que corresponda (claves “7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47” o “48”) conforme al “Catálogo de Operaciones Estructuradas o Paquetes de Derivados” a que se refiere el Anexo J.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Sí la operación no fue contratada de acuerdo a lo anterior, se deberá anotar la clave “90” (No aplica).

22.- CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (claves 7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47” o “48” en el campo 21), se deberá anotar la clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte de la misma transacción. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinada “operación estructurada” o “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma transacción (“90” en el campo 21), en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

23.- NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “PAQUETE” O “ESTRATEGIA”

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (claves 7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47” o “48” en el campo 21), se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las operaciones individuales que formen parte de una misma transacción. Cada grupo de operaciones relativas a una determinada transacción, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1). Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma fecha de concertación (campo 4) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 21).

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma transacción (“90” en el campo 21), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

24.- TIPO DE SUBYACENTE

Se deberá anotar la clave del subyacente objeto de la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (es decir, forwards sobre divisas que se liquiden por diferencias), en este campo se debe registrar la clave “TIC”, mientras que en el campo 25 se debe reportar la clave que corresponda al tipo de cambio de la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo 15 se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre divisas (es decir, forwards sobre divisas que se liquiden por entrega física), en este campo se debe reportar la clave (conforme al Anexo F) de la divisa a recibir, en el caso de compras, o la divisa a entregar, en el caso de ventas. Por su parte, en el campo 16 (relativo a la moneda de liquidación) se deberá registrar la clave de la divisa con la que se liquidará la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo 15 se podrán registrar las claves “S” o “M”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una tasa de interés, en este campo se debe registrar la clave “TIM”, cuando la tasa de interés sea cotizada en México (por ejemplo, la TIIE), o la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

clave “TIX”, cuando la tasa de interés sea cotizada en un país extranjero (por ejemplo, la LIBOR). Asimismo, en el campo 25 se debe reportar la clave que corresponda a la tasa de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo 15 se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre una acción o título representativo de capital, en este campo se debe registrar la clave “ACM”, cuando dicha acción sea de una empresa residente en México, o la clave “ACE”, cuando dicha acción sea de una empresa residente en un país extranjero. Asimismo, en el campo 25 se debe reportar la clave que corresponda a la acción o título representativo de capital de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un índice accionario, en este campo se debe registrar la clave “IAM”, cuando dicho índice sea cotizado en la Bolsa Mexicana de Valores, o la clave “IAX”, cuando dicho índice sea cotizado en alguna bolsa de valores de un país extranjero. Asimismo, en el campo 25 se debe reportar la clave que corresponda al índice de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo 15 se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre un título de deuda, en este campo se debe registrar la clave “TDM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TDE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en un país extranjero. Asimismo, en el campo 25 se debe reportar la clave que corresponda al título de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un título referenciado (incluyendo los certificados bursátiles fiduciarios o “Exchange Traded Funds” o “ETF’s”), en este campo se debe registrar la clave “TRM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TRE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en un país extranjero. Asimismo, en el campo 25 se debe reportar la clave correspondiente al título referenciado de que se trate, conforme al Anexo AF.

25.- CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), c) un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 24), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 24), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 24), o f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 24), se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente de que se trate, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, en el caso de operaciones implícitas en un título o nota estructurada (clave “51” en el campo 21), se debe anotar la clave que corresponda a dicho título o nota, conforme al mencionado Anexo AF.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto a los mencionados títulos, índices accionarios, tasas de interés, o tipos de cambio, o que no estén implícitos en un título o nota estructurada, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

26.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una operación derivada (claves “OPC”, “CDS” o “SWP” en el campo 24), en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en los formularios “OPTO” o “SWAPS”, según corresponda.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una operación derivada, en este campo se debe reportar “NA” (No aplica).

27.- MONEDA DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar la clave de la moneda en que este denominado (en el caso de valores), o se coteie en el mercado de contado que corresponda (por ejemplo, dólares de los EE.UU.A. para oro, plata y petróleo crudo), el subyacente (campo 24), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En particular, tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa o una tasa de interés, la moneda de este campo deberá ser la misma que la moneda del importe base (campo 12). Por su parte, en operaciones cuyo subyacente sea una divisa, la clave de este campo deberá ser la misma que el campo 24.

28.-PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la “Plataforma 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 plataformas, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

29.-SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” por medio del cual se liquidará la operación, en la cámara de compensación a que se refiere el campo 30, conforme al “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

Tratándose de operaciones que no se liquidarán a través de dichas entidades, en este campo se deberá anotar la clave “077000” (equivalente a no aplica).

30.-CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la “Cámara de Compensación” y/o “Repositorio de Derivados” por medio de la cual se liquidará la operación, y/o se registrará, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Tratándose de operaciones que no se liquidarán a través de dichas cámaras o que no se registrarán en algún Repositorio de Derivados, en este campo se deberá anotar la clave "90" (equivalente a no aplica).

31.- AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar la clave de la entidad que, de acuerdo al contrato de la operación, actúa como agente de cálculo y/o liquidación; conforme al "Catálogo de Contrapartes" a que se refiere el Anexo B. En caso que la institución actúe como agente de cálculo, la clave que se reporte deberá ser la misma que el campo 1; mientras que, si la contraparte actúa como agente de cálculo, la clave que se reporte deberá ser la misma que el campo 3. Si de acuerdo al contrato de que se trate, las dos partes de la operación actúan como agente de cálculo y/o liquidación se deberá registrar la clave "000111".

32.- CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave o folio con el cual la institución confirmó con su contraparte (a través de medios electrónicos, de cómputo, de telecomunicación o físicos), todos los términos y condiciones definitivos de la operación. En caso que la operación se haya celebrado a través de alguna plataforma de negociación, se debe anotar la clave de confirmación que corresponda.

33.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar un número para identificar a cada registro, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la Institución internamente para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4).

34.- CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al "Catálogo de Contrapartes" a que se refiere el Anexo "B" de acuerdo a la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la Circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

35.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de diciembre de 2023, este campo podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, si al momento del registro de alguna de sus operaciones a Banco de México no se cuenta con el UTI correspondiente se podrá reportar la clave "ND"; sin embargo, una vez que se tenga conocimiento de dicho identificador, la información deberá ser reprocesada.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

36.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER”)

Se deberá anotar el Identificador Único de Producto conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al tres de noviembre 2025, este campo podrá reportarse vacío.

