BANCO DE MÉXICO

Formulario relativo a los requerimientos de capitalización (RC), para las instituciones de crédito y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Versión 1.25

Fecha del documento 20 de julio 2026

Contenido

Ayudas Generales 7

I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN 7

II. DEFINICIONES 7

III. OBJETIVO DEL REQUERIMIENTO 8

IV. SECCIONES DEL FORMULARIO 8

V. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR 9

VI. COBERTURA DEL FORMULARIO 10

VII. CIFRAS A REPORTAR 11

VIII. METODOLOGÍAS DE CONFRONTAS 11

IX. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN 11

X. TRANSMISIONES QUE NO SE APEGUEN AL "TIEMPO Y FORMA", Y RETRANSMISIONES 11

ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES DEL FORMULARIO 12

A. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC11 y RC13. 12

B. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC04 15

C. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC06 Y APARTADOS 17

D. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC08, RC10, RC17, y RC12 IN 22

E. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC09 25

F. ESTRUCTURA DE LAS SECCION RC12 26

G. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC14 29

I. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC18 37

J. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC19 38

K. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC08_A. 38

L. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC10A. 40

N. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC21 INSTRUMENTOS DE CAPITAL VIGENTES Y TÍTULOS REPRESENTATIVOS DE CAPITAL A COMPUTAR EN EL SUPLEMENTO DE CAPITAL NETO. 41

Ayudas Específicas 43

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 01 43

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 02 77

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 03 83

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 04 108

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 05 141

Requerimientos de Capitalización (RC) Secciones 6A, 6B Y 6C 150

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 07 167

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 08 174

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 08_A 188

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 09 198

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 10 245

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 10 A 252

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 11 258

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 12 y RC12_IN 276

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 13 307

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 14 314

Requerimientos de Capitalización (RC) Secciones 15A y 15B 325

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 17 345

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 18 350

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 19 354

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 21 364

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

I. OBJETIVO. 364
II. COBERTURA. 364
III. CAMPOS DE LA SECCIÓN. 364
IV. REGISTROS A INFORMAR. 364
V. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO LA SECCIÓN. 365
VALIDACIONES DE PROCESO 370
i. Descarga de diagnósticos 370
Etapa: Validaciones de formato y consistencia básica (técnicas) 374
i. Objetivo de la validación 374
ii. Validaciones de estructura 374
iii. Validaciones por tipo de dato 374
iv. Validaciones por catálogos 375
v. Validaciones no ceros, negativos, nulos, único registro 376
vi. Validaciones por sección. 376
Etapa: Validaciones históricas 440
i. Objetivo de la validación 440
ii. Validaciones por sección 440
Etapa: Validaciones de gradualidad RC14 452
i. Objetivo de la validación 452
ii. Validaciones por sección 452
Etapa: Validaciones al interior del Registro 452
i. Objetivo de la validación 452
ii. Validaciones por sección 453
iii. Expresiones condicionales 480
Etapa: Validaciones al Interior de la sección. 507
i. Objetivo de la validación 507
ii. Validaciones por sección en riesgo de mercado 507
a) (AB) Activo Bruto, (AC) Activo Compensable 507
b) (PB) Pasivo Bruto, (PC) Pasivo Compensable 588

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

c) (AC) Activo Compensable, (PC) Pasivo Compensable 668
iii. Validaciones por sección en riesgo de crédito 725
iv. Validaciones por sección en riesgo operacional 835
Etapa: Validaciones entre Secciones 851
i. Objetivo de la validación 851
ii. Validaciones entre secciones. 851
Tipo1. Capital (RC09) vs Crédito (RC08) 851
1.1 Operaciones Relacionadas Relevantes 851
1.2 Cargos Diferidos menores a un año 852
Tipo2. Mercado vs Crédito Entidad emisora y Personas Relacionadas 852
2.1 Activos Brutos por operaciones con títulos de deuda 852
2.2 Pasivos Brutos por operaciones con títulos de deuda 867
Tipo3. Mercado (Activo) vs Mercado (Pasivo) 880
3.1 Swaps 880
3.2 Futuros 884
3.3 Forwards 896
3.4 Reportos 908
3.5 Opciones 911
3.6 Operaciones de Compra y Venta 928
Tipo4. Mercado vs Crédito (Contraparte) 932
4.1 Reportos 932
4.2 Swaps 935
4.3 Futuros y Forwards Compra y Venta 943
4.4 Préstamos 975
Tipo5. Mercado vs Mercado 977
5.1 Opciones y Títulos Opcionales 977

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Tipo6. Mercado vs Crédito. Cartera de Créditos 1008

Tipo7. Crédito vs Capital. Metodologías Internas 1017

7.1 Reservas Admisibles bajo Metodología Interna 1017

7.2 Pérdidas Esperadas bajo Metodología Interna 1017

Tipo 8. Crédito vs Crédito. Garantías y Avales 1018

Etapa: Validaciones Posteriores al Cálculo 1038

i. Objetivo de la validación 1038

ii. Validaciones por sección. 1038

MATRIZ DE LAS PARTES QUE CONFORMAN CADA OPERACIÓN PARA EFECTO DEL CÓMPUTO DE CAPITALIZACIÓN 1046

USO LIMITADO

Contenido

Ayudas Generales

I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN

Ley del Banco de México, artículo 36

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

Circular 3/2012 Capítulo VII, Art. 108

Informes a la Dirección de Información del Sistema Financiero.

"Las instituciones deberán proporcionar a la Dirección General de Asuntos del Sistema Financiero, a la Dirección General de Operaciones de Banca Central, Dirección General de Estrategia, Riesgos y Sistemas de Pago, 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".

Disposiciones de carácter general aplicables a Instituciones de Crédito, párrafo tercero y cuarto del artículo 2 Bis 4

"Las Instituciones efectuarán dicho cómputo una vez al mes y la información relativa a éste deberán proporcionarla al Banco de México. Sin perjuicio de lo anterior, el Banco de México verificará dicho cómputo, asimismo podrá resolver que alguna Institución efectúe el cómputo para determinar el cumplimiento de los requerimientos, así como el Índice de Capitalización, con mayor periodicidad y en cualquier fecha, cuando a su juicio o al de la Comisión se estime que entre los días que van de un cómputo a otro, tal Institución está asumiendo riesgos notoriamente mayores a los que muestren las cifras de cierre de mes.

Para los efectos del párrafo anterior, las Instituciones deberán proporcionar al Banco de México la información que sobre el particular les requiera, en la forma, que incluye formularios y ayudas operativas, y plazos establecidos por el propio Banco Central, con la previa opinión favorable de la Comisión…".

II. DEFINICIONES

Para efectos de estos formularios se entenderá como:

- **Comisión**, a la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.
- **Instituciones**, a las instituciones de banca múltiple, sociedades financieras de objeto múltiple (Sofomes) y a las instituciones de banca de desarrollo.
- **CUB**, a la Circular Única de Bancos con las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, publicadas el 9 de abril de 2010 en el Diario Oficial de la Federación.

III. OBJETIVO DEL REQUERIMIENTO

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para efectuar el Cómputo de Capitalización y el Índice de Capitalización, así como para verificar la información con otras fuentes.

IV. SECCIONES DEL FORMULARIO

- RC01 Relativo a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Nominal en Moneda Nacional
- RC02 Relativo a Operaciones con Riesgo de Mercado por Sobretasa, con Títulos de Deuda en Moneda Nacional y cuya Tasa de Rendimiento esté Integrada por una Sobretasa y una Tasa Revisable
- RC03 Relativo a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Real en Udis UMAs y en Moneda Nacional
- RC04 Relativo a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Nominal en Moneda Extranjera
- RC05 Relativo al Riesgo de Mercado por Operaciones con Acciones y Sobre Acciones o con Rendimiento Referido a éstas
- RC06_A Relativo al Riesgo de Crédito en Operaciones de Reporto, de Derivados e Incumplimientos
- RC06_B Relativo al Riesgo de Crédito por ajuste de valuación crediticia de la contraparte en Operaciones de Derivados
- RC06_C Relativo a la exposición al fondo de incumplimiento en cámaras de compensación de los participantes en el mercado de derivados
- RC07 Relativo al Riesgo de Crédito (Entidad emisora) por Posiciones en Títulos de Deuda
- RC08 Relativo al Riesgo de Crédito por Depósitos, Préstamos, Créditos, Otros Activos y Operaciones Contingentes
- RC08 A Relativo a Riesgo de Crédito por Cartera de Consumo, Vivienda y Pequeñas y Medianas Empresas (Reestructurados, Renovados o Nuevos al amparo del oficio

P418/2020 y su alcance P430/2020) y de la Resolución que modifica el artículo 2 bis 17 de la CUB publicada en el DOF el 20 de julio de 2021

- RC09 Relativo a La Integración del Capital Neto
- RC10 Relativo al Riesgo de Crédito por Coberturas Otorgadas a través de Garantías Personales, Derivados de Crédito y Bursatilizaciones
- RC10A Relativo al riesgo de crédito por Esquemas de Bursatilización
- RC11 Relativo a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Rendimiento Referida al Crecimiento del Salario Mínimo General o con Rendimiento Referido al Crecimiento del Salario Mínimo General
- RC12 Relativo al Riesgo Operacional
- RC12 IN Relativo al Riesgo Operacional bajo el indicador de negocio
- RC13 Relativo al Riesgo de Crédito de las Garantías Reales y Personales Recibidas, así como al Riesgo de Crédito por Incumplimiento de los Vendedores de Protección
- RC14 Relativo al Riesgo de Crédito por préstamos bajo el enfoque de métodos basados en calificaciones internas
- RC15A, RC15B Relativo al Riesgo de Crédito del acreditado/acreditada, entidad emisora, contraparte y ajuste de valuación crediticia en derivados por operaciones realizadas con personas relacionadas
- RC17 Relativo al Riesgo de Mercado por Operaciones con Mercancías
- RC18 Relativo al Riesgo de Mercado por Operaciones de Opciones y Títulos Opcionales sujetas a Requerimiento por impacto Gamma y Vega
- RC19 Relativa a los Requerimientos de Crédito con el Sector Privado por Jurisdicción
- RC21 Relativa a los Instrumentos de Capital elegibles para computar el Capital Neto

V. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR

Cuando en este formulario y en las Disposiciones se hace referencia a "entidades financieras del exterior" o a "entidades financieras filiales del exterior", deberá entenderse que se trata de un intermediario no mexicano y por lo tanto NO deberá entenderse como una referencia hecha a los intermediarios financieros mexicanos cuya matriz está ubicada en el exterior.

Las entidades financieras filiales del exterior, de la Institución, al elaborar este formulario deberán proceder considerando la perspectiva siguiente:

- La moneda nacional serán los pesos mexicanos.

- La moneda extranjera será cualquier moneda distinta al peso mexicano, inclusive la del país donde resida la entidad financiera del exterior de que se trate.
- Los acreditados/acreditadas se clasificarán en los distintos conceptos con la misma perspectiva que la de las instituciones mexicanas: entidades financieras del país, las mexicanas; entidades financieras del exterior, las que no son mexicanas; Gobierno Federal, él de México; casas de bolsa, las casas de bolsa mexicanas; banca de desarrollo, la banca de desarrollo mexicana; etc.
- La entidad financiera matriz, será una entidad financiera del grupo; las demás entidades financieras del país integrantes del grupo y sus filiales del país, se clasificarán como tales, y sus propias filiales del exterior, serán entidades financieras filiales del exterior.

VI. COBERTURA DEL FORMULARIO

Deben informarse todas las operaciones de: i) la Institución, incluyendo tanto las operaciones de sus oficinas en la República Mexicana como, en su caso, de sus Agencias y Sucursales en el Exterior, ii) las Entidades Financieras del Exterior Filiales de la propia Institución (Subsidiaria), y iii) el Fondo de Reserva para Pensiones, Jubilaciones y demás Prestaciones al Personal de la propia Institución (Fondo de Reserva del Personal), cuando el fondo de pensiones de la Institución sea de "beneficios definidos".

Debe transmitirse un formulario (con sus 21 secciones) por cada Entidad Financiera del Exterior Filial (subsidiaria), utilizando la clave que corresponda a la entidad conforme al "Catálogo de Instituciones" incorporado al sistema de acopio.

La información del Fondo de Reserva del Personal de la institución debe informarse, de ser el caso, en los conceptos específicos que correspondan (secciones RC06 a RC09).

Por ningún motivo deben reportarse cifras que sean producto de la consolidación o compensación de estados financieros.

En las distintas secciones del formulario deben incluirse los depósitos, valores y créditos, cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Institución.

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

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

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VII. CIFRAS A REPORTAR

En cada una de las secciones se debe reportar la suma de las operaciones (o la parte) que correspondan a cada concepto y columna de que se trate.

Todas las cifras deben reportarse de acuerdo a la estructura de cada sección, y con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación (a menos que se permita expresamente el registro con signo negativo).

VIII. 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.

IX. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN

Este formulario es de periodicidad mensual. Todas las secciones de dicho formulario, o las que le apliquen a la Institución de que se trate, deben transmitirse al Banco de México, a más tardar a las 18:00 horas del décimo quinto día hábil bancario inmediato siguiente al cierre del mes a que corresponda la información.

X. TRANSMISIONES QUE NO SE APEGUEN AL "TIEMPO Y FORMA", Y RETRANSMISIONES

Cuando por cualquier causa la información no sea transmitida en "tiempo y forma" o para una fecha en particular se realicen retransmisiones de información posteriores a la publicación del correspondiente informe de Alertas Tempranas de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, la Institución deberá notificar por medio electrónico a este Instituto Central las causas que originaron tal situación y precisar, en el segundo caso, las modificaciones a las cifras así como el impacto en el índice de capitalización.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES DEL FORMULARIO

A. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC11 y RC13.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Institución	Clave de la institución que reporta la información, conforme al "catálogo de instituciones".	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	si
3	Concepto	Clave del concepto relativo al "catálogo de conceptos".	Carácter	6	######	si
4	Importe1	Importe de las operaciones de la institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.	Numérico	16	12,3	
5	Importe2	Importe de las operaciones "indirectas" de la institución por su inversión en sociedades y fondos de inversión.	Numérico	16	12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos por ello

CONTENIDO DE LAS SECCIONES DEL FORMULARIO

Cada uno de los conceptos de las secciones RC01, RC02, RC03 y RC11 se reporta con el siguiente detalle del plazo de las operaciones:

Banda	Plazo
1	De 1 a 7 días
2	De 8 días a 31 días
3	De 32 días a 92 días
4	De 93 días a 184 días
5	De 185 días a 366 días
6	De 367 días a 731 días
7	De 732 días a 1,096 días
8	De 1,097 días a 1,461 días
9	De 1,462 días a 1,827 días
10	De 1,828 días a 2,557 días
11	De 2,558 días a 3,653 días
12	De 3,654 días a 5,479 días
13	De 5,480 días a 7,305 días
14	Más de 7,306 días

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Cada formulario cuenta con cuatro secciones:

1. Importe Bruto de las Operaciones Activas
2. Importe Bruto de las Operaciones Pasivas
3. Operaciones Activas que se Compensan Totalmente
4. Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC05.

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, debe considerarse:

1. Si la operación es con acciones o sobre acciones, sobre o referido a canastas de acciones, sobre o referidos a índices accionarios; con Certificados Bursátiles, distinguiendo aquellos que otorgan créditos o inviertan en financiamientos; y con oro o con rendimiento referido a éste.

2. La posición (larga y/o corta) de la Institución en la "acción"; en el caso del oro será la posición neta larga o la posición neta corta.

3. El tipo de operación que origina la posición en la "acción"

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC07

Cada uno de los conceptos de esta sección se reporta considerando:

1.- El grupo al que pertenece la entidad emisora del Título de Deuda:
- Grupo I-A
- Grupo II
- Grupo III
- Grupo IV
- Grupo V
- Grupo VII-A
- Grupo IX

2.- La posición de la institución en el título de deuda:
- Posiciones Brutas Largas.
- Posiciones Brutas Cortas.
- Largas y Cortas en el mismo título.

3.- La escala de la calificación externa a la entidad emisora:
- Escala Local.
- Escala Global.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

4.- La denominación o tasa de rendimiento del título de deuda:

- En moneda nacional con tasa de rendimiento nominal.
- En unidades de inversión, o en moneda nacional, con tasa de rendimiento real, o con tasa referida al Salario Mínimo General.
- En moneda extranjera con tasa de rendimiento nominal.
- Con otro rendimiento (por ejemplo: referido a la variación de un tipo de cambio, índices de precios u otro activo financiero (distinto de acciones) etc.).
- Con Vinculación Crediticia (Credit Linked Notes).
- Relativos a las inversiones del fondo de reserva del personal (exclusivamente para calificaciones externas).
- Posiciones de títulos de deuda que sean subyacentes de operaciones de Futuros y contratos adelantados.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC13

Cada uno de los conceptos de las garantías reales recibidas en esta sección se reporta:

- Dinero en efectivo y medios de pago con vencimiento menor a 7 días
- Depósitos y Créditos a cargo de Banco de México
- Valores Gubernamentales (Gobierno Federal e IPAB)
- Instrumentos de deuda emitidos por Gobiernos Centrales de países extranjeros o por sus Bancos Centrales
- Instrumentos de deuda emitidos por personas de las señaladas en el Grupo III o en el Grupo IV
- Instrumentos de deuda emitidos por personas distintas a las anteriores
- Títulos accionarios que formen parte del IPC de la BMV o índices principales de otras Bolsas y obligaciones subordinadas convertibles en tales títulos
- Inversiones en fondos de inversión cuyos activos se limiten a los instrumentos señalados en la fracción I del Art. 2 Bis 33

Cada uno de los conceptos de las garantías personales (avales), derivados y seguros de crédito recibidos en esta sección se reporta considerando el grupo al que pertenece:

- Grupo I-A
- Grupo II
- Grupo III
- Grupo IV
- Grupo VII-A

B. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC04

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Institución	Clave de la institución que reporta la información, conforme al "catálogo de instituciones".	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	Si
3	Concepto	Clave del concepto relativo al "catálogo de conceptos".	Carácter	6	######	Si
4	Importe1	Importe de las operaciones con Posición Significativa, de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.	Numérico	16	12,3	
5	Importe2	Importe de las operaciones "indirectas" con Posición Significativa, de la Institución por su inversión en fondos de inversión.	Numérico	16	12,3	
6	Importe3	Importe de las operaciones con Posición No Significativa, de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.	Numérico	16	12,3	
7	Importe4	Importe de las operaciones "indirectas" con Posición No Significativa, de la Institución por su inversión en fondos de inversión.	Numérico	16	12,3	

CONTENIDO DE LAS SECCIONES DEL FORMULARIO RC04

Cada uno de los conceptos de las secciones del formulario se reporta con el siguiente detalle del plazo de las operaciones:

Banda	Plazo
1	De 1 a 7 días
2	De 8 días a 31 días
3	De 32 días a 92 días
4	De 93 días a 184 días
5	De 185 días a 366 días
6	De 367 días a 731 días
7	De 732 días a 1,096 días
8	De 1,097 días a 1,461 días
9	De 1,462 días a 1,827 días
10	De 1,828 días a 2,557 días

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

11	De 2,558 días a 3,653 días
12	De 3,654 días a 5,479 días
13	De 5,480 días a 7,305 días
14	Más de 7,306 días

El formulario cuenta con cuatro secciones:

1. Importe Bruto de las Operaciones Activas
2. Importe Bruto de las Operaciones Pasivas
3. Operaciones Activas que se Compensan Totalmente
4. Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC04.