En caso de que, al momento de registrar alguna operación ante Banco de México, no se cuente con el UPI correspondiente, podrá reportarse la clave "ND". Sin embargo, una vez que se disponga de dicho identificador, la información deberá ser reprocesada.

Asimismo, cuando el producto no cuente con un UPI emitido por un proveedor, deberá reportarse la clave "SU".

Sección III.- Relativa a la información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos

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

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.- FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación (original) o la fecha en que se recibió la transferencia, con formato AAAA/MM/DD.

3.- FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO

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

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

5.- IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar el importe efectivamente pagado o recibido por el vencimiento anticipado (total o parcial), o cesión de derechos, de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato. En el caso de

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

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

6.- MONEDA DEL IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar la clave de la moneda en la que está denominado el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos, 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).

7.- IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO PARCIAL

En su caso, se deberá anotar el importe vencido anticipadamente (en la fecha señalada en el campo 3) en forma parcial (“VP” en el campo 10) de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

En el caso de vencimientos anticipados totales, cesiones de derechos o de operaciones que contemplen la terminación (o extinción), se debe anotar “0” (cero) en este campo.

8.- LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar:

- | | |
|----------|---|
| R | Cuando la Institución haya recibido el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos. |
| P | Cuando la Institución haya pagado el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos. |
| N | Cuando la Institución no haya recibido ni pagado por el vencimiento anticipado (total o parcial), o por la terminación (extinción) anticipada, de la operación. |

9.- 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.

10.- INDICADOR DE VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar:

- | | |
|-----------|--|
| VT | Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma total. |
| VP | Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial. |
| VD | Cuando la operación se haya vencido en la fecha pactada, y la forma de liquidación cambio de “entrega física” a “diferencias”. |
| CD | Cuando los derechos de la operación se hayan cedido. |
| EX | Cuando la operación se haya terminado o extinguido anticipadamente. |

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

En caso que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en este campo), debido a la re-negociación o re-estructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 9); todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación, en la Sección II del formulario OFF; considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado total de que se trate.

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 9.

Asimismo, si la operación fue pactada con la opción de elegir la forma de liquidación, y está fue informada a Banco de México (en la fecha de concertación correspondiente) con clave “M” en el campo 15 de la Sección II del formulario OFF, y llegada la fecha de vencimiento fue liquidada por “diferencias”, se deberá informar tal evento en esta sección para lo cual se deberá anotar “VD” en este campo y la clave “6” en el campo 9. Si la operación llegada a la fecha natural de vencimiento fue liquidada mediante entrega del subyacente, no deberá informarse en esta sección.

11.- FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación se haya liquidado (anticipadamente) mediante entrega del subyacente.
- D** Cuando la operación se haya liquidado (anticipadamente) “por diferencias”.
- N** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente o terminado (extinguido) sin obligación de liquidación.

12.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN (ORIGINAL)

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de la operación original que haya sido vencida (o terminada) anticipadamente o cedida. Este número (o clave) debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la sección II del formulario OFF.

13.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN

En caso que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en el campo 10), debido a la re-negociación o re-estructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 9); todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación en la Sección II del formulario OFF; 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 mencionada sección y formulario.

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”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

14.- CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B” de acuerdo a la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la Circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

15.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN ORIGINAL

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario OFF.

Sin embargo, para la información anterior al primero de diciembre de 2023, este campo podrá reportarse vacío.

16.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN NUEVO

En caso que una determinada operación fuera vencida o reestructurada por cualquiera de los eventos indicados en la regla 12.4 de la circular 4/2012, el nuevo UTI deberá informarse en este campo.

Para los vencimientos anticipados, parciales o totales, distintos a los mencionados anteriormente, este campo debe reportarse “vacío”. En el caso de cesiones de derecho, que den lugar a una nueva operación, este campo y el campo 13 “NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN” no deben ser vacíos.

Adicionalmente, para la información anterior al primero de diciembre de 2023, este campo podrá reportarse vacío.

Asimismo, sí al momento del registro de alguna de sus operaciones a Banco de México no se cuenta con el UTI correspondiente se podrá reportar la clave "ND"; sin embargo, una vez que se tenga conocimiento de dicho identificador, la información deberá ser reprocesada.

Sección IV. Relativa a la información de la convalidación de las operaciones (futuros) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

a) Los campos siguientes estarán previamente pre-llenados, conforme a las operaciones que la institución haya enviado en la Sección I.

1.- CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

2.- ORIGEN DE LA POSICIÓN

Este campo se refiere al origen de la posición vigente a la fecha de corte a confirmar, y mostrará una:

- P** Cuando se trate de una posición propia.
- T** Cuando se trate de una posición por cuenta de una tercera persona (persona cliente).

3.- CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso 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 o el Código LEI, siempre y cuando dicha persona cumpla con lo señalado en el numeral cuatro inciso b) de la Circular 4/2012, lo anterior conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Si la operación es por cuenta propia, deberá registrarse el Código LEI de la institución.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4.- FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la posición vigente a confirmar, sobre una determinada pizarra y con un mismo socio liquidador (es decir, considerando todas las operaciones de cierre de posición negociadas hasta la fecha de corte).

5.- POSICIÓN POR PIZARRA

Este campo tendrá:

- C** Cuando la posición vigente (a la fecha del campo 4) para la pizarra y socio liquidador, corresponda a contratos de compra.
- V** Cuando la posición vigente (a la fecha del campo 4) para la pizarra y socio liquidador, corresponda a contratos de venta.

6.- CLAVE DE PIZARRA

Este campo se refiere a la “clave de pizarra” de la posición vigente a confirmar, para un determinado socio liquidador (campo 7).

7.-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 5).

8.-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) y socio liquidador (campo 7) de que se trate.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

b). Los campos siguientes de cada posición vigente, por pizarra y socio liquidador, deberán llenarse conforme a lo indicado en cada campo:

9.- OBJETIVO DE LA POSICIÓN

Se deberá anotar el objetivo que corresponda a la posición vigente en la fecha de corte, conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

10.- LA POSICIÓN ES PARTE DE UN “PAQUETE”, CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.

En caso que la posición vigente (cuyo subyacente sea una tasa de interés) se pueda considerar como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, se deberá anotar un “1” en este campo

Sí la posición vigente no se considerada como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B., se deberá anotar “0” (cero).

11.- CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE POSICIONES QUE FORMAN PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de una posición vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente sea una tasa de interés, que conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, pueda considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 10), se deberá anotar una clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las posiciones vigentes que formen parte del mismo “paquete”. Por lo anterior, cada grupo de posiciones vigentes relativas a un determinado “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de posiciones vigentes que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 10), en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

12.- NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA POSICIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de una posición vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente sea una tasa de interés, que conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B., o en el Artículo 151 de la C.U.C.B., pueda considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 10), se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las posiciones vigentes que formen parte de un mismo “paquete”. Cada grupo de posiciones vigentes relativas a un determinado “paquete”, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más posiciones vigentes que tengan la misma fecha de corte (campo 4) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de posiciones vigentes que formen parte de un “paquete” (campo 11).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Tratándose de posiciones vigentes que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 10), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

13.-VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA POSICIÓN

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte activa de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 6) y socio liquidador (campo 7) de que se trate. Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

14.-VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA POSICIÓN

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte pasiva de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 6) y socio liquidador (campo 7) de que se trate. Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

15.-DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA POSICIÓN

Tratándose de una posición vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente sea una tasa de interés, que conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B pueda considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 10), se deberá anotar, en el registro con la mayor fecha de vencimiento, la “Duración” correspondiente a la parte activa del paquete (cuando campo 5 sea igual a “C”), expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de posiciones vigentes que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 10), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

16.-DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA POSICIÓN

Tratándose de una posición vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente sea una tasa de interés, que conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B pueda considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 10), se deberá anotar, en el registro con la mayor fecha de vencimiento, la “Duración” correspondiente a la parte pasiva del paquete (cuando campo 5 sea igual a “V”), expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de posiciones vigentes que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 10), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

17.-CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA POSICIÓN

Se deberá anotar la clave o folio de identificación del contrato de garantía relativo a la posición vigente de que se trate. Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la Sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

18.- CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B” de acuerdo a la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección V.- Relativa a la información de la convalidación de las operaciones (“forwards”) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos

a). Los campos siguientes estarán previamente pre-llenados, conforme a lo que la institución haya enviado en la Sección II.

1.- CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al 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.

2.- FECHA DE CONCERTACIÓN O TRANSFERENCIA DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere a la fecha de concertación o de transferencia de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3).

3.- FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la operación vigente a confirmar.

4.- NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3).

5.- POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Este campo tendrá:

- C** Cuando la operación vigente (a la fecha del campo 3) corresponda a una compra.
- V** Cuando la operación vigente (a la fecha del campo 3) corresponda a una venta.

b). Los campos siguientes de cada operación vigente deberán llenarse conforme a lo indicado en cada campo:

6.- OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Se deberá anotar el objetivo que corresponda a la operación vigente en la fecha de corte, conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

7.- LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”, CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.

En caso que la operación individual (cuyo subyacente sea una tasa de interés) se pueda considerar como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, se deberá anotar un “1” en este campo.

Sí la operación no es considerada como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B., se deberá anotar “0” (cero).

8.- CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B. o el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 7), se deberá anotar una clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte del mismo “paquete”. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinado “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B. (“0” en el campo 7), en este campo deberá reportarse la clave “NA” (No aplica).

9.- NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B. o el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 7), se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las operaciones individuales que formen parte de un mismo “paquete”. Cada grupo de operaciones relativas a un determinado “paquete”, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma fecha de corte (campo 3) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un “paquete” (campo 8).

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B. (“0” en el campo 7), en este campo debe reportarse “0” (cero).

10.- VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte activa de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3). Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

11.-VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte pasiva de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3). Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

12.-DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B. o el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 7), se deberá anotar, en el registro con la mayor fecha de vencimiento, la “Duración” correspondiente a la parte activa del paquete (cuando el campo 5 sea una compra), expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B. (clave “0” en el campo 7), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

13.-DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B. o el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 7), se deberá anotar, en el registro con la mayor fecha de vencimiento, la “Duración” correspondiente a la parte pasiva del paquete (cuando el campo 5 sea una venta), expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B. (clave “0” en el campo 7), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

14.-CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN

En caso que el contrato relativo a la operación vigente considere el otorgamiento de garantías entre las partes, se deberá anotar la clave o folio de identificación del contrato de garantía relativo a la operación vigente de que se trate (identificada en el campo 4). Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la Sección II del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

Tratándose de operaciones vigentes cuyo contrato no contemple el otorgamiento de garantías, este campo deberá ser igual a “SG” (Sin Garantía).

15.- CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B” de acuerdo a la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la circular 4/2012.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

16.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER”).

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario OFF.

Sin embargo, para la información anterior al primero de diciembre de 2023, este campo podrá reportarse vacío.

17.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER”)

Se deberá anotar el Identificador Único de Producto conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario OFF.

Sin embargo, para la información anterior al tres de noviembre de 2025, este campo podrá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

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

Nota: Por simplicidad en las validaciones al referirse al campo fecha de concertación deberá entenderse al correspondiente campo de fecha de concertación o transferencia de la operación.

A. Validaciones registro por registro.

Sección I, relativa a las operaciones (futuros) 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 la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener “R”, “A” o “F”, según sea el caso. Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución cuente con “Agencias o Sucursales en el Extranjero”. 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 de que la clave de institución “del campo 1” corresponda a: una institución de banca múltiple, institución de banca de desarrollo o una casa de bolsa.

3. Origen de la Operación

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

4. Clave de la Persona Cliente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México o en su caso el Código LEI de la “Persona Cliente”, deberán estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

Se deberá verificar la obligatoriedad y vigencia del Código LEI registrado en este campo. Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

Adicionalmente, si el campo 3 es igual a “P” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 19. En caso que el campo 3 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 19. Cuando la persona cliente no tenga un Código LEI se deberá reportar la clave Banxico de seis caracteres.

Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

5. Mercado

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave del “mercado” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Mercados Reconocidos” a que se refiere el Anexo S.

6. Fecha de Concertación o transferencia de la operación

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 8.

7. Posición en la Operación

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

8. 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” del Anexo AA) debe ser idéntico al registrado en el campo 5. Adicionalmente, el campo “Tipo de instrumento” (*clase_der*) del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra, debe ser igual a “F” (Futuro).

9. Objetivo de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “objetivo de la operación” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

10. Número de Contratos

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

11. Precio Unitario o Tasa de Entrega

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

12. Número de Identificación de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 6).

13. La operación es parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “23”, “24” o “90”, según sea el caso. Podrá ser igual a “23”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo AA que corresponda a la pizarra registrada en el campo 8 es igual a “Tasas de Interés”. Podrá ser igual a “24”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo AA que corresponda a la pizarra registrada en el campo 8 es igual a “Divisas”. Para pizarras cuya “Clase del Subyacente” (conforme el Anexo AA) sea distinto de “Tasas de Interés” o “Divisas”, este campo debe ser igual a “90”.

14. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de un “paquete”

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 13 sea igual a “90”, este campo deberá ser igual a “NA”. Si la clave del campo 13 es distinta de “90”, este campo debe ser distinto de “NA”.

15. Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, en caso que la clave del campo 13 sea “23” o “24”, este campo debe ser igual o mayor que “1” (uno), considerando que un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma fecha de concertación (campo 6) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un “paquete” (campo 14). En caso que el campo 13 sea igual a “90”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

16.-Socio liquidador de la operación

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 denominada socio liquidador registrada, deberá ser idéntico a la clave registrada en el campo 5.

17.-Operador de la operación

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.

Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad denominada operador registrada, deberá ser idéntico a la clave registrada en el campo 5; excepto cuando la clave de este campo sea igual a “076000” (equivalente a no aplica).

18. Cámara de compensación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cámaras de Compensación” a que se refiere el Anexo L. Adicionalmente, la columna “Mercado” del Anexo L, que corresponda a la cámara de compensación, debe ser idéntico a la clave registrada en el campo 5.

19. Código LEI (Denominado en inglés como “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) de la institución

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

El Código LEI deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada. Este código deberá ser emitido por una Unidad Local que cuente con la acreditación de la Fundación Global conforme lo indicado en la Circular 14/2015.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección II, relativa a las operaciones (forwards) celebradas en mercados no reconocidos

A. Validaciones registro por registro

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

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 la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener “R”, “A” o “F”, según sea el caso. Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución cuente con “Agencias o Sucursales en el Extranjero”. 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 de que la clave de institución “del campo 1” corresponda a: una institución de banca múltiple, institución de banca de desarrollo, una casa de bolsa o una Sofomes-ER.

3. Clave de la Contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. Si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. Adicionalmente, la clave o Código LEI vigente de “Contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”, y debe ser distinta a la clave reportada en el campo 1.

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

025008	ASIGNA COMPENSACION Y LIQUIDACION
213474	ASIGNA COMPENSACION Y LIQ F30430
214831	CHICAGO BOARD OF TRADE
214832	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. Fecha de Concertación o transferencia de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío.

5. Fecha de Inicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe ser igual o mayor al campo 4, cuando el campo 19 sea igual a “A” y “E”.

6. Fecha de Vencimiento

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de concertación (campo 4) en al menos dos días hábiles bancarios (Conforme al calendario de

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

días inhábiles que publique la CNBV, cuando la contraparte del campo 3 sea residente en México, lo cual implica que la columna “clave_tipo_residencia” del “Anexo B” sea igual a “N” para la contraparte respectiva, o conforme al calendario de días inhábiles de los EE.UU.A., en caso que la contraparte sea residente en el extranjero, lo cual implica que la columna “clave_tipo_residencia” del “Anexo B” sea igual a “E” para la contraparte respectiva).

Asimismo, si la fecha registrada en este campo es mayor que la fecha de concertación (campo 4) a lo más en dos días hábiles bancarios (conforme al calendario de días inhábiles que publique la CNBV, cuando la contraparte del campo 3 sea residente en México, lo cual implica que la columna “clave_tipo_residencia” del “Anexo B” sea igual a “N” para la contraparte respectiva, o conforme al calendario de días inhábiles de los E.U.A., en caso que la contraparte sea residente en el extranjero, lo cual implica que la columna “clave_tipo_residencia” del “Anexo B” sea igual a “E” para la contraparte respectiva) se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la fecha de vencimiento conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Adicionalmente, en el caso que la contraparte sea residente en el extranjero, lo cual implica que la columna “clave_tipo_residencia” del “Anexo B” sea igual a “E” para la contraparte respectiva y la fecha registrada en este campo sea mayor en al menos dos días hábiles bancarios, conforme al calendario de días inhábiles de los EE.UU.A. y el valor de este campo corresponde a un día inhábil de los EE.UU.A., distinto a sábado o a domingo, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la fecha de vencimiento conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

7. Número de Días Hábiles para Liquidar la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá estar entre cero (0) y ocho (8).

8. Tipo de Producto Derivado

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves de la “1” hasta la “12” y la “48”. Podrá ser igual a “1”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 es igual a “*Tasas de Interés*”. Podrá ser igual a “2”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Títulos deuda*”. Podrá ser igual a “3”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Acción Individual*”. Podrá ser igual a “4”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Canasta Acciones*”. Podrá ser igual a “5”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Indices Accionarios*”. Podrá ser igual a “6”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Canasta Indices*”. Podrá ser igual a “7”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Divisas*”. Podrá ser igual a “8”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Metales*”. Podrá ser igual a “9”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Combustible*”. Podrá ser igual a “10”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Producto Pecuario*”. Podrá ser igual a “11”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Producto Agrícola*”. Podrá ser igual a “12”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Indices sobre Inflación*”. Podrá ser

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

igual a “48”, si el campo “Clase del Subyacente” del Anexo F que corresponda al subyacente del campo 24 es igual a “*Títulos Referenciados*”.

9. Posición en la Operación

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

10. Objetivo de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “objetivo de la operación” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

11. Importe Base del Contrato

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa, un tipo de cambio, una tasa de interés o un índice sobre inflación (es decir, cuando el campo 8 sea diferente de “1”, “7” o “12”), el valor numérico de este campo deberá ser igual al resultado de multiplicar el valor del campo 13 por el campo 14 y dividir entre mil.

En caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio, una tasa de interés o un índice sobre inflación (es decir, cuando el campo 8 sea igual a “1”, “7” o “12”), este campo debe ser igual o mayor que uno.