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, debe considerarse si la institución mantiene una posición significativa o una posición no significativa en una divisa en términos de lo establecido en el artículo 2 bis 105 de la CUB.

USO LIMITADO

C. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC06 Y APARTADOS

RC06 A. Riesgo de crédito por contraparte en operaciones de reportos, de derivados e incumplimientos.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	Si
3	Contraparte	Clave de la contraparte, conforme al Catálogo General de Contrapartes	Carácter	18	########## #####	Si
4	Tmercado	Tipo de mercado en el que se negocian las operaciones (sólo para operaciones derivadas)	Numérico	3	3	Si
5	IDOperacio	Identificador interno de la operación sobre una misma clase con la misma contraparte (separando las operaciones con importe y sin importe positivo)	Carácter	4	4	Si
6	IDCompensa	Identificador interno del contrato que permite compensar esta operación con alguna otra de la misma contraparte	Carácter	4	4	Si
7	GRiesgo	Grupo de Riesgo de la contraparte	Numérico	3	3	Si
8	PlazoCalif	Plazo de la calificación	Numérico	2	2	
9	Clase	Clase de operación	Numérico	6	6	Si
10	Plazo remanente	Plazo remanente de la operación (aplica sólo para operaciones derivadas, 0= No Aplica, 1= Menor o igual a un año, 2= mayor a un año y menor o igual a cinco años, 3= Más de cinco años)	Numérico	1	1	Si
11	CoeficienteSP	Coeficiente subyacente- plazo (sólo para operaciones derivadas) conforme al anexo 1_L	Numérico	2	2	
12	NocionalE	Monto nocional efectivo (aplica sólo para operaciones derivadas)	Numérico	16	12,3	
13	ImporteA	Valor razonable de la parte activa	Numérico	16	12,3	
14	ImporteP	Valor razonable de la parte pasiva	Numérico	16	12,3	

15	IdGarantia	Clave o folio para identificar la garantía (conforme al formulario de contratos que garantizan operaciones derivadas)	Caracter	20	20	
16	GarantíaMS	Importe de las garantías reales recibidas aplicando el método simple	Numérico	16	12,3	
17	GarantíaMI	Importe ajustado de las garantías reales recibidas aplicando el método integral	Numérico	16	12,3	
18	ImportePO	Monto del importe positivo de operaciones a favor de la institución (costo actual de reemplazo positivo)	Numérico	16	12,3	
19	ImporteNE	Monto del importe NO positivo de operaciones a cargo de la institución (costo actual de reemplazo negativo)	Numérico	16	12,3	
20	Valor añadido	Valor añadido bruto en la operación	Numérico	16	12,3	

RC06 B. Riesgo contraparte por ajuste de valuación crediticia en operaciones derivadas

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	Si
3	Contraparte	Clave de la contraparte, conforme al Catálogo de Contrapartes sección IV.	Carácter	18	########## #####	Si
4	GradRiesgoCont	Grado de Riesgo Conforme a la calificación de la contraparte de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB	Numérico	2	2,0	
5	PondInd	Ponderador promedio ponderado de las entidades incluidas en el índice.	Numérico	10	6,3	
6	ExposicionC	Exposición al incumplimiento neta de la contraparte	Numérico	19	15,3	
7	Ndcont	Monto nocional descontado de las coberturas individuales con la contraparte	Numérico	19	15,3	
8	Ndind	Monto nocional descontado de las coberturas con la contraparte obtenidas mediante derivados de incumplimiento.	Numérico	19	15,3	
9	Mcont	Plazo efectivo de las operaciones con la contraparte	Numérico	12	7,4	
10	Mcob	Plazo efectivo de las coberturas individuales de la contraparte	Numérico	12	7,4	
11	Mind	Plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento crediticio	Numérico	12	7,4	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos

RC06 C. Relativo a la exposición al fondo de incumplimiento en cámaras de compensación de los participantes en el mercado de derivados.

Estructura aplicable hasta la 31/05/2022

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	SI
3	TipoCC	Tipo de cámara de compensación	Numérico	3	3	SI
4	Metodol	Indicador del método utilizado para calcular el requerimiento de capital de fondos de incumplimiento	Numérico	2	2	SI
5	Aportacion	Aportación realizada por la institución para la constitución de Fondos de Incumplimientos en una cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
6	Conversion	Valor de conversión a riesgo de crédito mantienen las instituciones con una cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
7	CapitalT	Capital teórico de la cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
8	RecursosTot Fondo	Recursos totales del fondo de incumplimientos con que dispone la CC para mutualizar pérdidas suponiendo que dos socios liquidadores de tamaño promedio incumplen	Numérico	16	12,3	
9	RecursosPropios	Recursos propios de la cámara de compensación para mutualizar pérdidas	Numérico	16	12,3	
10	Recursos disponibles	Recursos del fondo de incumplimientos disponibles de los socios liquidadores para mutualizar pérdidas.	Numérico	16	12,3	
11	TotalAportac	Monto total de aportaciones de los socios liquidadores al fondo incumplimiento	Numérico	16	12,3	
12	NumeroSoc	Número de socios liquidadores	Numérico	16	12,3	
13	Beta2	Beta de los dos socios liquidadores con mayores valores añadidos	Numérico	6	3,2	
14	Asigna	Tipo de distribución del capital teórico (1000= por obligación del socio liquidador de realizar contribuciones al fondo de incumplimiento , 2000= por márgenes iniciales de cada socio liquidador, 3000= la cámara de compensación cuenta con aportación en firme al fondo de incumplimiento.	Numérico	5	5	
15	FraccSocL	Fracción asignada al socio liquidador cuando la cámara de compensación no cuenta con aportaciones en firme al fondo de incumplimiento	Numérico	6	3,2	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.

ESTRUCTURA APLICABLE DESDE LA FECHA 30/06/2022

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	SI
3	TipoCC	Tipo de cámara de compensación	Numérico	3	3	SI
4	Contraparte	Clave de la cámara , conforme al Catálogo General de Contrapartes	Carácter	18	##################	SI
5	Metodol	Indicador del método utilizado para calcular el requerimiento de capital de fondos de incumplimiento	Numérico	2	2	SI
6	Aportacion	Aportación realizada por la institución para la constitución de Fondos de Incumplimientos en una cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
7	Conversion	Valor de conversión a riesgo de crédito mantienen las instituciones con una cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
8	CapitalT	Capital teórico de la cámara de compensación	Numérico	16	12,3	
9	RecursosPropios	Recursos propios de la cámara de compensación para mutualizar pérdidas	Numérico	16	12,3	
10	Recursos disponibles	Recursos del fondo de incumplimientos disponibles de los socios liquidadores para mutualizar pérdidas.	Numérico	16	12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.

CAMPOS DE LA SECCIÓN RC06

RC06 A

En este apartado deben reportar todas las operaciones con exposición a riesgo de la contraparte considerando lo siguiente:

- Tipo de operación (compras-ventas fecha valor de títulos y divisas, derivados, reportos, préstamos o incumplimientos).
- Grupo de riesgo de la contraparte considerando la clasificación de la CUB.
- Características del mercado en el que se negocian las operaciones.
- Características del tipo de subyacente y plazo remanente de las operaciones.

Deben determinar en cada operación operaciones si cuenta o no con importe positivo, que es la diferencia entre el valor razonable de las partes activa y pasiva conforme al artículo 2 bis 22.

- Operaciones Sin importe positivo a favor de la institución (cuando el activo es menor o igual al pasivo).
- Operaciones Con importe positivo (cuando el activo es mayor que el pasivo).

Deben identificar aquellas operaciones que cuenten con contrato marco de compensación de operaciones para una misma contraparte (derivados, reportos y préstamos) y las que cuenten con garantías o contrato de garantías que estén asociados a dos o más operaciones derivadas.

En el caso de operaciones derivadas deberán reportar el cálculo del valor añadido bruto conforme al anexo 1-L.

RC06 B

Deben considerar todas las operaciones derivadas celebradas con personas distintas al grupo I_B, clasificándolas y agrupándolas por contraparte y grado de riesgo.

Entre los importes a reportar deberán incluir el cálculo de la exposición al incumplimiento descontada de la contraparte (artículo 2 bis 98d.), el monto nocional descontado de las coberturas individuales de la contraparte y el monto nocional descontado de las coberturas obtenidas mediante derivados de incumplimiento.

En lo que respecta a los plazos, deben reportar el plazo efectivo de las propias operaciones con la contraparte (2 bis 98 a), de las coberturas de la operación individuales con la contraparte y de las coberturas mediante derivados de incumplimiento crediticio (2 bis 98 c).

RC06 C

En este apartado deben reportar las aportaciones realizadas por la institución para la constitución de los fondos de incumplimiento en una cámara de compensación por operaciones de derivados por cuenta propia o de terceras personas, así como el valor de conversión a riesgo de crédito de las posiciones que mantienen las instituciones con una cámara de compensación.

Adicionalmente deben reportar la información proporcionada por la cámara de compensación para calcular el requerimiento de capital por su exposición por ejemplo y según corresponda con la versión vigente de la sección: capital hipotético o teórico, número de socios liquidadores, aportaciones por cada socio liquidador, recursos totales del fondo disponibles y para mutualizar pérdidas etc.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

D. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC08, RC10, RC17, y RC12 IN

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Valores permitidos 1_/ 2_/	Formato	Llave (duplicidad)
1	Institución	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".	Carácter	6	Claves de BMU, BDE, SOFOMES y FILIALES DE BANCOS)	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información.	Fecha	8		AAAA/MM/DD	si
3	Concepto	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".	Carácter	6	Valores de Catálogo	6	si
4	Importe1	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. Tratándose de créditos se anotarán los correspondientes a etapa 1 y 2 o a valor razonable)	Numérico	16	RV= [0.000, 999999999999.999], negativos solo para la sección RC12	12,3	
5	Importe2	No aplica para la sección RC17 y RC12_IN. Para la sección RC08 Importe de los creditos en etapa 3 de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, así como exposiciones con Fideicomisos en conceptos específicos. Para la sección RC10 aplica para líneas de crédito con Fideicomisos.	Numérico	16	RV= [0.000, 999999999999.999], solo para la sección RC08, V= 0.000 para las secciones RC10, RC17 y RC12_IN	12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos.

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos, excepto para RC12IN aquellos conceptos que representen una utilidad o pérdida no habrá restricción de signo al reportar el importe de la operación (para mayor referencia véase la sección de validaciones técnicas).

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC08

Cada uno de los conceptos de esta sección se reportan considerando:

1.- Las operaciones que generan riesgo de crédito en operaciones de depósitos, créditos, otros activos y por operaciones contingentes.

- Caja, metales, documentos de cobro inmediato y remesas

- Créditos con intereses devengados

- Otras partidas de activo (cuentas por cobrar, bienes adjudicados, inmuebles mobiliario y equipo, cargos diferidos, pagos anticipados, impuestos diferidos)

- Inversiones accionarias permanentes y del fondo de pensiones

2.- Los importes del saldo insoluto de los créditos (incluyendo aquellos a valor razonable), de las garantías reales aplicando el Método Simple o el Método Integral, ajuste por derivados crediticios recibidos**,** las reservas constituidas que no computen como Capital Complementario, así como la cartera vencida o en etapa 3 de los créditos otorgados a los grupos:

- Grupo I A
- Grupo II
- Grupo III
- Grupo IV
- Grupo V
- Grupo VI (operaciones que no cumplen las condiciones de la reforma publicada en el DOF el 20 de julio de 2021 al artículo 2 bis 17)
- Grupo VII-A
- Grupo VII-B
- Grupo IX

3.- La parte de los saldos insolutos en correspondencia con el plazo de la calificación y los grados de riesgo de las contrapartes así como la escala a la que pertenezcan

- Riesgo 1 corto y largo plazo escala global o escala local
- Riesgo 2 corto y largo plazo escala global o escala local
- Riesgo 3 corto y largo plazo escala global o escala local
- Riesgo 4 corto y largo plazo escala global o escala local
- Riesgo 5 corto y largo plazo escala global o escala local
- Riesgo 6 corto y largo plazo escala global o escala local

4.- Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, debe considerarse la etapa en la que se encuentre el importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero en términos de lo establecido en la CUB.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC10

Cada uno de los conceptos de esta sección se reporta considerando:

1.- El grupo al que pertenece el comprador de protección:

- Grupo I-A
- Grupo II
- Grupo III
- Grupo IV
- Grupo V
- Grupo VII-A

- Grupo IX

2.- Los montos de los avales otorgados por la institución y coberturas a través de derivados de crédito, clasificados por plazo de la calificación y grado de riesgo en:

- Riesgo 1 corto y largo plazo
- Riesgo 2 corto y largo plazo
- Riesgo 3 corto y largo plazo
- Riesgo 4 corto y largo plazo
- Riesgo 5 corto y largo plazo
- Riesgo 6 corto y largo plazo

3.- LOS MONTOS POR RIESGO DE CRÉDITO ASUMIDO POR LA INSTITUCIÓN POR SU PARTICIPACIÓN EN ESQUEMAS DE BURSATILIZACIÓN DE ACTIVOS, CLASIFICADOS POR PLAZO DE LA CALIFICACIÓN Y GRADO DE RIESGO EN (SOLO HASTA 31/05/2022):

- Riesgo 1 corto y largo plazo escalas local y global
- Riesgo 2 corto y largo plazo escalas local y global
- Riesgo 3 corto y largo plazo escalas local y global
- Riesgo 4 corto y largo plazo escalas local y global
- Riesgo 5 corto y largo plazo escalas local y global
- Riesgo 6 corto y largo plazo escalas local y global

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC17

Cada uno de los conceptos de esta sección se reporta considerando:

1. Si se trata de una operación sobre una mercancía en lo particular, canastas de mercancías o índices referenciados a mercancías.
2. La posición larga y/o corta de la Institución en la "mercancía".
3. El tipo de operación que origina la posición en la "mercancía".

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12_IN

La institución para calcular el requerimiento por riesgo operacional bajo método del indicador de negocio debe reportar el saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de los Componentes de Intereses, Arrendamiento y Dividendos, Servicios y Financieros de su estado de resultados tales como:

- Ingreso por interés de todos los activos financieros y otros ingresos por interés (incluye ingreso de arrendamiento financiero y operativo, y ganancia de activos en renta).
- Gastos por intereses de pasivos financieros y otros gastos por intereses (incluyendo gastos por intereses de arrendamiento financiero y operativo, pérdidas, depreciación y deterioro de activos en renta).

- Ingresos por dividendos de inversiones en acciones y fondos no consolidados en los estados financieros de la Institución, incluyendo ingresos por dividendos de subsidiarias no consolidadas, asociadas y partes relacionadas.
- Activos productivos
- Ingresos por comisiones y tarifas
- Gastos por comisiones y tarifas
- Otros ingresos operativos
- Otros gastos operativos
- Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas y diferencia cambiaria.
- Promedio de pérdidas anuales por riesgo operativo de los 10 años previos a la fecha de cálculo

E. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC09

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Valores permitidos 1_/ 2_/	Formato	Llave (duplicidad)
1	Institución	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".	Carácter	6	Claves de BMU, BDE, SOFOMES y FILIALES DE BANCOS)	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información.	Fecha	8		AAAA/MM/DD	si
3	Concepto	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".	Carácter	6	Valores de Catálogo y la sección siempre debe contener los conceptos 95005, 95661, 95055, 95669, 95670,95671,95674,95675,95677 90075, 90080 hasta 31 diciembre 2021	6	si
4	Importe1	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. Inversiones directas	Numérico	16	Negativos solo para los conceptos {95050, 95055, 95060, 95065,95066, 95068, 95398, 95669, 95670, 95671, 95650, 95655, 95661,95674, 95675}, nunca pueden reportarse en cero {95005, 95661, 95055, 95669, 95670,95671,95674,95675,95677} 90075, 90080 hasta 31 diciembre 2021	12,3	
5	Importe2	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. Inversiones indirectas	Numérico	16		12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Importe1 no permite valores negativos por ello se indica el rango de valores mínimo y máximo, excepto aquellos conceptos que se indiquen

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC09

Cada uno de los conceptos de esta sección se reporta considerando los principales grupos de los que se compone el capital regulatorio:

- Capital contribuido y capital ganado
- Emisiones de obligaciones subordinadas (instrumentos de capitalización)
- Inversiones en obligaciones subordinadas, instrumentos relativos a esquemas de bursatilización y acciones.
- Reservas
- Partidas que se contabilicen en el activo de la institución como intangibles o que, en su caso, impliquen el diferimiento de la aplicación de gastos o costos en el capital de la institución Intangibles
- Impuestos diferidos activos
- Monto a deducir por operaciones con personas relacionadas relevantes
- Títulos representativos del capital social que computan en el Capital No Fundamental y Complementario
- Instrumentos de capital
- Monto a deducir de operaciones realizadas con grandes exposiciones

F. ESTRUCTURA DE LAS SECCION RC12

SECCION RC12

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato
1	Inst	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".	Carácter	6	0#####
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información.	Fecha	8	AAAA/MM/DD
3	Concepto	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".	Carácter	6	6

4	Importe 1	Importe total de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.	Numérico	16	12,3
5	Importe 2	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: FINANZAS CORPORATIVAS.	Numérico	16	12,3
6	Importe 3	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: NEGOCIACIÓN Y VENTAS.	Numérico	16	12,3
7	Importe 4	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: BANCA MINORISTA.	Numérico	16	12,3
8	Importe 5	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio BANCA COMERCIAL.	Numérico	16	12,3
9	Importe 6	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: PAGOS Y LIQUIDACIÓN.	Numérico	16	12,3
10	Importe 7	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: SERVICIOS DE AGENCIA	Numérico	16	12,3
11	Importe 8	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: ADMINISTRACIÓN DE ACTIVOS	Numérico	16	12,3
12	Importe 9	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero, originadas en la Línea de Negocio: INTERMEDIACIÓN MINORISTA	Numérico	16	12,3

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12

Con base en el método utilizado por la institución para calcular el requerimiento por riesgo operacional, la institución debe reportar de forma agregada o por línea de negocio, los ingresos y gastos, conforme a los siguientes conceptos:

Saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de los ingresos por intereses:

- Intereses por Disponibilidades
- ☐Intereses y Rendimientos a Favor Provenientes de Cuentas de Margen
- Intereses por Cartera de Crédito Vigente o en etapa 1 y 2
- Intereses por Cartera de Crédito Vencida o en etapa 3
- Intereses y Rendimientos por Inversiones en Valores
- Intereses y Rendimientos en Operaciones de Reporto
- Comisiones a Favor por Operaciones de Crédito
- Premios a Favor por Préstamo de Valores
- Primas por Colocación de deuda (sólo aplica para casas de bolsa)
- Concepto de Ajuste para Cuentas de Gastos por Intereses con Saldos Negativos
- Dividendos de Instrumentos de Patrimonio Neto
- Ingresos Provenientes de Operaciones de Cobertura

Saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de los gastos por intereses:

- Intereses por Depósitos de Exigibilidad Inmediata
- Intereses por Depósitos a Plazo
- Intereses por Títulos de Crédito Emitidos
- Intereses por Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos
- Intereses por Obligaciones Subordinadas
- Intereses y Rendimientos a Cargo en Operaciones de Reporto
- Premios a Cargo en Operaciones de Préstamo de Valores
- Descuentos por Colocación de deuda (sólo aplica para casas de bolsa)
- Concepto de Ajuste para cuentas de Gastos por Intereses con Saldos Negativos
- Gastos de emisión por Colocación de Deuda
- Costos y gastos asociados con el otorgamiento inicial del crédito
- Gastos Provenientes de Operaciones de Cobertura

Saldos netos positivos y negativos acumulados al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo, correspondiente al resultado por compraventa de:

- Valores e instrumentos derivados
- Divisas
- Metales

Saldo neto acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de:

- Comisiones y tarifas cobradas y pagadas
- Reservas constituidas por riesgo operacional

Saldo a fin de mes de los préstamos y anticipos mensuales correspondientes a la línea de negocio de Banca Minorista y Banca Comercial.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

G. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC14.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".	Carácter (6)	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información.	Fecha (8)	8	AAAA/MM/DD	Si
3	TipoC	Tipo de cartera al que corresponde el segmento o crédito, conforme al "Catálogo Tipo de Cartera".	Carácter (6)	6	6	Si
4	Subclase	Clave de subclasificación de cartera al que pertenece el segmento o crédito, conforme al "Catálogo Subclase de cartera".	Carácter (6)	6	6	Si
5	Etiq1	Categoría del segmento o crédito (EB:en el balance, EA:dada en administración, FB:fuera del balance).	Carácter (2)	2		Si
6	GPrelación	Grado de Prelación de pago del segmento o crédito(P= Preferente, S= Subordinado).	Carácter (2)	2		Si
7	IdSegmento	Clave de la calificación o de la segmentación interna.	Carácter (20)	20		Si
8	Nsegmento	Descripción de las características de la segmentación interna.	Carácter (250)	250		
9	Importe1	Importe insoluto del crédito.	Numérico (15,3)	16	12,3	
10	Importe2	Importe de la cartera vencida o en etapa 3.	Numérico (15,3)	16	12,3	
11	Importe3	Importe de la línea de crédito no dispuesta.	Numérico (15,3)	16	12,3	
12	Etiq2	Metodología de cálculo (B= Metodología Interna Básica, A= Metodología Interna Avanzada).	Carácter (2)	2		
13	Importe4	Exposición al incumplimiento (incluye ajustes por líneas de crédito no dispuestas) del segmento.	Numérico (15,3)	16	12,3	
14	xCien1	Probabilidad de incumplimiento del deudor o probabilidad de incumplimiento promedio del segmento (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
15	xCien2	Severidad de la pérdida en incumplimiento del acreditado/acreditada o severidad promedio de la pérdida en incumplimiento del segmento (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
16	Factor	Coeficiente de correlación entre acreditados/acreditadas de la misma segmentación.	Numérico (5,2)	6	3,2	
17	Plazo	Plazo efectivo del crédito o plazo efectivo ponderado de los créditos de la misma segmentación (años).	Numérico (5,2)	6	3,2	
18	NumOpe	Número de casos por segmento (unidades).	Numérico (15,3)	16	12,3	
19	Importe5	Importe de la exposición cubierta mediante Garantías Reales Admisibles que cumplan con el Art. 2 Bis 33 de la CUB	Numérico (15,3)	16	12,3	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
20	Importe6	Importe de la exposición cubierta mediante Garantías Reales Elegibles inciso i) numeral 6 anexo 1-L.	Numérico (15,3)	16	12,3	
21	Importe7	Suma del importe de la exposición cubierta mediante garantías reales admisibles y elegibles.	Numérico (15,3)	16	12,3	
22	Importe8	Exposición al incumplimiento ajustada por las garantías reales recibidas.	Numérico (15,3)	16	12,3	
23	xCien3	Severidad de la pérdida en incumplimiento efectiva de la operación o del segmento (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
24	Importe9	Importe de la exposición cubierta mediante garantías personales.	Numérico (15,3)	16	12,3	
25	Importe10	Importe de la exposición cubierta mediante derivados de crédito.	Numérico (15,3)	16	12,3	
26	Importe11	Suma del importe de la exposición cubierta mediante garantías personales y derivados de crédito.	Numérico (15,3)	16	12,3	
27	xCien4	Probabilidad promedio de incumplimiento del garante (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
28	xCien5	Severidad promedio de la pérdida en incumplimiento del garante (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
29	Importe12	Exposición ajustada por las garantías y derivados de crédito recibidos.	Numérico (15,3)	16	12,3	
30	Importe13	Importe de la exposición cubierta mediante garantías por el método avanzado.	Numérico (15,3)	16	12,3	
31	xCien6	Probabilidad de incumplimiento del deudor o probabilidad de incumplimiento promedio del segmento, ajustada en función del reconocimiento de garantías bajo el método interno avanzado (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
32	xCien7	Severidad de la pérdida en incumplimiento, ajustada en función del reconocimiento de garantías bajo el método interno avanzado (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
33	xCien8	Ponderador del requerimiento por riesgo de crédito, en su caso ajustado por el reconocimiento de garantías bajo el método interno avanzado (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
34	Importe14	Requerimiento de capital por riesgo de crédito determinado mediante modelos internos del segmento o crédito.	Numérico (15,3)	16	12,3	
35	Importe15	Requerimiento de capital por riesgo de crédito determinado mediante el método estándar del segmento o crédito.	Numérico (15,3)	16	12,3	
36	xCien9	Porcentaje de aplicación del método estándar (por ciento).	Numérico (5,2)	6	3,2	
37	Importe16	Pérdidas esperadas totales.	Numérico (15,3)	16	12,3	
38	Importe17	Reservas admisibles totales.	Numérico (15,3)	16	12,3	
39	Importe18	Reservas con tratamiento establecido en el Art. 2 Bis 6 inciso K de la CUB.	Numérico (15,3)	16	12,3	
40	Importe19	Reservas con tratamiento establecido en la fracción III del Art. 2 Bis 7 de la CUB.	Numérico (15,3)	16	12,3	

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
41	Importe20	Exceso de reservas para situaciones de incumplimiento respecto de la pérdida esperada.	Numérico (15,3)	16	12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.

CONTENIDO DE LA SECCIÓN RC14

Los campos de esta sección se reportan considerando:

1.- Las Características del Crédito.

- Tipo de cartera al que corresponde el segmento o crédito.
- Clave de subclasificación de cartera al que pertenece el segmento o crédito.
- Categoría de exposición del segmento o crédito (EB: en el balance, EA: dada en administración, FB: fuera del balance).
- Grado de Prelación de pago del segmento o crédito (P= Preferente, S= Subordinado).
- Clave de la calificación o de la segmentación interna.
- Descripción de la calificación o de la segmentación interna.
- Importe insoluto del crédito.
- Importe de la cartera vencida o en etapa 3.
- Importe de la línea de crédito no dispuesta.

2.- Los Parámetros Intermedios de la metodología basada en calificaciones internas según el enfoque básico o avanzado.

- Metodología de cálculo (B= Metodología Interna Básica, A= Metodología Interna Avanzada).
- Exposición al incumplimiento (incluye ajustes por líneas de crédito no dispuestas) del segmento.
- Probabilidad de incumplimiento del deudor o probabilidad de incumplimiento promedio del segmento (por ciento).
- Severidad de la pérdida en incumplimiento del acreditado/acreditada o severidad promedio de la pérdida en incumplimiento del segmento (por ciento).
- Coeficiente de correlación entre acreditados/acreditadas de la misma segmentación.
- Plazo efectivo del crédito o plazo efectivo ponderado de los créditos de la misma segmentación (años).
- Número de casos por segmento (unidades).

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

3.- El Reconocimiento de las Garantías, el cual depende del enfoque que se esté utilizando.

Tratamiento de las garantías reales y personales en el método interno básico.

- Importe de la exposición cubierta mediante Garantías Reales Admisibles que cumplan con el inciso II del Anexo 24 y el Art. 2 Bis 33 de la CUB.
- Suma del importe de la exposición cubierta mediante garantías reales admisibles y elegibles.
- Exposición al incumplimiento ajustada por las garantías reales recibidas.
- Severidad de la pérdida en incumplimiento efectiva de la operación o del segmento (por ciento).
- Importe de la exposición cubierta mediante garantías personales.
- Importe de la exposición cubierta mediante derivados de crédito.
- Suma del importe de la exposición cubierta mediante garantías personales y derivados de crédito.
- Probabilidad promedio de incumplimiento del garante (por ciento).
- Severidad promedio de la pérdida en incumplimiento del garante (por ciento).
- Exposición ajustada por las garantías y derivados de crédito recibidos.

Tratamiento de las garantías en general en el método interno avanzado.

- Importe de la exposición cubierta mediante garantías.
- Probabilidad de incumplimiento del deudor o probabilidad de incumplimiento promedio del segmento, ajustada en función del reconocimiento de garantías (por ciento).
- Severidad de la pérdida en incumplimiento, ajustada en función del reconocimiento de garantías (por ciento).

4.- Los Ponderadores y Requerimientos de Capital de la cartera por metodología estándar o basada en calificaciones internas.

Metodología basada en calificaciones internas.

- Ponderador del requerimiento por riesgo de crédito (por ciento).
- Requerimiento de capital por riesgo de crédito.

Metodología Estándar.

- Requerimiento de capital por riesgo de crédito.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- Porcentaje de aplicación del método estándar (por ciento).

5.- El Reconocimiento de Reservas en el Capital para la cartera por metodología estándar o basada en calificaciones internas

Metodología de pérdida esperada.

- Pérdidas esperadas totales.
- Reservas admisibles totales.
- Reservas con tratamiento establecido en el inciso K del Art. 2 Bis 6 de la CUB.
- Reservas con tratamiento establecido en la fracción III del Art. 2 Bis 7 de la CUB.
- Exceso de reservas para situaciones de incumplimiento respecto de la pérdida esperada.

Metodología de pérdida incurrida.

- Reservas ya constituidas.
- Reservas pendientes de constituirse.
- Otras reservas pendientes de constituirse y reservas constituidas con cargo a cuentas distintas de resultados o de capital.

USO LIMITADO

H. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC15 EN SUS APARTADOS A y B

RC15 A: OPERACIONES SUJETAS A RIESGO DE CRÉDITO CON PERSONAS RELACIONADAS.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Alfanumérico	6	6	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	Si
3	CPersonaRel	Clave de la persona relacionada, conforme al Catálogo General de Contrapartes sección IV	Alfanumérico	18		Si
4	Clase	Clase de la operación relacionada (ejem: Depósitos Bancarios (10101), Comprade Divisas (10103), Derivados de crédito (vendedor de protección) (10420), Otros Créditos Vigentes (10204), Otras operaciones (10501))	Numérico	6	6, 0	Si
5	Moneda	Moneda (ejemplo: US DOLLAR (840), PESOS (484), OTRAS DIVISAS (9999))	Numérico	4	4	Si
6	Importe	Monto de la parte activa de las operaciones	Numérico	16	12,3	
7	ImportePO	Monto de la parte pasiva de las operaciones	Numérico	16	12,3	
8	TipoOpB	Tipo de operación en balance	Numérico	1	1	Si
9	FechaC	Indicador relativo a la fecha de concertación de la operación para determinar la aplicación del requerimiento o deducción del capital.	Numérico	1	1	Si
10	ImporteP	Monto del importe positivo de operaciones a favor de la institución.	Numérico	16	12,3	
11	ImporteN	Monto del importe NO positivo de operaciones a cargo de la institución	Numérico	16	12,3	
12	GRiesgo	Grupo de Riesgo	Numérico	3	3	Si
13	Grado	Grado de Riesgo Conforme a la calificación del acreditado/acreditada, contraparte o emisión de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB	Numérico	2	2	Si
14	PlazoCalif	Plazo de la calificación	Numérico	2	2	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
15	Garantia	Garantías reales	Numérico	16	12,3	
16	Aval	Garantías personales y cobertura mediante Derivados de Crédito.	Numérico	16	12,3	
17	Reserva	Reservas	Numérico	16	12,3	
18	ImporteRC1	Importe de la Exposición al Riesgo de Crédito que se le aplicará el coeficiente de cargo por riesgo del 100%	Numérico	16	12,3	
19	ImporteRC2	Importe de la Exposición al Riesgo de Crédito que se le aplicará el coeficiente de cargo por riesgo del 115%	Numérico	16	12,3	
20	ImporteRC3	Importe de la Exposición que se deduce del capital	Numérico	16	12,3	
21	Tmercado	Tipo de mercado en el que se negocian las operaciones (sólo para operaciones derivadas)	Numérico	3	3	Si
22	IDOperacio	Identificador interno de la operación sobre una misma clase con la misma contraparte (separando las operaciones con importe y sin importe	Carácter	4	4	Si
23	IDCompensa	Identificador interno del contrato que permite compensar esta operación con alguna otra de la misma contraparte	Carácter	4	4	Si
24	Plazo remanente	Plazo remanente de la operación (aplica sólo para operaciones derivadas, 0= No Aplica, 1= Menor o igual a un año, 2= mayor a un año y menor o igual a cinco años, 3= Más de cinco años)	Numérico	1	1	Si
25	NocionalE	Monto nocional efectivo (aplica sólo para operaciones derivadas)	Numérico	16	12,3	
26	IdGarantia	Clave o folio para identificar la garantía (conforme al formulario de contratos que garantizan operaciones derivadas)	Carácter	20	20	
27	Valor añadido	Valor añadido bruto en la operación	Numérico	16	12,3	
28	TipoTrat	Tipo de tratamiento (facilidad covid o reforma art 2 bis 17) conforme al catálogo anexo	Numérico	2	2	Si
29	Periodo_cred	Periodo en el cual se realizó la reestructura, la renovación u otorgamiento del crédito (tratándose de nuevos créditos)	Numérico	6	6,0	Si

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
30	Situacion	Situación del crédito	Numérico	2	2,0	Si
31	Etiq_Periodo_Paralelo	Bandera que indica si la cartera se encuentra bajo metodologías internas dentro de un en periodo en paralelo de cálculo.	Numérico	2	2,0	Si

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.

RC15 B. RIESGO CONTRAPARTE POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA EN OPERACIONES DERIVADAS CON PERSONAS RELACIONADAS

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter	6	0#####
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD
3	Contraparte	Clave de la contraparte, conforme al Catálogo de Contrapartes sección IV.	Carácter	18	
4	GradRiesgoCont	Grado de Riesgo Conforme a la calificación de la contraparte de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB	Numérico	2	2,0
5	PondInd	Ponderador promedio ponderado de las entidades incluidas en el índice.	Numérico	10	6,3
6	ExposicionC	Exposición al incumplimiento neta de la contraparte	Numérico	16	12,3
7	Ndcont	Monto nocional descontado de las coberturas individuales con la contraparte	Numérico	16	12,3
8	Ndind	Monto nocional descontado de las coberturas con la contraparte obtenidas mediante derivados de incumplimiento.	Numérico	16	12,3
9	Mcont	Plazo efectivo de las operaciones con la contraparte	Numérico	12	7,4
10	Mcob	Plazo efectivo de las coberturas individuales de la contraparte	Numérico	12	7,4
11	Mind	Plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento crediticio	Numérico	12	7,4

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos por ello se indica el rango de valores mínimo y máximo

I. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC18.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".	Carácter	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha a la que corresponde la información.	Fecha	8	AAAA/MM/DD	si
3	Concepto	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".	Carácter	6	######	si
4	Importe 1	Suma de las multiplicaciones del monto de la posición activa (pasiva) al cuadrado por el valor gamma de la opción i con subyacente j.	Numérico	19	15,3	
5	Importe 2	Suma de las "Importe vega neto" conforme a la fracción V del artículo 2 bis 109 b de la opción i con subyacente j.	Numérico	19	15,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos

CONTENIDO DE LA SECCIÓN DEL FORMULARIO RC18

Cada uno de los conceptos de las secciones del formulario se reporta con el siguiente detalle del plazo de las operaciones:

Banda	Plazo
1	De 1 a 7 días
2	De 8 días a 31 días
3	De 32 días a 92 días
4	De 93 días a 184 días
5	De 185 días a 366 días
6	De 367 días a 731 días
7	De 732 días a 1,096 días
8	De 1,097 días a 1,461 días
9	De 1,462 días a 1,827 días
10	De 1,828 días a 2,557 días
11	De 2,558 días a 3,653 días
12	De 3,654 días a 5,479 días
13	De 5,480 días a 7,305 días
14	Más de 7,306 días

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

El formulario cuenta con cuatro secciones:

1. Posición larga
2. Posición corta
3. Compensaciones

J. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC19.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Carácter (6)	6	0#####	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha (8)	8	AAAA/MM/DD	Si
3	ClaveTR	Clave del Tipo de Requerimiento	Numérico (3,0)	3	3	Si
4	Jurisdicción	Clave de la jurisdicción a la que se encuentra expuesta la institución	Carácter (2)	2	2	Si
5	ImporteR	Importe del requerimiento asociado al tipo de riesgo y jurisdicción	Numérico (15,3)	16	12,3	

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.

CONTENIDO DE LA SECCIÓN DEL FORMULARIO RC19

Cada registro reportado en esta sección deberá detallarse considerando:

1.- El país de jurisdicción bajo el cual se encuentra expuesta la Institución y

2.- El tipo de requerimiento de crédito con el sector privado.

K. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC08_A.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Alfanumérico	6	6	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha	8	AAAA/MM/DD	Si
3	Tiporel	Tipo de relación	Numérico	2	2,0	Si
4	Clase	Clase de operación	Numérico	6	6,0	Si

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
5	TipoTrat	Tipo de tratamiento (facilidad covid o reforma art 2 bis 17) conforme al catálogo anexo	Numérico	2	2	Si
6	Periodo_cred	Periodo en el cual se realizó la reestructura, la renovación u otorgamiento del crédito.	Carácter	6	6,0	Si
7	Situacion	Situación del crédito	Numérico	2	2,0	Si
8	GRiesgo	Grupo de Riesgo	Numérico	3	3,0	Si
9	Grado	Grado de Riesgo Conforme a la calificación del acreditado/acreditada, contraparte o emisión de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB	Numérico	2	2,0	Si
10	PlazoCalif	Plazo de la calificación	Numérico	2	2,0	
11	Plazo_remanente	Plazo remanente de las operaciones calculado como promedio ponderado.	Numérico	2	2,0	Si
12	Importe	Importe Insoluto (RESPONSABILIDAD TOTAL)	Numérico	16	12,3	
13	Garantia_ME	Importe de las Garantías recibidas aplicando el Método Simple	Numérico	16	12,3	
14	Garantia_MI	Importe del Ajuste derivado de las Garantías Reales recibidas aplicando el Método Integral	Numérico	16	12,3	
15	Aval	Monto avalado por cualquier persona	Numérico	16	12,3	
16	Der_Cred	Importe del Ajuste derivado de la cobertura recibida por Derivados de Crédito contratados con cualquier persona	Numérico	16	12,3	
17	Reservas	Reservas constituidas que no computan como capital complementario para los créditos	Numérico	16	12,3	
18	Req_Ant	Requerimiento de capital tomando los valores de los ponderadores vigentes de la CUB sin considerar el oficio P418/2020	Numérico	16	12,3	
19	CCV_promedio	CCV promedio ponderado (por el saldo insoluto) de los créditos agrupados en el registro expresado en porcentaje	Numérico	6	3,2	
20	Valor_vivienda	Suma del valor de la vivienda de los créditos agrupados en el registro	Numérico	16	12,3	
21	Valor_subcuenta	Suma de los Recursos de la subcuenta de la vivienda de los créditos agrupados en el registro	Numérico	16	12,3	
22	Etiq_Periodo_Paralelo	Bandera que indica si la cartera se encuentra bajo metodologías internas dentro de un periodo en paralelo de cálculo.	Numérico	2	2,0	Si

1_/ Ningún campo de la estructura permite nulos

2_/ Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos

CONTENIDO DE LA SECCIÓN DEL FORMULARIO RC08A

Cada registro reportado en esta sección deberá detallarse considerando la clase de crédito con tratamiento de faciliades COVID o bajo el artículo 2 bis 17.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

L. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC10A.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Inst	Clave de la Institución (conforme al catálogo elaborado con base en el CASFIM-SHCP)	Alfanumérico	6	6	Si
2	Fecha	Fecha del último día natural del mes al cual corresponde la información	Fecha (AAAA/MM/DD)	8	AAAA/MM/DD	Si
3	Clave_emisión	Clave del la emisión del esquema de bursatilización (si aplica) .	Alfanumérico	18	18	Si
4	Esquema	Tipo de esquema de bursatilización (Tradicional, sintético o estructuras similares).	Numérico	2	2,0	Si
5	Tipo_activo subyacente	Tipo de activo subyacente del esquema tradicional o sintético de bursatilización o lineas de créditos a esquemas de bursatilización	Numérico	2	2,0	Si
6	Forma_part	Forma en la que participa la institución en el esquema de bursatilización	Numérico	2	2,0	Si
7	Transferencia	Tipo de transferencia	Numérico	2	2,0	Si
8	Clase_bursatilización	Clase de bursatilización	Numérico	2	2,0	Si
9	Calificacion_GradoRgo	Calificación otorgada por Institución Calificadora, considerando escala y plazo asociada a su grado de riesgo	Numérico	5	5,0	Si
10	Tipo_tramo	Tipo de subordinación del tramo	Numérico	2	2,0	Si
11	Plazo_efectivo	Plazo efectivo o de vencimiento de la posición, conforme a la metodología establecida en el Artículo 2 Bis 80, fracción I. Expresado en años	Numérico	6	3,2	Si
12	Tipo_plazo	Tipo de metodología aplicada para el cálculo del plazo efectivo	Numérico	1	1,0	Si
13	Pond_ Final	Ponderador asociado al grado de riesgo al tramo del esquema y al plazo de la calificación	Numérico	7	4,2	
14	Punto_A	Corresponde al cociente de la diferencia del valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura menos el valor contable de todos los tramos que tengan igual o menor subordinación respecto a la posición, incluido el tramo al que corresponda esta última, entre el valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura.	Numérico	6	3,2	Si
15	Punto_D	Corresponde al cociente de la diferencia del valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura menos el valor contable de todos los tramos que tengan menor subordinación respecto a la posición, entre el valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura.	Numérico	6	3,2	Si
16	Importe	Importe de la posición	Numérico	16	12,3	
17	Req_ posicion	Requerimiento de capita de la posición bajo tratamiento específico	Numérico	16	12,3	
18	Req_ act_ suby	Requerimiento de capita de los activos subyacentes, como si no se hubieran bursatilizado	Numérico	16	12,3	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

CONTENIDO DE LA SECCIÓN DEL FORMULARIO RC10A

Cada registro reportado en esta sección deberá detallarse considerando el esquema de bursatilización, tipo de activo subyacente, clase de bursatilización, así como características propias del título y esquema.

N. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC21 INSTRUMENTOS DE CAPITAL VIGENTES Y TÍTULOS REPRESENTATIVOS DE CAPITAL A COMPUTAR EN EL SUPLEMENTO DE CAPITAL NETO.

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
1	Fecha_corte	Fecha de corte	Fecha (8)	8.00	AAAA/MM/DD	Sí
2	Emisor	Se refiere a clave CASFIM, o a la asignada por Banco de México, utilizada para identificar a la entidad entidad emisora del instrumento	Carácter (6)	6.00	0#####	Sí
3	ClaveTit	Clave del Título conforme al "Catálogo deTítulos". 1_/	Alfanumérico	18.00	18.00	Sí
4	MontCircNom	Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda en que fue emitida la emisión	Numérico	16.00	12,3	
5	MontCircPes	Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda nacional	Numérico	16.00	12,3	
6	Tasa Cupón	Valor de la tasa con la que el cupón corta.	Numérico	3	3,2	
7	Pzo_residual	Plazo residual en años (a la fecha de vencimiento)	Numérico	3	3,2	
8	Nivel_capital	Nivel de capital regulatorio en el cual se reconocen dentro del Capital Neto, conforme al catálogo.	Numérico	3.00	3.00	Sí
9	Valor_contable	Valor conforme a los criterios contables.	Numérico	16.00	12,3	
10	Monto_capital	Monto computable en el capital básico no fundamental o complementario	Numérico	16.00	12,3	
11	Cve_suplemento	Elegibilidad para suplemento de capital neto conforme al catálogo.	Alfanumérico	3.00	3.00	

	Etiqueta	Descripción	Tipo dato	Longitud	Formato	Llave (duplicidad)
12	Monto_suplemento	Monto del suplemento de capital neto aplicando en su caso el art. Segundo transitorio.	Numérico	16.00	12,3	
13	Activos_ajustados	Activos Ajustados (utilizados para el cálculo de la razón de apalancamiento).	Numérico	16.00	12,3	
14	Activos_ponderados	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.	Numérico	16.00	12,3	
15	Cve_baja	Razón de la baja	Numérico	3.00	3.00	
16	Fecha_amortizacion	Fecha de amortización anticipada o conversión	Fecha (8)	8.00	AAAA/MM/DD Permite nulos cuando no hay fecha a reportar	
17	Monto_amortizacion	Monto de la amortización anticipada o conversión en moneda nacional.	Numérico	3.00	12,3	

- Ningún campo de la estructura permite nulos excepto cuando se especifique.
-Ningún campo numérico de la estructura permite valores negativos.
1_/ Para el envío en esta sección, el instrumento subordinado deberá contar con una clave conforme al catálogo de títulos y contar con la información que este solicite.

CONTENIDO DE LA SECCIÓN DEL FORMULARIO RC21

Cada registro reportado en esta sección deberá detallarse considerando los instrumentos de capital vigentes emitidos por la institución. En el caso de que una emisión sea amortizada o convertida en acciones, esta deberá reportarse en esta sección al cierre de mes en el cual se llevó a cabo la operación.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Ayudas Específicas

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 01

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC01 RELATIVA A OPERACIONES CON RIESGO DE MERCADO POR TASA DE INTERÉS NOMINAL EN MONEDA NACIONAL

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC01

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda nacional, en las operaciones de: depósitos a la vista y a plazo, tenencia incluidos los otorgados en garantía sin transferencia de propiedad, compras y ventas de títulos, reportos, préstamos de valores, futuros y contratos adelantados, intercambio de flujos de dinero (swap), opciones, créditos, redescuento de cartera, bienes en garantía (con transferencia de propiedad), denominados en moneda nacional y cuyo rendimiento esté referido a tasas de interés nominales, en los que contractualmente la Institución que recibe u otorga la garantía mantenga el derecho de conservar los flujos de efectivo generados por dichos bienes objeto de la garantía, o las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en su precio y otras operaciones.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC01

La sección RC01 está conformada por los conceptos 10000 al 19999, con dos columnas en donde deberá reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la Institución con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda nacional, tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda nacional por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda nacional -por su inversión, que no corresponda al patrimonio fijo, en fondos de inversión bajo cualquier modalidad de participación, derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

La columna 2 deberá reportarse considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, con tasa de interés en moneda nacional que formen parte del portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (Fracción IX del Art. 2 Bis 100 de la CUB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC01

En esta sección se solicita la sumatoria de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos, en su caso, deberán realizarse operación por operación.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la "CUB", cada operación está compuesta por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos; otro ejemplo, las operaciones de reporto, actuando como reportador, se considerarán como dos operaciones simultáneas: la cantidad de dinero a recibir computará como un activo, y los títulos a entregar como un pasivo; otro ejemplo, las operaciones de futuro de compra de dólares computarán como dos operaciones simultáneas: los dólares a recibir como un activo y los pesos a entregar como un pasivo. En tales circunstancias en lo sucesivo cuando se haga referencia a "las operaciones", en singular o plural, se podrá estar hablando de alguna de las partes de una operación o de una operación como un todo, según sea el caso.

Cada parte de las operaciones debe informarse en aquella sección a que corresponda.

Cabe señalar que hay operaciones cuyas partes están sujetas al mismo riesgo de mercado, por ejemplo, un reporto de CETES, con precio en pesos y premio a tasa nominal fija: tanto el título como el dinero se informarán en la sección RC01. Sin embargo, hay diversas operaciones cuyas partes NO están sujetas al mismo riesgo de mercado, por lo tanto, cada una de tales partes tendrá que informarse en la respectiva sección, RC01 a RC05; por ejemplo, en una compra de acciones liquidable en pesos fecha valor 48 horas: las acciones tendrán que informarse en el RC05 y el dinero a liquidar en el RC01.

Para identificar a qué sección pertenece una operación debe tenerse presente lo siguiente:

- Los títulos e instrumentos, sin excepción, se clasificarán por las características del título o instrumento, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características "del dinero" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

TIPO DE TÍTULO	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
CETE en tenencia	RC01
CETE a recibir por compras valor 24 horas.	RC01
Acciones en tenencia	RC05
Acciones a recibir por futuros o préstamo	RC05
Acciones a entregar por ventas 48 horas.	RC05
Títulos de deuda con tasa referida a la variación en el precio de una acción.	RC05
UDIBONOS en reporto con premio a tasa real	RC03
Bonos UMS en tenencia	RC04
Pagarés bancarios en M.N.	RC01
Pagarés bancarios en UDIS	RC03
CD's bancarios en dólares	RC04
Bondes en reporto con premio a tasa fija	RC01
UDIBONOS a recibir por compras 24 horas	RC03
Créditos a tasa CCP + X	RC01
Créditos a tasa TIIE * Y	RC01
Créditos a tasa fija en M.N.	RC01
Créditos en UDIS	RC03
Créditos a tasa real	RC03
Créditos a tasa CCP-UDIS	RC03
Créditos en moneda extranjera	RC04
Créditos en moneda nacional con tasa de interés referida al SMG	RC11

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Como puede observarse en los ejemplos anteriores la clasificación de los títulos o instrumentos deriva de sus propias características, sin que importen, en su caso, las características de "las operaciones asociadas".

- "El dinero", sin excepción, siempre se clasificará por las características del dinero sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características del "título o instrumento" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

DINERO A RECIBIR O A ENTREGAR	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
Por reportos en M.N. a tasa nominal, de CETES	RC01
Por compras de CETES valor 24 horas	RC01
Por compras de UDIBONOS valor 48 horas	RC01
Por futuros de dólares (dólares a recibir o a entregar)	RC04
Por futuros de dólares (pesos a recibir o a entregar)	RC01
M.E. por compraventa de Bonos UMS	RC04
M.N. por opciones de acciones	RC01

V. PLAZO DE LAS OPERACIONES

Deberá determinarse el plazo particular de cada una de las partes de las operaciones. Para ello se procederá en los mismos términos de lo señalado en la instrucción anterior:

El plazo de los títulos o instrumentos, sin excepción, se determinará según las características de los títulos o instrumentos, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar las características (plazo) del dinero involucrado en la operación, y

El plazo del dinero se determinará según las características del dinero, sin importar las características del título o instrumento involucrado en la operación.

"El plazo" de cada operación será equivalente al número de días que se determine (según lo señalado en el Art. 2 Bis 102 de la CUB) conforme a lo siguiente:

A) En todos los casos (tasa fija y revisable, para cualquier esquema de amortización), "el plazo" de las operaciones (dinero y títulos) inicia el último día del mes de que se trate (mes a que corresponda el reporte), sin importar la fecha de emisión, otorgamiento o contratación, según sea el caso, el tipo de operación o el tipo de tasa. Por ejemplo, para el reporte relativo a junio, "el plazo" de todas las operaciones que enseguida se señalan inicia el 30 de junio:

Pagaré emitido el 28 de diciembre, con vencimiento al 15 de noviembre.

Dinero a recibir por un reporto contratado el 30 de junio con vencimiento el 2 de enero.

Crédito a tasa ajustable al final del mes, otorgado el 7 de febrero con vencimiento el 6 de febrero.

En los ejemplos anteriores, si el reporte fuera de octubre, el inicio de todas las operaciones sería el 31 de octubre.

B) En cuanto a operaciones a tasa fija y con amortización total al vencimiento, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina al vencimiento de la operación. Ejemplos de operaciones (dinero o títulos) en moneda nacional a tasa fija son:

- CETES; pagarés bancarios con rendimiento liquidable al vencimiento; Dinero a recibir o a entregar por: reportos con premio a tasa fija, por futuros de tasas, por futuros de pesos, por opciones, etc.; créditos a tasa fija amortizable al final del plazo, etc.

En todos estos casos el plazo termina al vencimiento del título, del crédito o del dinero, según se trate.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con pago de intereses periódicos y/o con amortizaciones periódicas del principal, el plazo en días será, según lo decida la institución, el que se indica en el inciso B) anterior o el equivalente a la "Duración" del instrumento, calculada conforme a la fórmula indicada en el Anexo 1-N de la CUB.

D) Respecto a operaciones con tasa de interés revisable o cuyo rendimiento esté referido a alguna tasa de interés nominal, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina en la fecha de revisión o de ajuste de la tasa o, en su caso, la de vencimiento de la operación (o parte de la operación) cuando ya no vaya a haber más revisiones o ajustes de tasa. Ejemplos de operaciones en moneda nacional con tasa ajustable (referidas a otra tasa de una fecha y/o plazo y/o período específico, que aplica a lapsos determinados) son:

- Bondes; Certificados de depósito, bonos bancarios, obligaciones subordinadas, etc., con tasa ajustable; Préstamos y créditos con tasa ajustable; Dinero a recibir o a entregar por reportos cuyo premio se haya pactado con tasa de interés ajustable, etc.

En todos estos ejemplos "el plazo" termina en la fecha de ajuste de tasa del título o crédito o dinero.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, o del crédito o del instrumento, es independiente a la fecha de su vencimiento y a la fecha de pago de los intereses; en algunos casos pueden coincidir, en otros no.

Para ilustrar lo anterior, a continuación, se dan algunos ejemplos de operaciones que tienen el mismo "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa), al margen de que son distintos sus vencimientos y sus fechas de pago de intereses, y de operaciones

que tienen distinto "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa) al margen de que tienen igual fecha de vencimiento y de pago de intereses:

Ejemplos de operaciones al mismo plazo

- Depósito a plazo de 3 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada 3 meses.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada mes.
- Bono a 10 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses capitalizables cada mes.

Las tres operaciones anteriores, durante su vigencia, para efectos del cómputo de capitalización tiene el mismo plazo: un mes.

Ejemplos de operaciones con distinto plazo

- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada mes y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada dos meses y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el sexto mes y con pago de intereses el día último de cada mes.

Las tres operaciones anteriores para efectos del cómputo de capitalización tienen distinto plazo:

- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente, suponiendo que se hubieran otorgado el día último del mes X;
- 1 mes, 1 mes y 5 meses, respectivamente, en el mes X+1;
- 1 mes, 2 meses y 4 meses, respectivamente, en el mes X+2;
- 1 mes, 1 mes y 3 meses, respectivamente en el mes X+3;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+5;
- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente en el mes X+6;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+11.

Lo señalado en los incisos anteriores podría resumirse de la siguiente manera: "el plazo" serán los días que van del último día del mes de que se trate (mes del reporte) al día en que los correspondientes recursos (operación activa u operación pasiva) van a ser objeto de una reapreciación (nueva tasa), lo cual ocurre:

- Al vencimiento si la operación es a tasa fija sin pago de cupones (ni intereses ni principal), ya que los recursos al vencimiento se destinan a otra operación,

- Al plazo resultante de aplicar la fórmula de la "Duración" si la operación es a tasa fija con pagos parciales de intereses y/o de principal, ya que los recursos se destinarán a otra operación, en promedio, al plazo que se obtenga de la fórmula de la Duración, y
- A la fecha de revisión o ajuste de la tasa si la operación se pactó con tales características, en este caso aunque los recursos sigan destinados a la misma operación a partir de dicha fecha de revisión o ajuste tienen una tasa (precio) distinta.

En cuadro denominado "plazo de las operaciones" que se encuentra en las Ayudas del Sistema de Acopio, se señalan las partes de que están constituidas diversas operaciones y la forma de determinar su plazo.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC01

Considerando el procedimiento establecido en la "CUB" para determinar la exposición a riesgo de mercado y el respectivo requerimiento de capital, esta sección está constituida por dos subsecciones:

- La primera (del concepto 10000 al 15999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportarse la totalidad de "las operaciones", clasificadas en el apartado a que correspondan y conforme a su particular plazo. Lo anterior implica que en esta subsección no podrán omitirse operaciones, no obstante que conforme a la "CUB" sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 16000 al 19999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, y de lo señalado en la instrucción VII siguiente.