12. Moneda en que está expresado el Importe Base

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

13. Número de Unidades del Subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio, una tasa de interés o un índice sobre inflación (es decir, cuando el campo 8 sea diferente de “1”, “7” o “12”) el valor numérico que se registre debe ser mayor o igual que uno.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio, una tasa de interés o un índice sobre inflación (es decir, cuando el campo 8 sea igual a “1”, “7” o “12”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

14. Precio Unitario o Tasa de Entrega

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

15. Forma de Liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S”, “D” o “M”, según sea el caso. Adicionalmente, cuando el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 8) sea igual a: “1”, “5”, “6” o “12”, entonces este campo no debe ser igual a “S” o “M”. En caso que este campo sea igual a “S” o “M” y el campo 8 sea igual a: “8”, “9”, “10” y “11”, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Asimismo, cuando la clave del campo 24 sea igual a: “TIC”, “TIM”, “TIX”, “IAM” o “IAX”, este campo debe ser igual a “D”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

16. Moneda de Liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E (y ser distinta de las claves “0”, “102”, “979” y “990”). Adicionalmente, cuando el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 8) sea igual a “1”, este campo debe ser igual al campo 12. En caso que el campo 8 sea igual a “7” y el campo 24 sea distinto de “TIC”, este campo debe ser distinto del campo 12. En particular cuando el campo 24 sea igual a “979” (UDIS mexicanas) o “102” (Salario Mínimo Vigente en el D.F.), este campo debe ser igual a “484” (Pesos mexicanos). De igual forma, cuando el campo 24 sea igual a “990” (Unidades de Fomento Chilenas), este campo debe ser igual a “152” (Pesos chilenos).

17. Existencia de tipo de cambio Forward “Quanto”

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

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una tasa de interés, una divisa o un tipo de cambio (es decir, cuando el campo 8 sea igual a “1” o “7”), este campo deberá ser igual a “N”.

En caso que el subyacente sea distinto de divisas, tipos de cambio o tasas de interés (es decir, cuando el campo 8 sea igual a “2”, “3”, “4”, “5”, “6”, “8”, “9”, “10”, “11” o “12”) y que la moneda del subyacente (campo 27) sea diferente de la moneda de liquidación (campo 16), este campo debe ser igual a “S”. Si este campo es igual a “N”, cumpliéndose las mismas condiciones anteriores, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la existencia de un tipo de cambio predeterminado o “Quanto”, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En caso que el subyacente sea distinto de divisas, tipos de cambio o tasas de interés (es decir, cuando el campo 8 sea igual a “2”, “3”, “4”, “5”, “6”, “8”, “9”, “10”, “11” o “12”), y que la moneda del subyacente (campo 27) sea igual a la moneda de liquidación (campo 16), este campo debe ser igual a “N”.

18. Tipo de cambio Forward “Quanto”

En caso que el campo 17 sea igual a “S”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá ser mayor que cero. En caso que el campo 17 sea igual a “N”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

19. Vencimiento y Liquidación Anticipada

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

20. Terminación de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “M”, “C” o “N”, según sea el caso.

21. La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá ser exclusivamente una de las siguientes: “7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47”, “48” o “90”. Adicionalmente, en caso que este campo sea igual a “25”, entonces el campo 8 debe ser igual a “1”. Si el campo 8 es igual a “1” este campo puede ser igual a “90”. Si este campo es igual a “26”, entonces el campo 8 debe ser distinto de “1”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

En particular, cuando en este campo se registren las claves “30” o “47”, se deben cumplir las siguientes condiciones:

- i) El campo “8. Tipo de Producto Derivado” debe ser igual a “7”,
- ii) El campo “12. Moneda en que está expresado el monto base” deberá ser distinto de las claves “484” (Peso mexicano), “979” (UDIS Mexicanas) y “990” (UDIS Chilenas).
- iii) El campo “22. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones...” deberá ser distinto de “NA”.
- iv) Cuando la clave de este campo sea igual a “30”, deberán existir al menos dos registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 22), que tengan el mismo Importe Base del Contrato (campo 11) y Moneda del Importe Base (campo 12) pero distinta “Posición en la Operación” (campo 9). Es posible que se reporten 2 o más registros con posición de “Compra”, o “Venta” (“C” o “V” en campo 9), y un solo registro de “Venta”, o “Compra”, pero la suma del importe base de los primeros registros debe ser idéntica al importe base del registro con posición opuesta. En estos casos se debe cumplir que la clave del campo 22 debe ser la misma para todos los registros.
- v) Cuando la clave de este campo sea igual a “47”, la Clave o Folio de “paquete” (campo 22) debe ser distinta de “NA”. Si se reporta un solo registro, entonces el campo 23 debe ser igual a “1”. En caso que se reporten dos o más registros, entonces el campo 9 (Posición en la operación) debe tener la misma clave para cada uno de los registros (ya sea “C” o “V”), asimismo la clave del campo 22 debe ser la misma para todos los registros, mientras que la fecha de vencimiento (campo 6) debe ser distinta entre todos y cada uno de los registros.
- vi) El campo “15. Forma de Liquidación” debe ser igual a “S”.

22. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de una “operación estructurada” o “paquete”

En caso que el campo 21 sea igual a: “7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47” o “48”, este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser distinto de “NA”.

En caso que el campo 21 sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA”.

23. Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de una “operación estructurada” o “paquete”

En caso que el campo 21 sea igual a: “7”, “25”, “26”, “30”, “43”, “45”, “47” o “48”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que uno (1). Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” (campo 22).

En caso que el campo 21 sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

24. Tipo de Subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F. Adicionalmente, la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

“Clase Subyacente” (del Anexo F) que corresponda al valor de este campo, deberá ser idéntica a lo registrado en la columna “Clase de Subyacente” del Anexo C, que corresponda a la clave registrada en el campo 8.

25. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

En caso que la clave del campo 24 corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a “TIC” en el campo 24), una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 24), un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 24), un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 24), o un título referenciado a acciones (claves “TRM” o “TRE” en el campo 24), este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser distinto de “NA” (No aplica). Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF. Asimismo, la “Clase Subyacente” (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntica al valor de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo “24-Tipo de Subyacente”.

Por ejemplo, si el valor de este campo es igual a “USDMXN”, que de acuerdo a la columna “clase_subyacente” del Anexo AF es igual a “Divisas”, este valor debe ser igual al que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo 24 es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 24 es distinta de las siguientes claves: “ACM”, “ACE”, “IAM”, “IAX”, “TIM”, “TIX”, “TDM”, “TDE”, “TRM”, “TRE” o “TIC”, este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

26. Número de Identificación de la operación derivada subyacente

En caso que el campo 24 sea igual a “OPC”, “SWP” o “CDS”, este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser distinto de “NA”.

En caso que el campo 24 sea distinto de “OPC”, “SWP” o “CDS”, este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

27. Moneda del Subyacente

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

En particular, tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24) o una tasa de interés (es decir, igual a alguna de las claves “32” a “986”, “TIM” o “TIX” en el campo 24), entonces la clave de la moneda de este campo debe ser idéntica a la moneda en qué está expresado el importe base (campo 12). Asimismo, en operaciones cuyo subyacente sea una divisa (claves “32” a “986” en el campo 24), la clave de este campo deberá ser la misma que el campo 24.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa (diferente de las claves “32” a “986” en el campo 24), un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24) o una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda al subyacente registrado en el campo 24, conforme a la columna “Moneda Subyacente” del Anexo F (siempre y cuando esta columna tenga un valor no vacío).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Asimismo, cuando la clave del campo 25 sea distinta de “NA” (es decir, cuando el campo 24 sea igual a alguna de las claves siguientes: “ACM”, “ACE”, “TIM”, “TIX”, “TDM”, “TDE”, “TRM”, “TRE” o “TIC”), este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda al subyacente registrado en el campo 25, conforme a la columna “Moneda Subyacente” del Anexo AF.

28. Plataforma 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.

29. Socio liquidador de la operación

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, si el campo 30 es igual a “90”, entonces este campo debe ser igual a “077000”.

30. Cámara de compensación o Repositorio de Derivados

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

31. Agente de Cálculo y Liquidación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes”, a que se refiere el Anexo B. incluyendo, la clave “000111” (cuando la institución y la contraparte funjan como agentes de cálculo).

32. Clave de confirmación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío.

33. Número de identificación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar un número para identificar a cada registro el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4).

34. Código LEI (Denominado en inglés como “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) de la institución

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

El Código LEI deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada. Este código deberá ser emitido por una Unidad Local que cuente con la acreditación de la Fundación Global conforme lo indicado en la Circular 14/2015.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

35.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER”)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del primero de diciembre de 2023.

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al primero de diciembre de 2023.

36.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER”)

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del tres de noviembre de 2025.

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al tres de noviembre de 2025.

Sección III.- relativa a los vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos

A. Validaciones registro por registro.

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. Fecha de Concertación o transferencia de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío.

3. Fecha de Vencimiento Anticipado

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de concertación (campo 2). Asimismo, cuando el campo 10 sea distinto de “VD”, esta fecha debe ser menor que la fecha de vencimiento de la operación original (enviada en la sección II). Cuando el campo 10 sea igual a “VD”, esta fecha debe igual a la fecha de vencimiento de la operación original (enviada en la sección II).

4. Fecha de Liquidación Anticipada

Este campo deberá reportarse vacío en aquellas operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes (clave “N” del campo 8). En caso contrario, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de vencimiento anticipado (campo 3).

5. Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos

Este campo no podrá reportarse vacío. Su valor numérico debe ser mayor que cero (0), si el campo 8 es igual a “P” o “R”. Debe ser igual a cero (“0”) si el campo 8 es igual a “N”.

El valor de este campo debe ser menor o igual al campo “11-Importe Base del Contrato” del registro de la Sección 2, que tenga los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”) que el registro de esta Sección III. En caso de que sea mayor a dicho campo 11, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “El Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos de la operación (Campo

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

5 de la Sección III) es superior al importe base o de referencia (Campo 11) del registro de la Sección 2, que tiene los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”); favor de verificar. En caso de que sea correcto, favor de enviar la documentación relativa al correo electrónico derivados@banxico.org.mx”.

6. Moneda del importe por vencimiento anticipado o cesión de derechos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E; y ser distinta de las claves “0”, “102”, “979” y “990”, cuando el campo 5 sea mayor que cero. Adicionalmente, si el campo 5 es igual a cero, entonces este campo debe ser igual a cero (“0”).

7. Importe por vencimiento anticipado parcial

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 10 es igual a “VP”, el valor numérico de este campo debe ser mayor que el campo 5. Por su parte, si el campo 10 es distinto de “VP”, este campo debe ser igual a cero (“0”).

Se deberá buscar en la base de datos de la Sección III si ya existe algún registro que contenga los mismos tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta misma Sección III y que en el campo 10 contenga la clave “VT”, “EX” o “CD”; en tal caso, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “Este registro ya fue reportado anteriormente en esta sección con la clave “VT”, “EX” o “CD”, por lo que no se puede reportar una vez más”.

Asimismo, cuando el campo “10-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo “11-Importe Base del contrato” del registro de la Sección II, que tenga los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”) que el registro de esta Sección III. Adicionalmente, cuando el campo “10-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” y en caso que en la base de datos de la Sección III existan dos o más registros que tengan los mismos tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta Sección III y que en el campo 10 también tengan la clave “VP”, entonces se debe sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo “7- Importe por vencimiento anticipado parcial” de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo “11-Importe Base del contrato” de la Sección II conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). Además, si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente por un monto igual a la resta entre el campo “11-Importe Base del contrato” y su correspondiente sumatoria de vencimientos parciales (“VP”) entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 10).

8. La institución pagó o recibió el importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos

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

9. Motivo del vencimiento anticipado o cesión de derechos

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Motivo de la Vencimiento Anticipado o de la Cesión de Derechos de la Operación”, a que se refiere el Anexo R. Adicionalmente, si el campo 8 es igual a “P” o “R”, este campo deberá ser distinto de “8” y “9”. Asimismo, si el campo 8 es igual a “N”, este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes: “3”, “4”, “7”, “8” o “9”.

10. Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “VT”, “VP”, “VD” “CD” o “EX”. Si el campo 9 es igual a “5”, este campo debe ser igual a “CD”. Si el campo 9 es igual a “8” o “9”, este campo debe ser igual a “EX”. Asimismo, si el campo 9 es igual a “6”, este campo debe ser igual a “VD”. Mientras que si el campo 9 es igual a “1”, “2”, “3” o “4”, este campo debe ser igual a “VT” o “VP”. Finalmente, cuando el campo 9 sea igual a “7”, este campo debe ser igual a “VT”.

11. Forma de Liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S”, “D” o “N”, según sea el caso. Adicionalmente, si el campo 10 es igual a “VD” o “CD”, este campo debe ser igual a “D”; y si el campo 10 es igual a “EX”, este campo debe ser igual a “N”.

12. Número de Identificación de la Operación (original)

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar el mismo número o clave que el registrado para la operación original (enviada en la sección II), sobre la base que un mismo número de identificación no se puede asignar a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2) y fecha de vencimiento anticipado (campo 3), si el campo 10 es distinto de “VP”. En caso que el campo 10 sea igual a “VP”, entonces en la base de datos de esta sección podrán existir dos o más registros que tengan la misma clave de institución, fecha de concertación (campo 2), fecha de vencimiento anticipado (campo 3) y número de identificación de la operación (campo 12).