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en el inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB., que a la letra establece:

"Las operaciones iguales de naturaleza contraria se compensarán por el monto en que una cubra a la otra. Al efecto, las operaciones, o la parte de que se trate de éstas, deberán tratarse del mismo título o instrumento, tener igual plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB y estar referidas a un mismo subyacente. Adicionalmente, se podrán compensar cuando estén referidas al mismo subyacente y tengan el mismo plazo las operaciones siguientes:

a) Operaciones de futuros listadas en mercados estandarizados con operaciones de contratos adelantados realizadas en mercados extrabursátiles. Operaciones de swap listadas en mercados estandarizados con operaciones de swap realizadas en mercados extrabursátiles, y operaciones de paquetes de futuros y de contratos adelantados, comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con, indistintamente, otros de los referidos paquetes de futuros o paquetes de contratos adelantados o con operaciones de swap de tasas de

interés listadas en mercados estandarizados o con operaciones de swap de tasas de interés realizadas en mercados extrabursátiles.

b) Posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija que procedan de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés conforme a la fracción VI del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija procedentes de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés y con títulos de deuda de tasa de interés fija.

Para efecto de lo dispuesto en este numeral, las operaciones se entenderán como referidas a un mismo subyacente en los siguientes casos:

i. Operaciones sobre pesos y/o moneda extranjera, cuando dichas operaciones se encuentren denominadas en la misma divisa.

ii. Operaciones sobre tasas de interés, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a una misma tasa y a un mismo plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB.

iii. Operaciones sobre índices, acciones y/o canastas de acciones, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a un mismo índice, acción y/o canasta de acciones.

Se entenderá que las posiciones activas y pasivas descritas anteriormente en los incisos a), b) y c), así como en las operaciones de futuros, tienen un mismo plazo para efectos de compensación cuando:

1. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí más de un día y la que tenga el plazo menor sea de 1 a 30 días;

2. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de siete días y la que tenga el menor plazo se ubique entre 31 y 365 días; y

3. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 30 días y la que tenga el menor plazo se igual o mayor a 366 días.**"**

Cabe señalar que:

A) Se entenderá como mismo título o instrumento, cuando el activo y el pasivo sean de naturaleza semejante. Por ejemplo, no se considerarán como un mismo título o instrumento: CD's de la banca múltiple emitidos en México y los CD's de un banco extranjero; los CD's no negociables de un banco extranjero y los CD's si negociables del mismo banco extranjero; los CD's de un banco extranjero negociables en X país y los CD's del mismo banco extranjero no negociables en ese X país; los pesos a recibir por un reporto y los dólares a entregar por una compra de un título fecha valor 48 hrs., etc.

B) Dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo. Por ejemplo, son compensables:

Los Cetes en tenencia propia o a recibir por préstamo, por reporto o por compras fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas (activo), con los Cetes a entregar (pasivo) por reportos, préstamo o ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas; desde luego todos al mismo plazo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones, por ejemplo:

Suponiendo que se van a recibir 400 pesos de CETES por operaciones de reporto y se van a entregar 100 pesos de similares Cetes por un vencimiento de un préstamo de valores. Bajo este supuesto se compensan 100 de activo con 100 de pasivo, quedando una posición activa de 300 derivada de los CETES a recibir. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección, en Cetes a recibir por reporto 100 pesos y en Cetes a entregar por préstamo de valores 100 pesos.

Suponiendo las mismas operaciones anteriores y además 80 pesos de Cetes a entregar por reporto y 220 a entregar por ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, se compensan 400 de activo con 400 de pasivo, sin posición residual. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección en Cetes a recibir por reporto 400, Cetes a entregar por préstamo de valores 100, Cetes a entregar por reporto 80 y Cetes a entregar por ventas fecha valor 220.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza, por ejemplo: crédito bancario con pagaré bancario, Bondes con dinero o Bondes con Cetes o Bonos bancarios con pagaré bancario, etc.

VIII. OPERACIONES DE FUTURO, CONTRATOS ADELANTADOS Y OPCIONES

En las operaciones de futuro, contratos adelantados y opciones:

A) El subyacente, en todos los casos, se clasificará por las características de éste.

B) La parte de la operación relativa al "dinero", se clasificará en el RC01 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en pesos o en el RC03 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en UDIS o en el RC04 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en moneda extranjera.

C) Tratándose de la parte de la operación relativa al "dinero", respecto de operaciones sobre índices accionarios, se clasificará en el RC01 si se trata del IPC o de empresas residentes en México o en el RC04 si se trata de índices accionarios de empresas residentes en otros países, lo anterior siempre y cuando "el diferencial" a liquidar se determine exclusivamente en función del respectivo índice, en cuyo caso resulta indiferente la moneda de liquidación, por ejemplo un futuro del IPC que se liquide por "el diferencial" en pesos para efectos de riesgos de mercado es igual a uno que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación (en este último caso se "asegura" la convertibilidad mas no un tipo de cambio).

En el evento que el contrato de que se trate implique que el "importe a liquidar" se determine no sólo por "el diferencial" a favor o a cargo que resulte en función del índice de referencia, la Institución deberá enviar un comunicado al Banco de México, a la Subgerencia de Información de Requerimientos de Capitalización, en el que se indiquen las características de la operación de que se trate, a efecto que dicho Banco de México, resuelva sobre la clasificación de las "distintas operaciones" que se deriven de la transacción. Por ejemplo, un contrato adelantado del IPC que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre un tipo de cambio establecido desde la fecha de contratación de la transacción; en este caso la transacción podría "desdoblarse" como dos contratos adelantados: uno de IPC y otro de dólares.

IX. MONEDA DE LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

Continuando con algunas de las ideas de la instrucción anterior, debe tenerse presente que la "moneda de liquidación" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. El ejemplo más evidente son los UDIBONOS, cuyo riesgo está referido al INPC y a la "tasa real", no obstante que la "moneda de su liquidación" son pesos.

Otros ejemplos para ilustrar lo anterior son:

- ☐ Supóngase un swap: variación de IPC por tasa de UDIBONO, liquidable en pesos. En este caso, la parte de la operación relativa al IPC está sujeta a riesgo accionario (RC05) y la parte relativa al UDIBONTO está sujeta a riesgo de INPC y de "tasa real", (RC03); no obstante que la liquidación es en pesos, ninguna de sus partes está sujeta a riesgo de tasa nominal en pesos.
- ☐ Supóngase el swap anterior, con la variante que la liquidación será en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación. El riesgo y clasificación de este swap son exactamente iguales a los del anterior; no obstante que la "moneda de liquidación" son dólares, no existe riesgo de tipo de cambio ni de tasa de interés en dólares, y sólo se está "asegurando" la convertibilidad mas no un tipo de cambio.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse a valor razonable, conforme a los criterios establecidos por la Comisión. Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores) los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas.

XI. MONTO A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC01

La forma de determinar el "monto de referencia" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. Por ejemplo, supóngase un contrato adelantado (de compra o venta) de acciones de Telmex, con precio pactado en pesos, por el equivalente a 100 dólares, cuya diferencia del precio pactado y el observado, en pesos, combinado con el movimiento cambiario, se traducen en una entrega de más o menos acciones, de tal forma que siempre se liquidan 100 dólares. Esta operación sólo está expuesta a riesgo

de tasa de interés nominal en pesos y a riesgo accionario; el hecho de que el monto de la operación esté referido a dólares y la moneda de liquidación también sean dólares, no implica que la misma esté expuesta a riesgo de tipo de cambio o de tasa de interés en dólares. Para efectos de reporte, las partes de la operación, durante su vigencia, tendrían que reportarse: el dinero (RC01) por el importe en pesos equivalente a 100 dólares al tipo de cambio que corresponda, y la posición accionaria (RC05) por el importe en pesos que resulte de multiplicar el precio de mercado (de la acción) del día último del mes de que se trate por el número de acciones que dado el precio de ejercicio y el tipo de cambio del peso frente al dólar futuro observado se derivarían de los 100 dólares.

USO LIMITADO

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC01

I.- Conceptos relativos a activos brutos.

Concepto 10050: Depósitos bancarios a la vista

En este concepto deben incluirse las disponibilidades distintas de depósitos bancarios a plazo. A discreción de la Institución, en este concepto podrá incluirse el saldo de caja.

Conceptos 10100 – 10126: Depósitos bancarios a plazo

En estos conceptos deben incluirse, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. Asimismo, deben incluirse los depósitos a plazo en Banco de México. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor razonable (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Conceptos 10150 – 10176: Cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los préstamos y créditos concedidos: cartera de crédito vigente o en etapa 1 y 2 así como vencida o en etapa 3; operaciones de arrendamiento financiero; préstamos al personal; la cartera de créditos comprada a descuento, sin responsabilidad del cedente; el financiamiento otorgado a intermediarios financieros relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, etc. Incluye, en su caso, el refinanciamiento o capitalización de intereses.

En estos conceptos no debe incluirse la cartera de créditos cedida en descuento por la Institución, con responsabilidad de la Institución, ya que tal cartera debe incluirse en los conceptos 10180 a 10193.

En el caso del financiamiento otorgado a intermediarios financieros, relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento otorgado a tales intermediarios, independientemente de las características de los créditos objeto del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 10180 – 10193: Cartera de créditos cedida en descuento

En estos conceptos debe reportarse la cartera de créditos cedida en descuento por la Institución, con responsabilidad de la Institución.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de las operaciones se considerarán las características de los créditos cedidos en descuento por la Institución,

independientemente de las características del financiamiento recibido por la Institución a través del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la Institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 a y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Concepto 10195: Moneda nacional a recibir por ventas fecha-valor de divisas
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por operaciones fecha-valor de venta de cualquier divisa.

Concepto 10200 - 10202: Moneda nacional a recibir por venta de valores fecha valor
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir, por ventas de valores (títulos de deuda) fecha-valor pendientes de liquidar. Según lo señalado en el artículo 101 de la circular 3/2012.

Concepto 11771 - 11772: Moneda nacional a recibir por venta de acciones, títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha-valor
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir, por ventas de acciones, de títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha valor pendientes de liquidar.

Concepto 11774: Moneda nacional a recibir por venta al contado de mercancías
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por venta al contado de mercancías

Concepto 10250: Moneda nacional a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportado
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir, por reportos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como reportado (incluye el dinero a recibir por reportos sobre títulos de deuda y/o acciones).

Conceptos 10300 – 10326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10350 – 10376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe

corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10400 – 10426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10450-10476: Tenencia de títulos

En estos conceptos debe incluirse el valor razonable de la tenencia de títulos de deuda (incluyendo los "Cetes especiales" y los títulos emitidos por el FOBAPROA o el IPAB) que estén vigentes a la fecha de que se trate.

En estos conceptos no debe incluirse:

a) La tenencia de títulos emitidos por la propia Institución.
b) La tenencia de títulos de deuda subordinados (la cual debe informarse en la sección "RC09").
c) La tenencia de títulos (o notas) estructurados (la cual debe informarse en los conceptos 11290 a 11316).
d) La tenencia de títulos de deuda con vinculación crediticia (la cual debe informarse en los conceptos 11350 a 11376).
e) Las tenencias de títulos de bursatilización de activos que se resten al determinar el capital neto (la cual debe informarse en la sección "RC09").

Conceptos 10500 – 10526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 11290 a 11316.

Concepto 10550 - 10576: Moneda nacional a recibir por reportos de valores, actuando como reportador

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a recibir, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 10600 – 10626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10630 – 10656: "Forwards" de compra de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 10660 – 10686: "Forwards" de venta de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 10690 – 10716: Futuros de compra de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 10720 – 10746: Futuros de venta de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 10750 – 10776: "Forwards" de venta de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por contratos adelantados de venta de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por contratos adelantados de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 10780 – 10806: Futuros de venta de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por futuros de venta de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a recibir por futuros de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 11776 – 11789: "Forwards" de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de contratos adelantados de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 11791 – 11804: "Forwards" de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de contratos adelantados de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 11806 – 11819: "Forwards" de compra de otros subyacentes -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional, (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 10821 – 10834: "Forwards" de venta de otros subyacentes -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente (por ejemplo, títulos de deuda).

Conceptos 11836 – 11849: Futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 11851 – 11864: Futuros de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de futuros de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 11866 – 11879: Futuros de compra de otros subyacentes -fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Conceptos 11881 – 11894: Futuros de venta de otros subyacentes - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de futuros de venta de cualquier subyacente.

Conceptos 10930 – 10956: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés nominal - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés nominal fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 10960 – 10986: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés nominal - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés nominal variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 10990 – 11016: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés nominal fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 11020 – 11046: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés nominal variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 11896 – 11909: "Swaps" relativos a acciones, canastas accionarias, e índices accionarios – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a acciones, canastas accionarias e índices accionarios.

Conceptos 11911 – 11924: "Swaps" relativos a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 11926 – 11939: "Swaps" relativos a otros subyacentes – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a otros subyacentes.

Conceptos 11080 – 11106: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés nominal fija – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés nominal fija.

Conceptos 11110 – 11136: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés nominal variable – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés nominal variable.

Conceptos 11140 – 11166: Emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal tipo "CAP". – fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11170 – 11196: Emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal tipo "FLOOR".

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11200 – 11226: Emisión de opciones de compra de divisas. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda nacional a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones

Conceptos 11941 – 11954: Emisión de opciones y warrants de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11956 – 11969: Emisión de opciones y warrants de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11971 – 11984: Emisión de opciones y warrants de compra de otros subyacentes. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre otros subyacentes.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11986– 11999: Emisión de opciones y warrants de venta de otros subyacentes. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de las opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11290– 11316: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la Institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluirse la tenencia de títulos o notas estructuradas emitidas por otras instituciones.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 11320– 11346: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte activa de los mismos.

Conceptos 11350– 11376: Tenencia de títulos con vinculación crediticia
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la tenencia de títulos de deuda, por la adquisición de títulos con vinculación crediticia, a que se refiere el segundo párrafo de la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 11440– 11466: Futuros de compra de bonos a tasa fija - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra de bonos a tasa fija denominados en moneda nacional.

Conceptos 11470– 11496: Futuros de venta de bonos a tasa fija - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de futuros de venta de bonos a tasa fija.

Conceptos 12001– 12014: Futuros de compra de títulos de deuda, excepto de bonos - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra títulos de deuda denominados en moneda nacional, excepto de bonos.

Conceptos 12016– 12029: Futuros de venta de títulos de deuda, excepto de bonos - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de futuros de venta de títulos de deuda a tasa fija, excepto de bonos.

Conceptos 12031 – 12044: "Forwards" de compra de bonos a tasa fija -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de bonos

Conceptos 12046 – 12059: "Forwards" de venta de bonos a tasa fija -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de contratos adelantados de venta de bonos.

Conceptos 12061 – 12074: "Forwards" de compra de títulos de deuda, excepto de bonos -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de títulos de deuda, excepto de bonos.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 12076 – 12089: "Forwards" de venta de títulos de deuda, excepto de bonos -fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de contratos adelantados de venta de títulos de deuda, excepto de bonos.

Conceptos 11500– 11526: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal tipo "FLOOR" - fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 11530– 11556: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal tipo "CAP" - fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 11560– 11586: Tenencia de opciones de venta de divisas- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda nacional a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12091– 12104: Tenencia de opciones y warrants de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12106– 12119: Tenencia de opciones sobre futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12121– 12134: Tenencia de opciones y warrants de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12136– 12149: Tenencia de opciones y warrants de venta de otros subyacentes - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a recibir por opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12151– 12164: Tenencia de opciones y warrants de compra de otros subyacentes - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de las opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 11650– 11676: Emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de compra tipo "CAP"- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés nominal variable.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11680– 11706: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de compra tipo "CAP"- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés nominal fija.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 11710– 11736: Emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR"- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés nominal fija.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 11740– 11766: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR"- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés nominal variable.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 12800– 12826: Otros financiamientos otorgados y demás operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional

En estos conceptos deben incluirse, entre otras, las operaciones conocidas como "call money" otorgadas a otros bancos, tanto residentes en México como en otros países.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

Conceptos 13050 – 13076: Depósitos a la vista con tasa de interés menor o igual al 50% de la tasa primaria de Cetes a 28 días

En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal y, en su caso, intereses devengados no pagados) de los depósitos a la vista, sin interés y con tasa de interés menor o igual al 50% de la tasa de rendimiento en colocación primaria (promedio del mes de que se trate) de los CETES a plazo de 28 días. Estos depósitos deben clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A numeral 1.1 de la CUB.

Conceptos 13100 – 13126: Depósitos a la vista con tasa de interés mayor al 50% de la tasa primaria de Cetes a 28 días

En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal e intereses devengados no pagados) de los depósitos a la vista con tasa de interés mayor al 50% de la tasa de rendimiento en colocación primaria (promedio del mes de que se trate) de los CETES a plazo de 28 días. Estos depósitos deben clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A numeral 1.1 de la CUB.

Conceptos 13150 – 13176: Depósitos de ahorro y en cuenta corriente con tasa de interés menor o igual al 50% de la tasa primaria de Cetes a 28 días

En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal y, en su caso, intereses devengados no pagados) de los depósitos de ahorro y en cuenta corriente, sin interés y con tasa de interés menor o igual al 50% de la tasa de rendimiento en colocación primaria (promedio del mes de que se trate) de los CETES a plazo de 28 días. Estos

depósitos deben clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A numeral 1.1 de la CUB.

Conceptos 13200 – 13226: Depósitos de ahorro y en cuenta corriente con tasa de interés mayor al 50% de la tasa primaria de Cetes a 28 días

En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal y, en su caso, intereses devengados no pagados) de los depósitos de ahorro y en cuenta corriente con tasa de interés mayor al 50% de la tasa de rendimiento en colocación primaria (promedio del mes de que se trate) de los CETES a plazo de 28 días. Estos depósitos deben clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A numeral 1.1 de la CUB.

Concepto 13240: Moneda nacional a entregar por compras fecha-valor de divisas

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por operaciones fecha-valor de compra de cualquier divisa.

Concepto 14921 - 14922: Moneda nacional a entregar por compra de acciones, títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha-valor

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar, por compra de acciones, de títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha valor pendientes de liquidar.

Concepto 14924: Moneda nacional a entregar por compra al contado de mercancías

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por compra al contado de mercancías

Conceptos 13250 – 13276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluirse los instrumentos de captación a plazo (certificados de depósito, pagarés, bonos bancarios, depósitos retirables en días preestablecidos, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, certificados bursátiles bancarios, etc.) a cargo de la Institución, con excepción de los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia Institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor razonable (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 13380 – 13396: Préstamos interbancarios recibidos por operaciones de cesión de cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los financiamientos recibidos correspondientes a operaciones de cesión de cartera de créditos por parte de la Institución, en descuento (con responsabilidad de la Institución).

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento recibido por la Institución a través del descuento, independientemente de las características de los créditos objeto de descuento.

Concepto 13400: Moneda nacional a entregar por compras fecha-valor de valores

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar, por compras de valores (títulos de deuda o acciones) fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. Según lo señalado en el artículo 101 de la circular 3/2012.

Concepto 13450: Moneda nacional a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportador

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar, por reportos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como reportador (incluye el dinero a entregar por reportos sobre títulos de deuda y/o acciones)

Conceptos 13500– 13526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 14440 a 14466.

Conceptos 13550– 13576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 14440 a 14466.

Conceptos 13600 – 13626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado. El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor razonable

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 14440 a 14466.

Conceptos 13650 – 13676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 14440 a 14466.

Conceptos 13700 – 13726: Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 14440 a 14466.

Concepto 13750 - 13776: Moneda nacional a entregar por reportos de valores, actuando como reportado

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda nacional a entregar, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 13780 – 13806: "Forwards" de compra de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 13810 – 13836: "Forwards" de venta de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 13840 – 13866: Futuros de compra de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 13870 – 13896: Futuros de venta de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 13900 – 13926: "Forwards" de compra de divisas -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por contratos adelantados de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por contratos adelantados de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 13930 – 13956: Futuros de compra de divisas -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda nacional a entregar por futuros de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 14926 – 14939: "Forwards" de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar por contratos adelantados de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios

Conceptos 14941 – 14954: "Forwards" de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de contratos adelantados de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 14956 – 14969: "Forwards" de compra de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de contratos adelantados de compra de cualquier otro subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Conceptos 14971 – 14984: "Forwards" de venta de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Conceptos 14986 – 14999: Futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 14020 – 14046: Futuros de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de futuros de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 15016 – 15029: Futuros de compra de otros subyacentes -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de futuros de compra de cualquier subyacente.

Conceptos 15031 – 15044: Futuros de venta de otros subyacentes -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de otro subyacente.

Conceptos 14080 – 14106: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés nominal - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés nominal variable en moneda nacional, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 14110 – 14136: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés nominal - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés nominal fija en moneda nacional, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 14140 – 14166: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés nominal variable en moneda nacional, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 14170 – 14196: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés nominal fija en moneda nacional, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 15046 – 15059: "Swaps" relativos a acciones, canastas accionarias, e índices accionarios –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entreguen acciones, canastas accionarias e índices accionarios.

Conceptos 15061 – 15074: "Swaps" relativos a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entreguen mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 15075 – 15089: "Swaps" relativos a otros subyacentes–fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entregue cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional.

Conceptos 14230 – 14256: "Swaps" en las que se entregue una tasa de interés nominal fija – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés nominal fija.

Conceptos 14260 – 14286: "Swaps" en las que se entregue una tasa de interés nominal variable – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés nominal variable.

Conceptos 14290 – 14316: Emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal tipo "CAP". – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 14320 – 14346: Emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal tipo "FLOOR". – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 14350 – 14376: Emisión de opciones de venta de divisas – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda nacional a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 15091– 15104: Emisión de opciones y warrants de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a entregar por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 15106– 15119: Emisión de opciones y warrants de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a entregar por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 15121 – 15134: Emisión de opciones y warrants de compra de otros subyacentes – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riego de mercado por tasa en moneda nacional.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones

Conceptos 15136– 15149: Emisión de opciones y warrants de venta de otros subyacentes – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a entregar por opciones sobre otros subyacentes.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 14440– 14466: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la Institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluirse los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia Institución.

Conceptos 14470– 14496: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 14500– 14526: Emisión de títulos propios con vinculación crediticia
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la emisión propia de títulos de deuda con vinculación crediticia, a que se refiere el primer párrafo de la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 14590– 14616: Futuros de compra de bonos a tasa fija - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de compra de bonos a tasa fija denominados en moneda nacional.

Conceptos 14620– 14646: Futuros de venta de bonos a tasa fija - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de futuros de venta de bonos a tasa fija.

Conceptos 15151– 15164: Futuros de compra de títulos de deuda, excepto de bonos - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de futuros de compra títulos de deuda denominados en moneda nacional, excepto de bonos.

Conceptos 15166– 15179: Futuros de venta de títulos de deuda, excepto de bonos - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de títulos de deuda a tasa fija, excepto de bonos.

Conceptos 15181 – 15194: "Forwards" de compra de bonos a tasa fija -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de contratos adelantados de compra de bonos.

Conceptos 15196 – 15209: "Forwards" de venta de bonos a tasa fija -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de contratos adelantados de venta de bonos.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 15211 – 15224: "Forwards" de compra de títulos de deuda, excepto de bonos -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a entregar de contratos adelantados de compra de títulos de deuda, excepto de bonos.

Conceptos 15226 – 15239: "Forwards" de venta de títulos de deuda, excepto de bonos -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar a entregar de contratos adelantados de venta de títulos de deuda, excepto de bonos.

Conceptos 14650– 14676: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal tipo "FLOOR" - fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14680– 14706: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal tipo "CAP" - fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14710– 14736: Tenencia de opciones de compra de divisas- fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda nacional a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la Institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15241– 15254: Tenencia de opciones y warrants de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15256– 15269: Tenencia de opciones sobre futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones sobre futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15271– 15284: Tenencia de opciones y warrants de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15286– 15299: Tenencia de opciones y warrants de venta de otros subyacentes - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riego de mercado por tasa en moneda nacional.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15301– 15314: Tenencia de opciones y warrants de compra de otros subyacentes - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda nacional) a entregar por opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14800– 14826: Emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de compra tipo "CAP"- fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés nominal fija en moneda nacional.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 14830– 14856: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal, distintas a las opciones tipo "CAP"- fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las

opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés nominal variable en moneda nacional.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14860– 14886: Emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR"- fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés nominal variable en moneda nacional.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 14890– 14916: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR"- fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés nominal fija en moneda nacional.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 15800 – 15826: Otros financiamientos recibidos y demás operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional

En estos conceptos deben incluirse, entre otras, las operaciones conocidas como "call money" otorgadas a otros bancos, tanto residentes en México como en otros países.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 02

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC02 RELATIVA A OPERACIONES CON RIESGO DE MERCADO POR "SOBRETASA", CON TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL Y CUYA TASA DE RENDIMIENTO ESTÉ INTEGRADA POR UNA SOBRETASA Y UNA TASA REVISABLE

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC02

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de mercado por "sobretasa" en moneda nacional, en las operaciones de: tenencia incluidos los otorgados en garantía sin transferencia de propiedad, compras-ventas fecha valor, reportos, préstamos de valores, valores en garantía (con transferencia de propiedad), denominados en moneda nacional y cuya tasa de rendimiento se componga de una sobretasa y una tasa revisable, esta última referida a alguna tasa de interés nominal en moneda nacional, en los que contractualmente la Institución que recibe u otorga la garantía mantenga el derecho de conservar los flujos de efectivo generados por dichos valores objeto de la garantía, o las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en su precioy otras operaciones, con títulos de deuda denominados en moneda nacional y cuya tasa de rendimiento se integre por una "sobretasa" y una tasa revisable.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC02

La sección RC02 está conformada por los conceptos 20000 al 29999, con dos columnas en donde deberá reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la institución con riesgo de mercado por "sobretasa" en moneda nacional, tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Operaciones con riesgo de mercado por "sobretasa" en moneda nacional -por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, operaciones con riesgo de mercado por "sobretasa" en moneda nacional -por su inversión, que no corresponda al patrimonio fijo, en fondos de inversión y otras figuras similares, bajo cualquier modalidad de participación, derivadas de la cartera de títulos integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos

fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

La columna 2 deberá reportarse considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, con tasa de interés revisable en moneda nacional, que formen parte del portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma ("CUB" Fracción IX del Art. 2 Bis 100 de la CUB)

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC02

En esta sección se solicita la sumatoria de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos, en su caso, deberán realizarse operación por operación.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la "CUB", cada operación está compuesta por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos; otro ejemplo, las operaciones de reporto, actuando como reportador, se considerarán como dos operaciones simultáneas: la cantidad de dinero a recibir computará como un activo, y los títulos a entregar como un pasivo; otro ejemplo, las operaciones de futuro de compra de dólares liquidables en moneda nacional computarán como dos operaciones simultáneas: los dólares a recibir como un activo y los pesos a entregar como un pasivo. En tales circunstancias en lo sucesivo cuando se haga referencia a las "operaciones", en singular o plural, se podrá estar hablando de alguna de las partes de una operación o de una operación como un todo, según sea el caso.

Cada parte de las operaciones debe informarse en aquella sección a que corresponda. En particular, en esta sección debe incluirse exclusivamente la parte relativa a títulos de deuda en moneda nacional, registrados en el Registro Nacional de Valores, y cuya tasa de rendimiento se integre por una "sobretasa" y una tasa revisable. No debe incluirse la parte relativa al dinero, en operaciones tales como: compras-ventas fecha valor y reportos.

V. PLAZO DE LAS OPERACIONES

En todos los casos, el "plazo" inicia el último día del mes de que se trate (mes a que corresponda el reporte), sin importar la fecha de colocación, el tipo de operación o la tasa de referencia, y termina en la fecha de vencimiento del título de que se trate.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC02

Considerando el procedimiento establecido en las "CUB", para determinar la exposición a riesgo de mercado y el respectivo requerimiento de capital, esta sección está constituida por dos subsecciones:

- La primera (del concepto 20000 al 25999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportarse la totalidad de "las operaciones", clasificadas en el apartado a que correspondan y conforme a su particular plazo. Lo anterior implica que en esta subsección no podrán omitirse operaciones, no obstante que conforme a las "CUB" sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 26000 al 29999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, y de lo señalado en la instrucción VII siguiente.

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en el inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, que a la letra establece:

"Las operaciones iguales de naturaleza contraria se compensarán por el monto en que una cubra a la otra. Al efecto, las operaciones, o la parte de que se trate de éstas, deberán tratarse del mismo título o instrumento, tener igual plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB y estar referidas a un mismo subyacente."

Cabe señalar que:

A) Se entenderá como mismo título, cuando el activo y el pasivo tengan la misma "clave de emisión"; es decir, que los títulos en cuestión sean idénticos en cuanto a tipo de instrumento, entidad emisora, fecha de vencimiento, tipo de cupón y fecha de revisión del cupón.

B) Dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo. Por ejemplo, son compensables:

Los Bondes en tenencia propia o a recibir por préstamo, por reporto o por compras fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas (activo), con los Bondes a entregar (pasivo) por reportos, préstamo o ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas; desde luego todos al mismo plazo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones, por ejemplo:

Suponiendo que se van a recibir 400 pesos de Bondes por operaciones de reporto y se van a entregar 100 pesos de Bondes con la misma "clave de emisión" por un vencimiento de un préstamo de valores. Bajo este supuesto se compensan 100 de

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

activo con 100 de pasivo, quedando una posición activa de 300 derivada de los Bondes a recibir. En la primera subsección se reportarán cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección, en Bondes a recibir por reporto 100 pesos y en Bondes a entregar por préstamo de valores 100 pesos.

Suponiendo las mismas operaciones anteriores y además 80 pesos de Bondes a entregar por reporto y 220 a entregar por ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, se compensan 400 de activo con 400 de pasivo, sin posición residual. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección en Bondes a recibir por reporto 400, Bondes a entregar por préstamo de valores 100, Bondes a entregar por reporto 80 y Bondes a entregar por ventas fecha valor 220.

VIII. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o la parte correspondiente de las mismas, según se trate, deberán informarse a valor razonable conforme a los criterios establecidos por la Comisión.

Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores) los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas.

IX. COBERTURA DEL FORMULARIO

En esta sección deberán incluirse los títulos de deuda inscritos en el Registro Nacional de Valores, que se encuentren denominados en moneda nacional y cuya tasa de rendimiento se componga de una sobretasa y una tasa revisable, esta última referida a alguna tasa de interés nomina en moneda nacional.

Cabe señalar que la parte relativa a los títulos de deuda indicados en el párrafo anterior debe informarse tanto en la sección RC01, como en la presente sección RC02.

En esta sección NO deberán incluirse:

a) Títulos con tasa de interés fija.
b) Títulos emitidos por la propia Institución.
c) Títulos de deuda subordinados.
d) Títulos (o notas) estructurados.
e) Títulos de deuda con vinculación crediticia.
f) Cetes especiales y/o "Pagarés del Nuevo Programa a cargo del Fondo de Protección al Ahorro (FOBAPROA) o posteriormente a cargo del Instituto de Protección al Ahorro Bancario (IPAB) exclusivamente aquellos que fueron emitidos para dicho programa.

X INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC02

Conceptos 20300 – 20326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate

Conceptos 20350 – 20376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestatario.

Conceptos 20400 – 20426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

Conceptos 20500 – 20526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamistas vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 20600 – 20626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

Conceptos 23500– 23526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate.

Conceptos 23550– 23576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestamista.

Conceptos 23600 – 23626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

Conceptos 23650 – 23676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario, vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 23700 – 23726: Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

USO LIMITADO

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 03

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC03 RELATIVA A LAS OPERACIONES CON RIESGO DE MERCADO POR TASA DE INTERÉS REAL EN UDIS, UMA Y EN MONEDA NACIONAL

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC03

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de mercado por INPC y por tasa de interés real, en operaciones en UDIS y UMA así como en operaciones con tasa de interés real en moneda nacional (ambas operaciones que en lo sucesivo, individual o conjuntamente, se les denominará como operaciones con tasa real), de: depósitos a plazo; tenencia incluidos los otorgados en garantía sin transferencia de propiedad, compras y ventas, de títulos; reportos; préstamos de valores; futuros y contratos adelantados; intercambio de flujos de dinero (swap); créditos; redescuento de cartera, bienes en garantía (con transferencia de propiedad) denominados en moneda nacional, en UDIS o UMAS, y cuyo rendimiento esté referido a tasas de interés reales o la variación de las UMAS, en los que contractualmente la Institución que recibe u otorga la garantía mantenga el derecho de conservar los flujos de efectivo generados por dichos bienes objeto de la garantía, o las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en su precio y otras operaciones.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC03

La sección RC03 está conformada por los conceptos 30000 al 39999, con dos columnas en donde deberá reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la Institución con riesgo de mercado por tasa de interés real, tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés real -por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés real -por su inversión, que no corresponda al patrimonio fijo, en fondos de inversión, bajo cualquier modalidad de participación, derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

La columna 2 deberá reportarse considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, que formen parte del portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (Fracción IX del Art. 2 Bis 100 de la CUB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC03

En esta sección se solicita la sumatoria de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos, en su caso, deberán realizarse operación por operación.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos. Al efecto los importes denominados en UDIS deberán valorizarse en pesos utilizando el valor en pesos de la UDI del día último del mes, y los denominados en UMAS.

(Unidad de Medida y Actualización), tal como sea modificado o adicionado de tiempo en tiempo.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la "CUB" o Disposiciones, cada operación está compuesta por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos; otro ejemplo, las operaciones de reporto, actuando como reportador, se considerarán como dos operaciones simultáneas: la cantidad de dinero a recibir computará como un activo, y los títulos a entregar como un pasivo; otro ejemplo, las operaciones de futuro de compra de INPC computarán como dos operaciones simultáneas: el INPC a recibir como un activo y los pesos a entregar como un pasivo. En tales circunstancias en lo sucesivo cuando se haga referencia a "las operaciones", en singular o plural, se podrá estar hablando de alguna de las partes de una operación o de una operación como un todo, según sea el caso.

Cada parte de las operaciones debe informarse en aquella sección a que corresponda.

Cabe señalar que hay operaciones cuyas partes están sujetas al mismo riesgo de mercado, por ejemplo, un reporto de UDIBONOS, con precio en UDIS o UMA y premio a tasa real: tanto el título como el dinero se informarán en la sección RC03. Sin embargo, hay diversas operaciones cuyas partes NO están sujetas al mismo riesgo de mercado, por lo tanto, cada una de tales partes tendrá que informarse en la respectiva sección, RC01 a RC05 y RC11; por ejemplo, en una compra de acciones liquidable en pesos fecha valor 48 hrs.: las acciones tendrán que informarse en la RC05 y el dinero a liquidar en el RC01.

Para identificar a qué sección pertenece una operación debe tenerse presente lo siguiente:

- Los títulos e instrumentos, sin excepción, se clasificarán por las características del título o instrumento, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características "del dinero" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

TIPO DE TÍTULO	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
CETE en tenencia	RC01
CETE a recibir por compras valor 24 horas.	RC01
Acciones en tenencia	RC05
Acciones a recibir por futuros o préstamo	RC05
Acciones a entregar por ventas 48 horas.	RC05
Títulos de deuda con tasa referida a la variación en el precio de una acción.	RC05
UDIBONOS en reporto con premio a tasa real	RC03
Pagarés bancarios en M.N.	RC01
Pagarés bancarios en UDIS	RC03
CD's bancarios en dólares	RC04
Bondes en reporto con premio a tasa fija	RC01
UDIBONOS a recibir por compras 24 horas	RC03
Créditos a tasa CCP + X	RC01
Créditos a tasa TIIE * Y	RC01
Créditos a tasa fija en M.N.	RC01
Créditos en UDIS	RC03
Créditos a tasa real	RC03
Créditos a tasa CCP-UDIS	RC03
Créditos en moneda extranjera	RC04
Créditos en moneda nacional con tasa de interés referida al SMG	RC11

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Como puede observarse en los ejemplos anteriores la clasificación de los títulos o instrumentos deriva de sus propias características, sin que importen, en su caso, las características de "las operaciones asociadas".

- "El dinero", sin excepción, siempre se clasificará por las características del dinero sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características del "título o instrumento" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

DINERO A RECIBIR O A ENTREGAR	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
Por reportos en M.N. a tasa nominal, de CETES	RC01
Por compras de CETES valor 24 horas	RC01
Por compras de UDIBONOS valor 48 horas	RC01
Por futuros de dólares (dólares a recibir o a entregar)	RC04
Por futuros de dólares (pesos a recibir o a entregar)	RC01
M.N. por opciones de acciones	RC01

V. PLAZO DE LAS OPERACIONES

Deberá determinarse el plazo particular de cada una de las partes de las operaciones. Para ello se procederá en los mismos términos de lo señalado en la instrucción anterior:

- El plazo de los títulos o instrumentos, sin excepción, se determinará según las características de los títulos o instrumentos, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar las características (plazo) del dinero involucrado en la operación, y
- El plazo del dinero se determinará según las características del dinero, sin importar las características del título o instrumento involucrado en la operación.