13. Número de Identificación de la Nueva Operación

Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 10 sea igual a “VP”, “VD” o “EX”. También debe ser vacío cuando el campo 10 sea igual a “VT” y el campo 9 sea distinto de “7”. Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 10 sea igual a “VT” y el campo 9 sea igual a “7”.

14. Código LEI (Denominado en inglés como “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) de la institución

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

El Código LEI deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada. Este código deberá ser emitido por una Unidad Local que cuente con la acreditación de la Fundación Global conforme lo indicado en la Circular 14/2015.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

15.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN ORIGINAL

Este campo no podrá reportarse vacío, para la información a partir del primero de diciembre de 2023. Se deberá anotar el mismo identificador que el registrado para la operación original (enviada en la Sección II), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 12).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al primero de diciembre de 2023.

16.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN NUEVO

Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 10 sea igual a “VD”, “EX” o “VP”. Asimismo, debe ser vacío cuando el campo 10 sea igual a “VT” y el campo 9 sea distinto “7”. Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 10 sea igual a “VT” y el campo 9 sea igual a “7”. En caso de que el campo 10 sea igual a “CD”, este campo puede ser vacío.

Por otro lado, el identificador que se registre en este campo deberá encontrarse en la Sección II, de acuerdo a los campos: institución, fecha de vencimiento anticipado (campo 3) y número de identificación de la nueva operación (campo 13).

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al primero de diciembre de 2023.

Si el valor del campo 13 “NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN” es distinto de vacío, este campo no debe ser vacío. De igual forma, Si el valor de este campo es distinto de vacío, el valor del campo 13 “NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN” no debe ser vacío.

Sección IV, relativa a la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

A. Validaciones registro por registro.

Nota: Los registros que la institución reporte en esta sección IV deben corresponder (conforme a los campos “llave” indicados más adelante) uno a uno con los registros de la posición abierta enviados a convalidar a través del SAIF-Web (lo cual implica que el número de registros que cada institución envíe en esta sección debe ser exactamente igual al número de registros enviados a convalidar). Por tanto, si para una institución y fecha de corte determinada en el SAIF-Web se envía al menos una operación a convalidar, dicha institución no puede enviar un archivo “vacío” para esa fecha de corte. Asimismo, en esta sección se pueden reportar archivos “vacíos” únicamente cuando no existan operaciones a convalidar.

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. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 (“Clave de la Institución”) de los registros enviados a convalidar a través del SAIF-Web que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Fecha de Corte” (campo 4), “Clave de Institución” (campo 1), “Clave de Cliente” (campo 3), “Posición por Pizarra” (campo 5), “Clave de Pizarra” (campo 6) y “Socio Liquidador” (campo 7).

2. Origen de la Posición

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

3. Clave de la Persona Clienta

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México o en su caso el Código LEI de la “Persona Clienta”, deberán estar vigentes. Además la clave o código que se anote

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Se deberá verificar la obligatoriedad y vigencia del Código LEI registrado en este campo. Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Adicionalmente, si el campo 2 es igual a “P” la clave de este campo deberá registrarse el Código LEI de la institución. En caso que el campo 3 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 18, Cuando la persona o entidad no tenga un Código LEI se deberá reportar la clave Banxico de seis caracteres.

Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

4. Fecha de Corte

Este campo no podrá reportarse vacío.

5. Posición por pizarra

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

6. Clave de pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra para Derivados Negociados en Mercados Reconocidos” a que se refiere el Anexo AA.

7. Socio liquidador

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, para un mismo cliente (campo 3), misma fecha de corte (campo 4) no podrá haber dos o más registros que tengan la misma clave de pizarra (campo 6) y socio liquidador.

8. Número de Contratos Vigentes (Abiertos) en posición

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

9. Objetivo de la Posición

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

10. La Posición es parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser igual a “0” (cero) o “1” (uno). Este campo puede ser igual a “1”, si la columna “Clase de subyacente” (del Anexo F) que corresponda a la clave de pizarra del campo 6 es igual a “Tasas de Interés”. En caso que para la pizarra del campo 6, la columna “Clase de subyacente” sea distinta de “Tasas de Interés”, este campo debe ser igual a “0”.

11. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de posiciones que forman parte de un “paquete”

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 10 sea igual a “1”, este campo debe ser distinto de “NA”.

En caso que el campo 10 sea igual a “0”, este campo debe ser igual a “NA”.

12. Número consecutivo para identificar a la posición que forma parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 10 sea igual a “1”, el valor numérico de este campo deberá ser igual o mayor que uno (1). Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma fecha de corte (campo 4) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” (campo 11).

En caso que el campo 10 sea igual a “0”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

13. Valuación de la parte activa de la posición

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

14. Valuación de la parte pasiva de la posición

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

15. Duración de la parte activa de la posición

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 10 sea igual a “1” y el campo 5 sea igual a “C”, este campo podrá ser igual o mayor que uno (1). En caso que el campo 10 sea igual a “0”, o sea igual a “1” cuando el campo 5 sea igual a “V”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

16. Duración de la parte pasiva de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 10 sea igual a “1” y el campo 5 sea igual a “V”, este campo podrá ser igual o mayor que uno (1). En caso que el campo 10 sea igual a “0”, o sea igual a “1” cuando el campo 5 sea igual a “C”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

17. Clave o folio para identificar el contrato que garantiza la posición

Este campo no podrá reportarse vacío y no debe ser igual a “SG” (Sin Garantía).

18.- Código LEI (denominado en inglés como “Legal Entity Identifier”) de la institución

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

El Código LEI deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada. Este código deberá ser emitido por una Unidad Local que cuente con la acreditación de la Fundación Global conforme lo indicado en la Circular 14/2015.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Sección V, relativa a la convalidación de operaciones (“forwards”) vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos

A. Validaciones registro por registro.

Nota: Los registros que la institución reporte en esta sección V deben corresponder (conforme a los campos “llave” indicados más adelante) uno a uno con los registros de operaciones vigentes enviados a convalidar a través del SAIF-Web (lo cual implica que el número de registros que una institución envíe en esta sección debe ser exactamente igual al número de registros enviados a convalidar). Por tanto, si para una institución y fecha de corte determinada en el SAIF-Web se envía al menos una operación a convalidar, dicha institución no puede enviar un archivo “vacío” para esa fecha de corte. Asimismo, en esta sección se pueden reportar archivos “vacíos” únicamente cuando no existan operaciones a convalidar.