"El plazo" de cada operación será equivalente al número de días que se determine (según lo señalado en el Art. 2 Bis 102 de la CUB) conforme a lo siguiente:

A) En todos los casos (tasa fija y revisable, para cualquier esquema de amortización), "el plazo" de las operaciones (dinero y títulos) inicia el último día del mes de que se trate (mes a que corresponda el reporte), sin importar la fecha de emisión, otorgamiento o contratación, según sea el caso, el tipo de operación o el tipo de tasa. Por ejemplo, para el reporte relativo a junio, "el plazo" de todas las operaciones que enseguida se señalan inicia el 30 de junio:

Pagaré emitido el 28 de diciembre, con vencimiento al 15 de noviembre.

Dinero a recibir por un reporto contratado el 30 de junio con vencimiento el 2 de enero.

Crédito a tasa ajustable al final del mes, otorgado el 7 de febrero con vencimiento el 6 de febrero.

En los ejemplos anteriores, si el reporte fuera de octubre, el inicio de todas las operaciones sería el 31 de octubre.

B) En cuanto a operaciones a tasa real fija y con amortización total al vencimiento, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina al vencimiento de la operación. Ejemplos de operaciones (dinero o títulos) a tasa real fija son:

- Udibonos; Pagarés bancarios en UDIS con rendimiento liquidable al vencimiento; Dinero a recibir o a entregar por reportos con premio a tasa real fija, por futuros y opciones liquidables en UDIS, etc.; Créditos a tasa real fija, etc.

En todos estos casos el plazo termina al vencimiento del título, del crédito o del dinero, según se trate.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con pago de intereses periódicos y/o con amortizaciones periódicas del principal, el plazo en días será el equivalente a la "Duración" del instrumento, calculada conforme a la fórmula indicada en el Anexo 1-N de la CUB.

D) Respecto a operaciones con tasa de interés revisable o cuyo rendimiento esté referido a alguna tasa de interés real, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina en la fecha de revisión o de ajuste de la tasa o, en su caso, la de vencimiento de la operación (o parte de la operación) cuando ya no vaya a haber más revisiones o ajustes de tasa. Ejemplos de operaciones con tasa real ajustable (referidas a otra tasa de una fecha y/o plazo y/o período específico, que aplica a lapsos determinados) son:

- Udibonos; Certificados de depósito, bonos bancarios, obligaciones subordinadas, etc., con tasa real ajustable; Préstamos y créditos con tasa real ajustable; Dinero a recibir o a entregar por reportos cuyo premio se haya pactado con tasa de interés real ajustable, etc.

En todos estos ejemplos "el plazo" termina en la fecha de ajuste de tasa del título o crédito o dinero.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, o del crédito o del instrumento, es independiente a la fecha de su vencimiento y a la fecha de pago de los intereses; en algunos casos pueden coincidir, en otros no.

Para ilustrar lo anterior, a continuación, se dan algunos ejemplos de operaciones que tienen el mismo "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa), al margen de que son distintos sus vencimientos y sus fechas de pago de intereses, y de operaciones que tienen distinto "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa) al margen de que tienen igual fecha de vencimiento y de pago de intereses:

Ejemplos de operaciones al mismo plazo

- Depósito a plazo de 3 años, con tasa real ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada 3 meses.

- Crédito a 1 año, con tasa real ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada mes.
- Bono a 10 años, con tasa real ajustable el día último de cada mes y con intereses capitalizables cada mes.

Las tres operaciones anteriores, durante su vigencia, para efectos del cómputo de capitalización tienen el mismo plazo: un mes.

Ejemplos de operaciones con distinto plazo

- Crédito a 1 año, con tasa real ajustable cada mes y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa real ajustable cada dos meses y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa real ajustable el sexto mes y con pago de intereses el día último de cada mes.

Las tres operaciones anteriores para efectos del cómputo de capitalización tienen distinto plazo:

- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente, suponiendo que se hubieran otorgado el día último del mes X;
- 1 mes, 1 mes y 5 meses, respectivamente, en el mes X+1;
- 1 mes, 2 meses y 4 meses, respectivamente, en el mes X+2;
- 1 mes, 1 mes y 3 meses, respectivamente en el mes X+3;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+5;
- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente en el mes X+6;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+11.

Lo señalado en los incisos anteriores podría resumirse de la siguiente manera: "el plazo" serán los días que van del último día del mes de que se trate (mes del reporte) al día en que los correspondientes recursos (operación activa u operación pasiva) van a ser objeto de una repreciación (nueva tasa), lo cual ocurre:

- Al vencimiento si la operación es a tasa fija sin pago de cupones (ni intereses ni principal), ya que los recursos al vencimiento se destinan a otra operación,
- Al plazo resultante de aplicar la fórmula de la "Duración" si la operación es a tasa fija con pagos parciales de intereses y/o de principal, ya que los recursos se destinarán a otra operación, en promedio, al plazo que se obtenga de la fórmula de la Duración, y
- A la fecha de revisión o ajuste de la tasa si la operación se pactó con tales características, en este caso aunque los recursos sigan destinados a la misma operación a partir de dicha fecha de revisión o ajuste tienen una tasa (precio) distinta.

En cuadro denominado "plazo de las operaciones", se señalan las partes de que están constituidas diversas operaciones y la forma de determinar su plazo.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC03

Considerando el procedimiento establecido en la "CUB" para determinar la exposición a riesgo de mercado y el respectivo requerimiento de capital, esta sección está constituida por dos subsecciones:

- La primera (del concepto 30000 al 35999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportarse la totalidad de "las operaciones", clasificadas en el apartado a que correspondan y conforme a su particular plazo. Lo anterior implica que en esta subsección no podrán omitirse operaciones, no obstante que conforme a la "CUB" sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 36000 al 39999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, y de lo señalado en la instrucción VII siguiente.

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en el inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB que a la letra establece:

"Las operaciones iguales de naturaleza contraria se compensarán por el monto en que una cubra a la otra. Al efecto, las operaciones, o la parte de que se trate de éstas, deberán tratarse del mismo título o instrumento, tener igual plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB y estar referidas a un mismo subyacente. Adicionalmente, se podrán compensar cuando estén referidas al mismo subyacente y tengan el mismo plazo las operaciones siguientes:

a) Operaciones de futuros listadas en mercados estandarizados con operaciones de contratos adelantados realizadas en mercados extrabursátiles. Operaciones de swap listadas en mercados estandarizados con operaciones de swap realizadas en mercados extrabursátiles, y operaciones de paquetes de futuros y de contratos adelantados, comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con, indistintamente, otros de los referidos paquetes de futuros o paquetes de contratos adelantados o con operaciones de swap de tasas de interés listadas en mercados estandarizados o con operaciones de swap de tasas de interés realizadas en mercados extrabursátiles.

b) Posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija que procedan de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés conforme a la fracción VI del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB con posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija procedentes de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés y con títulos de deuda de tasa de interés fija.

Para efecto de lo dispuesto en este numeral, las operaciones se entenderán como referidas a un mismo subyacente en los siguientes casos:

i. Operaciones sobre pesos y/o moneda extranjera, cuando dichas operaciones se encuentren denominadas en la misma divisa.

ii. Operaciones sobre tasas de interés, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a una misma tasa y a un mismo plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB.

iii. Operaciones sobre índices, acciones y/o canastas de acciones, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a un mismo índice, acción y/o canasta de acciones.

Se entenderá que las posiciones activas y pasivas descritas anteriormente en los incisos a), b) y c), así como en las operaciones de futuros, tienen un mismo plazo para efectos de compensación cuando:

1. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí más de un día y la que tenga el plazo menor sea de 1 a 30 días;

2. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 7 días y la que tenga el menor plazo se ubique entre 31 y 365 días; y

3. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 30 días y las que tenga el menor plazo se igual o mayor a 366 días.

Cabe señalar que:

A) Se entenderá como mismo título o instrumento, cuando el activo y el pasivo sean de naturaleza semejante. Por ejemplo, no se considerarán como un mismo título o instrumento: CD's de la banca múltiple emitidos en México y los CD's de un banco extranjero; los CD's no negociables de un banco extranjero y los CD's si negociables del mismo banco extranjero; los CD's de un banco extranjero negociables en X país y los CD's del mismo banco extranjero no negociables en ese X país; los pesos a recibir por un reporto y los dólares a entregar por una compra de un título fecha valor 48 horas, etc.

B) Dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo. Por ejemplo, son compensables:

Los Udibonos en tenencia propia o a recibir por préstamo, por reporto o por compras fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas. (activo), con los Udibonos a entregar (pasivo) por reportos, préstamo o ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas; desde luego todos al mismo plazo.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones, por ejemplo:

Suponiendo que se van a recibir 400 udis de Udibonos por operaciones de reporto y se van a entregar 100 udis de similares Udibonos por un vencimiento de un préstamo de valores. Bajo este supuesto se compensan 100 de activo con 100 de pasivo, quedando una posición activa de 300 derivada de los Udibonos a recibir. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección, en Udibonos a recibir por reporto 100 udis y en Udibonos a entregar por préstamo de valores 100 udis.

Suponiendo las mismas operaciones anteriores y además 80 udis de Udibonos a entregar por reporto y 220 a entregar por ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, se compensan 400 de activo con 400 de pasivo, sin posición residual. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección en Udibonos a recibir por reporto 400, Udibonos a entregar por préstamo de valores 100, Udibonos a entregar por reporto 80 y Udibonos a entregar por ventas fecha valor 220.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza, por ejemplo: crédito bancario con pagaré bancario, UDIBONOS con dinero o UDIBONOS con Cetes o Bonos bancarios con pagaré bancario, etc.

VIII. OPERACIONES DE FUTURO, CONTRATOS ADELANTADOS Y OPCIONES

En las operaciones de futuro, contratos adelantados y opciones:

A) El subyacente, en todos los casos, se clasificará por las características de éste.

B) La parte de la operación relativa al "dinero", se clasificará en el RC01 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en pesos o en el RC03 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en UDIS (y/o UMA) o en el RC04 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en moneda extranjera.

C) La parte de la operación relativa al "dinero", respecto de operaciones sobre índices accionarios, se clasificará en el RC01 si se trata del IPC o de empresas residentes en México o en el RC04 si se trata de índices accionarios de empresas residentes en otros países, lo anterior siempre y cuando "el diferencial" a liquidar se determine exclusivamente en función del respectivo índice, en cuyo caso resulta indiferente la moneda de liquidación, por ejemplo un futuro del IPC que se liquide por "el diferencial" en pesos para efectos de riesgos de mercado es igual a uno que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación (en este último caso se "asegura" la convertibilidad mas no un tipo de cambio).

En el evento que el contrato de que se trate implique que el "importe a liquidar" se determine no sólo por "el diferencial" a favor o a cargo que resulte en función del índice de referencia, la institución deberá enviar un comunicado al Banco de México, a la Subgerencia de Información de Requerimientos de Capitalización, en el que se indiquen

las características de la operación de que se trate, a efecto que dicho Banco de México, resuelva sobre la clasificación de las "distintas operaciones" que se deriven de la transacción. Por ejemplo, un contrato adelantado del IPC que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre un tipo de cambio establecido desde la fecha de contratación de la transacción; en este caso la transacción podría "desdoblarse" como dos contratos adelantados: uno de IPC y otro de dólares.

IX. MONEDA DE LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

Continuando con algunas de las ideas de la instrucción anterior, debe tenerse presente que la "moneda de liquidación" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. El ejemplo más evidente son los UDIBONOS, cuyo riesgo está referido al INPC y a la "tasa real", no obstante que la "moneda de su liquidación" son pesos.

Otros ejemplos para ilustrar lo anterior son:

- ☐ Supóngase un swap: variación de IPC por tasa de UDIBONO, liquidable en pesos. En este caso, la parte de la operación relativa al IPC está sujeta a riesgo accionario (RC05) y la parte relativa al UDIBONO está sujeta a riesgo de INPC y de "tasa real", (RC03); no obstante que la liquidación es en pesos, ninguna de sus partes está sujeta a riesgo de tasa nominal en pesos.
- ☐ Supóngase el swap anterior, con la variante que la liquidación será en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación. El riesgo y clasificación de este swap son exactamente iguales a los del anterior; no obstante que la "moneda de liquidación" son dólares, no existe riesgo de tipo de cambio ni de tasa de interés en dólares, y sólo se está "asegurando" la convertibilidad mas no un tipo de cambio.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse a valor razonable, conforme a los criterios establecidos por la Comisión.

Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores) los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas.

XI. MONTO A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC03

La forma de determinar el "monto de referencia" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. Por ejemplo, supóngase un contrato adelantado (de compra o venta) de acciones de Telmex, con precio pactado en pesos, por el equivalente a 100 dólares, cuya diferencia del precio pactado y el observado, en pesos, combinado con el movimiento cambiario, se traducen en una entrega de más o menos acciones, de tal forma que siempre se liquidan 100 dólares. Esta operación sólo está expuesta a riesgo de tasa de interés nominal en pesos y a riesgo accionario; el hecho de que el monto de la operación esté referido a dólares y la moneda de liquidación también sean dólares, no

implica que la misma esté expuesta a riesgo de tipo de cambio o de tasa de interés en dólares. Para efectos de reporte, las partes de la operación, durante su vigencia, tendrían que reportarse: el dinero (RC01) por el importe en pesos equivalente a 100 dólares al tipo de cambio que corresponda, y la posición accionaria (RC05) por el importe en pesos que resulte de multiplicar el precio de mercado (de la acción) del día último del mes de que se trate por el número de acciones que dado el precio de ejercicio y el tipo de cambio del peso frente al dólar futuro observado se derivarían de los 100 dólares.

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC03

Conceptos 30100 – 30126: Depósitos bancarios a plazo

En estos conceptos deben incluirse, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. Asimismo, deben incluirse los depósitos a plazo en Banco de México. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor razonable (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Conceptos 30150 – 30176: Cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los préstamos y créditos concedidos: cartera de crédito vigente o en etapa 1 y 2 así como vencida o en etapa 3 ; operaciones de arrendamiento financiero; préstamos al personal; la cartera de créditos comprada a descuento, sin responsabilidad del cedente; el financiamiento otorgado a intermediarios financieros relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, etc. Incluye, en su caso, el refinanciamiento o capitalización de intereses.

En estos conceptos no debe incluirse la cartera de créditos cedida en descuento por la institución, con responsabilidad de la institución, ya que tal cartera debe incluirse en los conceptos 30180 a 30193.

En el caso del financiamiento otorgado a intermediarios financieros, relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento otorgado a tales intermediarios, independientemente de las características de los créditos objeto del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 30180 – 30193: Cartera de créditos cedida en descuento

En estos conceptos debe reportarse la cartera de créditos cedida en descuento por la institución, con responsabilidad de la institución.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de las operaciones se considerarán las características de los créditos cedidos en descuento por la institución,

independientemente de las características del financiamiento recibido por la institución a través del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 30300 – 30326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30350 – 30376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30400 – 30426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.
El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable.
En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30450 - 30476: Tenencia de títulos
En estos conceptos debe incluirse el valor razonable de la tenencia de títulos de deuda (incluyendo los "Cetes especiales" y los títulos emitidos por el FOBAPROA o el IPAB) que estén vigentes a la fecha de que se trate.

En estos conceptos no debe incluirse:
a) La tenencia de títulos emitidos por la propia institución.
b) La tenencia de títulos de deuda subordinados (la cual debe informarse en la sección "RC09").
c) La tenencia de títulos (o notas) estructurados (la cual debe informarse en los conceptos 31290 a 31316).

d) La tenencia de títulos de deuda con vinculación crediticia (la cual debe informarse en los conceptos 31350 a 31376).

Conceptos 30500 – 30526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30600 – 30626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30630 – 30656: "Forwards" de compra de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 30660 – 30686: "Forwards" de venta de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 30690 – 30716: Futuros de compra de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones

distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 30720 – 30746: Futuros de venta de tasa de interés real-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 30810 – 30836: "Forwards" de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa real, y distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 30840 – 30866: "Forwards" de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado referido al valor de la UDI, UMA, o del INPC) a recibir de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 30870 – 30896: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real y divisas -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa real, y distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 30900 – 30926: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real y divisas - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado referido al valor de la UDI, UMA, o del INPC) a recibir de futuros de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 30930 – 30956: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés real - fase activa
En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 30960 – 30986: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés real - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 30990 – 31016: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés real - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 31020 – 31046: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés real - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 31050 – 31076: "Swaps" relativos a subyacentes distintos a tasa de interés real – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se reciba cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa real distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 31080 – 31106: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés real fija – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés real fija.

Conceptos 31110 – 31136: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés real variable – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés real variable.

Conceptos 31140 – 31166: Emisión de opciones de compra de tasa de interés real tipo "CAP" – fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 31410– 31436: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés real tipo "CAP" - fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31170 – 31196: Emisión de opciones de venta de tasa de interés real tipo "FLOOR" – fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones

Conceptos 31380– 31406: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés real tipo "FLOOR" - fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31200 – 31226: Emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado referido al valor de la UDI, UMA o del INPC) a recibir de opciones sobre subyacentes distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 31470– 31496: Tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de opciones sobre

subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real, y distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31260– 11286: Emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de opciones sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real, y distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 31440– 31466: Tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real- fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado referido al valor de la UDI, UMA o del INPC) a recibir de opciones sobre subyacentes distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31290– 31316: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluirse la tenencia de títulos o notas estructuradas, denominadas en UDIS, emitidas por otras instituciones.

Conceptos 31320 – 31346: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte activa de los mismos que se encuentre denominada en UDIS o referida a una tasa de interés real.

Conceptos 31350– 311376: Tenencia de títulos con vinculación crediticia

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la tenencia de títulos de deuda, por la adquisición de títulos con vinculación crediticia, a que se refiere el segundo párrafo la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 31500– 31526: Emisión de opciones de compra de tasa de interés real, distintas a las opciones de compra tipo "CAP" - -Fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés real variable.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 31530– 31556: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés real, distintas **a las opciones de compra tipo "CAP" - -Fase activa**
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés real fija.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31560– 31586: Emisión de opciones de venta de tasa de interés real, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" - -Fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés real fija.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 31590– 31616: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés real, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" - -Fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés real variable.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

Conceptos 33250 – 33276: Instrumentos de captación a plazo
En estos conceptos deben incluirse los instrumentos de captación a plazo (certificados de depósito, pagarés, bonos bancarios, depósitos retirables en días preestablecidos, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, certificados bursátiles bancarios etc.) a cargo de la institución, con excepción de los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor razonable (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 33380 – 33396: Préstamos interbancarios recibidos por operaciones de cesión de cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los financiamientos recibidos correspondientes a operaciones de cesión de cartera de créditos por parte de la institución, en descuento (con responsabilidad de la institución).

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución a través del descuento, independientemente de las características de los créditos objeto de descuento.

Conceptos 33500– 33526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 34440 a 34466.

Conceptos 33550– 33576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 34440 a 34466.

Conceptos 33600 – 33626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado. El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor razonable

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 34440 a 34466.