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.

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 (“Clave de la Institución”) de los registros enviados a convalidar a través del SAIF-Web que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de Concertación” (campo 4), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 33).

2. Fecha de concertación o transferencia de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser menor o igual a la fecha de corte (campo 3). Asimismo, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección V, con los registros de la sección II enviados a convalidar en el SAIF-Web.

3. Fecha de corte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de concertación de la operación (campo 2), y debe ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a convalidar.

4. Número de Identificación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar el mismo número o clave que el registrado para la operación original (enviada en la sección II), sobre la base que un mismo número de identificación no se puede asignar a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2).

5. Posición en la operación

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

6. Objetivo de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

7. La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”, conforme a la C.U.B. o la C.U.C.B.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser igual a: “0” (cero) o “1” (uno). Este campo puede ser igual a “1”, si la columna “Clase de subyacente” (del Anexo F) que corresponda a la clave del subyacente de la operación a la que se refiere el campo 4, es igual a “Tasas de Interés”. En caso que para la operación vigente de que se trate la columna “Clase de subyacente” sea distinta de “Tasas de Interés”, este campo debe ser igual a “0”.

8. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de una “operación estructurada” o “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 7 sea igual a “1”, este campo debe ser distinto de “NA”.

En caso que el campo 7 sea igual a “0”, este campo debe ser igual a “NA”.

9. Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de una “operación estructurada” o “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 7 sea igual a “1”, el valor numérico de este campo deberá ser igual o mayor que uno (1). Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma fecha de corte (campo 3), y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” (campo 8).

En caso que el campo 7 sea igual a “0”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

10. 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.

11. 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.

12. Duración de la parte activa de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 7 sea igual a “1” y el campo 5 sea igual a “C”, este campo debe ser igual o mayor que uno (1). En caso que el campo 7 se igual a “0” (o igual a “1”, cuando el campo 5 sea igual a “V”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

13. Duración de la parte pasiva de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 7 sea igual a “1” y el campo 5 sea igual a “V”, este campo debe ser igual o mayor que uno (1). En caso que el campo 7 se igual a “0” (o igual a “1”, cuando el campo 5 sea igual a “C”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

14. Clave o folio para identificar el contrato que garantiza la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Puede ser igual a “SG” (Sin Garantía).

15.- Código LEI (denominado en inglés como “Legal Entity Identifier”) de la institución**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Se deberá anotar el Código LEI de la institución conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

El Código LEI deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada. Este código deberá ser emitido por una Unidad Local que cuente con la acreditación de la Fundación Global conforme lo indicado en la Circular 14/2015.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

16.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER”)

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del primero de diciembre de 2023. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario OFF, de acuerdo a los campos llave: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 4).

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al primero de diciembre de 2023.

17.- IDENTIFICADOR ÚNICO DE PRODUCTO (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE PRODUCT IDENTIFIER”)

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del tres de noviembre de 2025. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario OFF, de acuerdo a los campos llave: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 4).

Este campo podrá reportarse vacío, para la información anterior al tres de noviembre de 2025.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Preguntas frecuentes

Con respecto al reporte del Identificador Único de Producto (UPI) en los formularios de Operaciones Derivadas

1. ¿Debe reportarse el UPI cuando se trata de operaciones estructuradas o paquetes de derivados?

Si internamente su área de riesgos, de negocio, de estructuración o de reporte identifiquen a un conjunto de Operaciones Derivadas como una estructura definida deberán solicitar al proveedor de Identificadores de Producto Único, el Identificador correspondiente y emplearlo en el envío de su información. Consecuentemente, si la institución, por decisión de su comité de riesgos, no realizan estructuras, deberá reportarse el UPI individual para cada una de las operaciones.

En el caso de operaciones entre instituciones que están obligadas a registrar sus operaciones en Banco de México, pero una institución reporta con un UPI relativo a una estrategia y la otra reporta un UPI para cada elemento que conforme la estructura, se cuestionará a quién reporte por partes por no haber solicitado el UPI correspondiente.

Adicionalmente, si en los formularios de Operaciones Derivadas reportan que un conjunto de operaciones se refiere a una “Operación Estructurada” o “Paquete”, en el campo correspondiente, pero no se registró el UPI relativo a una estrategia, será motivo de observación.

Por otro lado, si realizan la cobertura de la estrategia y ésta se realiza a través de la adquisición de operaciones individuales, estas operaciones deberán informarse con el UPI propio de cada componente.

2. ¿Qué UPI deberá reportarse en Operaciones Derivadas que se encuentran incrustadas o implícitas en notas estructuras, bonos o en créditos?

En los casos en que las operaciones se encuentren en notas estructuras, bonos o en créditos deberá utilizarse la clave SU, relativa a “Sin UPI”.

3. ¿Los productos derivados que son operados globalmente usarán el mismo UPI en México que el ya establecido a nivel global?

Sí, será el mismo que se utilizará en el mercado mexicano para lograr un UPI homologado globalmente; por lo que ese mismo identificador deberá usarse en el envío de la información en los formularios de Operaciones Derivadas.

4. ¿Se podrá utilizar el identificador de producto proporcionado por la Cámara, plataformas o brokers para el registro de las Operaciones en Banco de México?

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)

Sí, siempre y cuando el UPI haya sido emitido por el proveedor reconocido por Banco de México y la Cámara, plataformas o *brokers* no estén impedidas, legalmente, para distribuirlo.

5. ¿Cuándo debe enviarse el UPI en las Operaciones Derivadas?

Conforme a las ayudas, deberá reportarse en cada Operación Derivada antes de las 17:30 del mismo día en que se concertó el producto. Cabe mencionar que, en el caso de discrepancias, éstas deberán solucionarse un plazo máximo de 48 horas.

6. ¿A partir de qué fecha deben reportarse las operaciones incluyendo el UPI a Banco de México?

La obligatoriedad del envío de información incluyendo el Identificador de Producto Único (UPI) comienza a partir del 3 de noviembre de 2025 y sólo aplicará a aquellas operaciones concertadas a partir de esa fecha. Por lo tanto, en las convalidaciones sólo será exigible el UPI en aquellas operaciones con fecha de concertación a partir de esa fecha.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de futuros y forwards, para las Instituciones de crédito, Casas de Bolsa, Sofomes ER e Instituciones de Seguros (OFF)



BANCO DE MÉXICO

Junio 2018

www.banxico.org.mx