Conceptos 33650 – 33676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 34440 a 34466.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 33700 – 33726: Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 34440 a 34466.

Conceptos 33780 – 33806: "Forwards" de compra de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 33810 – 33836: "Forwards" de venta de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 33840 – 33866: Futuros de compra de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 33870 – 33896: Futuros de venta de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés real a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 33960 – 33986: "Forwards" de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado referido al valor de la UDI, UMA, o del INPC) a entregar

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente distinto a tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 33990 – 34016: "Forwards" de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa real, y distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 34020 – 34046: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado referido al valor de la UDI o UMA o del INPC) a entregar de futuros de compra de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 34050 – 34076: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa real, y distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 34080 – 34106: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés real variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 34110 – 34136: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés real fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 34140 – 34166: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés real variable, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 34170 – 34196: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés real fija, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 34200 – 34226: "Swaps" relativos a subyacentes distintos a tasa de interés real–fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entregue cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa de interés real distinto de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 34230 – 34256: "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés real fija–fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés real fija.

Conceptos 34260 – 34286: "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés real variable–fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés real variable.

Conceptos 34290 – 34316: Emisión de opciones de compra de tasa de interés real tipo "CAP" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34560 – 34586: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés real tipo "CAP" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34320 – 34346: Emisión de opciones de venta de tasa de interés real tipo "FLOOR" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34530 – 34556: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés real tipo "FLOOR" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34380 – 34406: Emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real, y distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34620 – 34646: Tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado referido al valor de la UDI, UMA o del INPC) a entregar de opciones sobre subyacentes distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34410 – 34436: Emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado referido al valor de la UDI, UMA o del INPC) a entregar de opciones sobre subyacentes distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34590 – 34616: Tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real, y distintos de tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34440 – 34466: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluirse los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución.

Conceptos 34470– 34496: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 34500– 34526: Emisión de títulos propios con vinculación crediticia

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la emisión propia de títulos de deuda con vinculación crediticia, a que se refiere el primer párrafo la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 34650– 34676: Emisión de opciones de compra de tasa de interés real, distintas a las opciones de compra tipo "CAP" - -Fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés real fija.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34680– 34706: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés real, distintas a las opciones de compra tipo "CAP" - -Fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés real variable.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 34710– 34736: Emisión de opciones de venta de tasa de interés real, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" - -Fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés real variable.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 34740– 34766: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés real, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" - -Fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés real fija.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 04

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC04 RELATIVA A LAS OPERACIONES CON RIESGO DE MERCADO POR TASA DE INTERÉS NOMINAL EN MONEDA EXTRANJERA

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC04

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda extranjera, en las operaciones de: depósitos a la vista y a plazo; tenencia incluidos los otorgados en garantía sin transferencia de propiedad, compras y ventas, de títulos; reportos; préstamos de valores; futuros y contratos adelantados; intercambio de flujos de dinero (swap); opciones; créditos; redescuento de cartera, bienes en garantía (con transferencia de propiedad) denominados en moneda extranjera o indizados a tipos de cambio, y cuyo rendimiento esté referido a tasas de interés en moneda extranjera, en los que contractualmente la Institución que recibe u otorga la garantía mantenga el derecho de conservar los flujos de efectivo generados por dichos bienes objeto de la garantía, o las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en su precio. y otras operaciones. Incluye las operaciones en moneda extranjera liquidables en pesos dentro de la república mexicana (mex-dólares).

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC04

La sección RC04 está conformada por los conceptos 40000 al 49999, con cuatro columnas, en las que deben reportar, tratándose de operaciones con posiciones significativas las columnas 1 y 2, y tratándose de operaciones con posiciones no significativas las columnas 3 y 4:

Columna 1 y 3: Operaciones de la institución con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda extranjera, tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2 y 4: Operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda extranjera -por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, operaciones con riesgo de mercado por tasa de interés nominal en moneda extranjera -por su inversión en fondos de inversión, bajo cualquier modalidad de participación-, derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto

de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Las columnas 2 y 4 deben reportarse considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, con tasa de interés en moneda extranjera que formen parte del portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (Fracción IX del Art. 2 Bis 100 de la CUB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC04

En esta sección se solicita la sumatoria de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos en su caso, deben realizarse operación por operación.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus cuatro columnas, debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos. Al efecto los importes denominados en moneda extranjera deben valorizarse en pesos utilizando el tipo de cambio aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión.

Se considera que se mantiene una posición significativa en una divisa de referencia, cuando el valor de las posiciones activas más el valor de las posiciones pasivas, sin compensar, en dicha divisa sea mayor o igual al 5 por ciento de los pasivos totales de conformidad con los Criterios Contables.

Las operaciones en divisas que no presenten posiciones significativas podrán ser tratadas de manera agregada de acuerdo al Art. 2 Bis 105 de la CUB.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en las "CUB" cada operación está compuesta por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos; otro ejemplo, las operaciones de reporto, actuando como reportador, se considerarán como dos operaciones simultáneas: la cantidad de dinero a recibir computará como un activo, y los títulos a entregar como un pasivo; otro ejemplo, las operaciones de futuro de compra de dólares computarán como dos operaciones simultáneas: los dólares a recibir como un activo y los pesos a entregar como un pasivo. En tales circunstancias en lo sucesivo cuando se haga referencia a "las operaciones", en singular o plural, se podrá estar hablando de alguna de las partes de una operación o de una operación como un todo, según sea el caso.

Cada parte de las operaciones debe informarse en aquella sección a que corresponda.

Cabe señalar que hay operaciones cuyas partes están sujetas al mismo riesgo de mercado, por ejemplo, un futuro de Treasury Bills (Tbills), con precio en dólares: tanto el título como el dinero se informarán en la sección RC04. Sin embargo, hay diversas operaciones cuyas partes NO están sujetas al mismo riesgo de mercado, por lo tanto,

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

cada una de tales partes tendrá que informarse en la respectiva sección, RC01 a RC05; por ejemplo, en una compra de acciones liquidable en dólares fecha valor 48 horas: las acciones tendrán que informarse en el RC05 y el dinero a liquidar en el RC04.

Para identificar a qué sección pertenece una operación debe tenerse presente lo siguiente:

- Los títulos e instrumentos, sin excepción, se clasificarán por las características del título o instrumento, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características "del dinero" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

TIPO DE TÍTULO	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
CETE en tenencia	RC01
CETE a recibir por compras valor 24 horas.	RC01
Acciones en tenencia	RC05
Acciones a recibir por futuros o préstamo	RC05
Acciones a entregar por ventas 48 horas.	RC05
Títulos de deuda con tasa referida a la variación en el precio de una acción.	RC05
UDIBONOS en reporto con premio a tasa real	RC03
Bonos UMS en tenencia	RC04
Pagarés bancarios en M.N.	RC01
Pagarés bancarios en UDIS	RC03
CD's bancarios en dólares	RC04
Bondes en reporto con premio a tasa fija	RC01
UDIBONOS a recibir por compras 24 horas	RC03
Créditos a tasa CCP + X	RC01
Créditos a tasa TIIE * Y	RC01
Créditos a tasa fija en M.N.	RC01
Créditos en UDIS	RC03
Créditos a tasa real	RC03
Créditos a tasa CCP-UDIS	RC03
Créditos en moneda extranjera	RC04
Créditos en moneda nacional con rendimiento referido al SMG	RC11

Como puede observarse en los ejemplos anteriores la clasificación de los títulos o instrumentos deriva de sus propias características, sin que importen, en su caso, las características de "las operaciones asociadas".

- "El dinero", sin excepción, siempre se clasificará por las características del dinero sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características del "título o instrumento" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

DINERO A RECIBIR O A ENTREGAR	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
Por reportos en M.N. a tasa nominal, de CETES	RC01
Por compras de CETES valor 24 horas	RC01
Por compras de UDIBONOS valor 48 horas	RC01
Por futuros de dólares (dólares a recibir o a entregar)	RC04
Por futuros de dólares (pesos a recibir o a entregar)	RC01
M.E. por compraventa de Bonos UMS valor 48 horas	RC04
M.N. por opciones de acciones	RC01

V. PLAZO DE LAS OPERACIONES

Deberá determinarse el plazo particular de cada una de las partes de las operaciones. Para ello se procederá en los mismos términos de lo señalado en la instrucción anterior:

- El plazo de los títulos o instrumentos, sin excepción, se determinará según las características de los títulos o instrumentos, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar las características (plazo) del dinero involucrado en la operación, y
- El plazo del dinero se determinará según las características del dinero, sin importar las características del título o instrumento involucrado en la operación.

"El plazo" de cada operación será equivalente al número de días que se determine según lo señalado en el Art. 2 Bis 102 de la CUB, conforme a lo siguiente:

A) En todos los casos (tasa fija y revisable, para cualquier esquema de amortización), "el plazo" de las operaciones (dinero y títulos) inicia el último día del mes de que se trate (mes a que corresponda el reporte), sin importar la fecha de emisión, otorgamiento o contratación, según sea el caso, el tipo de operación o el tipo de tasa. Por ejemplo, para el reporte relativo a junio, "el plazo" de todas las operaciones que enseguida se señalan inicia el 30 de junio:

Pagaré emitido el 28 de diciembre, con vencimiento al 15 de noviembre.

Dinero a recibir por un reporto contratado el 30 de junio con vencimiento el 2 de enero.

Crédito a tasa ajustable al final del mes, otorgado el 7 de febrero con vencimiento el 6 de febrero.

En los ejemplos anteriores, si el reporte fuera de octubre, el inicio de todas las operaciones sería el 31 de octubre.

B) En cuanto a operaciones a tasa fija y con amortización total al vencimiento, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina al vencimiento de la operación. Ejemplos de operaciones (dinero o títulos) en moneda extranjera a tasa fija son:

- Tbills; CD's bancarios en dólares con rendimiento fijo liquidable al vencimiento; Dinero a recibir o a entregar por: reportos con premio a tasa fija, por futuros de dólares, por futuros de pesos, por opciones, etc.; Créditos a tasa fija, etc.

En todos estos casos el plazo termina al vencimiento del título, del crédito o del dinero, según se trate.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con pago de intereses periódicos y/o con amortizaciones periódicas del principal, el plazo en días será el equivalente a la "Duración" del instrumento, calculada conforme a la fórmula indicada en el Anexo 1-N de la CUB.

D) Respecto a operaciones con tasa de interés revisable o cuyo rendimiento esté referido a alguna tasa de interés nominal, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina en la fecha de revisión o de ajuste de la tasa o, en su caso, la de vencimiento de la operación (o parte de la operación) cuando ya no vaya a haber más revisiones o ajustes de tasa. Ejemplos de operaciones en moneda extranjera con tasa ajustable (referidas a otra tasa de una fecha y/o plazo y/o periodo específico, que aplica a lapsos determinados) son:

- Bonos del tesoro de los E.U.A. (Tbonds); Certificados de depósito, bonos bancarios, obligaciones subordinadas, etc., con tasa ajustable; Préstamos y créditos con tasa ajustable; Dinero a recibir o a entregar por reportos cuyo premio se haya pactado con tasa de interés ajustable, etc.

En todos estos ejemplos "el plazo" termina en la fecha de ajuste de tasa del título o crédito o dinero.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, o del crédito o del instrumento, es independiente a la fecha de su vencimiento y a la fecha de pago de los intereses; en algunos casos pueden coincidir, en otros no.

Para ilustrar lo anterior, a continuación, se dan algunos ejemplos de operaciones que tienen el mismo "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa), al margen de que son distintos sus vencimientos y sus fechas de pago de intereses, y de operaciones que tienen distinto "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa) al margen de que tienen igual fecha de vencimiento y de pago de intereses:

Ejemplos de operaciones al mismo plazo

- Depósito a plazo de 3 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada 3 meses.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada mes.
- Bono a 10 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses capitalizables cada mes.

Las tres operaciones anteriores, durante su vigencia, para efectos del cómputo de capitalización tiene el mismo plazo: un mes.

Ejemplos de operaciones con distinto plazo

- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada mes y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada dos meses y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el sexto mes y con pago de intereses el día último de cada mes.

Las tres operaciones anteriores para efectos del cómputo de capitalización tienen distinto plazo:

- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente, suponiendo que se hubieran otorgado el día último del mes X;
- 1 mes, 1 mes y 5 meses, respectivamente, en el mes X+1;
- 1 mes, 2 meses y 4 meses, respectivamente, en el mes X+2;
- 1 mes, 1 mes y 3 meses, respectivamente en el mes X+3;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+5;
- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente en el mes X+6;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+11.

Lo señalado en los incisos anteriores podría resumirse de la siguiente manera: "el plazo" serán los días que van del último día del mes de que se trate (mes del reporte) al día en que los correspondientes recursos (operación activa u operación pasiva) van a ser objeto de una reapreciación (nueva tasa), lo cual ocurre:

- Al vencimiento si la operación es a tasa fija sin pago de cupones (ni intereses ni principal), ya que los recursos al vencimiento se destinan a otra operación,
- Al plazo resultante de aplicar la fórmula de la "Duración" si la operación es a tasa fija con pagos parciales de intereses y/o de principal, ya que los recursos se destinarán a otra operación, en promedio, al plazo que se obtenga de la fórmula de la Duración, y

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- A la fecha de revisión o ajuste de la tasa si la operación se pactó con tales características, en este caso aunque los recursos sigan destinados a la misma operación a partir de dicha fecha de revisión o ajuste tienen una tasa (precio) distinta.

En cuadro denominado "plazo de las operaciones" que se encuentra en las Ayudas del Sistema de Acopio, se señalan las partes de que están constituidas diversas operaciones y la forma de determinar su plazo.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC04

Considerando el procedimiento establecido en la "CUB" para determinar la exposición a riesgo de mercado y el respectivo requerimiento de capital, esta sección está constituida por dos subsecciones:

- La primera (del concepto 40000 al 45999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportarse la totalidad de "las operaciones", clasificadas en el apartado a que correspondan y conforme a su particular plazo. Lo anterior implica que en esta subsección no podrán omitirse operaciones, no obstante que conforme a la "CUB" sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 46000 al 49999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, y de lo señalado en la instrucción VII siguiente.

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en el inciso a), fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, que a la letra establece:

"Las operaciones iguales de naturaleza contraria se compensarán por el monto en que una cubra a la otra. Al efecto, las operaciones, o la parte de que se trate de éstas, deberán tratarse del mismo título o instrumento, tener igual plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB y estar referidas a un mismo subyacente. Adicionalmente, se podrán compensar cuando estén referidas al mismo subyacente y tengan el mismo plazo las operaciones siguientes:

a) Operaciones de futuros listadas en mercados estandarizados con operaciones de contratos adelantados realizadas en mercados extrabursátiles. Operaciones de swap listadas en mercados estandarizados con operaciones de swap realizadas en mercados extrabursátiles, y operaciones de paquetes de futuros y de contratos adelantados, comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con, indistintamente, otros de los referidos paquetes de futuros o paquetes de contratos adelantados o con operaciones de swap de tasas de interés listadas en mercados estandarizados o con operaciones de swap de tasas de interés realizadas en mercados extrabursátiles.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

b) Posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija que procedan de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés conforme a la fracción VI del Art. 2 Bis 100 de la CUB, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB con posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija procedentes de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés y con títulos de deuda de tasa de interés fija.

Para efecto de lo dispuesto en este numeral, las operaciones se entenderán como referidas a un mismo subyacente en los siguientes casos:

i. Operaciones sobre pesos y/o moneda extranjera, cuando dichas operaciones se encuentren denominadas en la misma divisa.

ii. Operaciones sobre tasas de interés, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a una misma tasa y a un mismo plazo según lo señalado en la fracción I del Art. 2 Bis 102 de la CUB.

iii. Operaciones sobre índices, acciones y/o canastas de acciones, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a un mismo índice, acción y/o canasta de acciones.

Se entenderá que las posiciones activas y pasivas descritas anteriormente en los incisos a), b) y c), así como en las operaciones de futuros, tienen un mismo plazo para efectos de compensación cuando:

1. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí más de un día y la que tenga el plazo menor sea de 1 a 30 días;

2. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 7 días y la que tenga el menor plazo se ubique entre 31 y 365 días; y

3. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 30 días y las que tenga el menor plazo sea igual o mayor a 366 días.**"**

Cabe señalar que:

A) Se entenderá como mismo título o instrumento, cuando el activo y el pasivo sean de naturaleza semejante. Por ejemplo, no se considerarán como un mismo título o instrumento: CD's de la banca múltiple emitidos en México y los CD's de un banco extranjero; los CD's no negociables de un banco extranjero y los CD's si negociables del mismo banco extranjero; los CD's de un banco extranjero negociables en X país y los CD's del mismo banco extranjero no negociables en ese X país; los pesos a recibir por un reporto y los dólares a entregar por una compra de un título fecha valor 48 horas, etc.

B) Dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo. Por ejemplo, son compensables:

Los bonos en tenencia propia o a recibir por préstamo, por reporto o por compras fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas (activo), con los bonos a entregar (pasivo) por reportos, préstamo o ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs.; desde luego todos al mismo plazo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones, por ejemplo:

Suponiendo que se van a recibir 400 dls de Tbills por operaciones de futuro y se van a entregar 100 dls de similares Tbills por un vencimiento de un préstamo de valores. Bajo este supuesto se compensan 100 de activo con 100 de pasivo, quedando una posición activa de 300 derivada de los Tbills a recibir. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección, en Tbills a recibir por futuro 100 dls y en Tbills a entregar por préstamo de valores 100 dls.

Suponiendo las mismas operaciones anteriores y además 80 dls. de Tbills a entregar por futuro y 220 a entregar por ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, se compensan 400 de activo con 400 de pasivo, sin posición residual. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección en Tbills a recibir por futuro 400, Tbills a entregar por préstamo de valores 100, Tbills a entregar por futuro 80 y Tbills a entregar por ventas fecha valor 220.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza, por ejemplo: crédito bancario con pagaré bancario, Bonos con dinero o Bonos con Tbills o Bonos bancarios con pagaré bancario, etc.

VIII. OPERACIONES DE FUTURO, CONTRATOS ADELANTADOS Y OPCIONES

En las operaciones de futuro, contratos adelantados y opciones:

A) El subyacente, en todos los casos, se clasificará por las características de éste.

B) La parte de la operación relativa al "dinero", se clasificará en el RC01 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en pesos o en el RC03 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en UDIS o en el RC04 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en moneda extranjera.

C) La parte de la operación relativa al "dinero", respecto de operaciones sobre índices accionarios, se clasificará en el RC01 si se trata del IPC o de empresas residentes en México o en el RC04 si se trata de índices accionarios de empresas residentes en otros países, lo anterior siempre y cuando "el diferencial" a liquidar se determine exclusivamente en función del respectivo índice, en cuyo caso resulta indiferente la moneda de liquidación, por ejemplo un futuro del IPC que se liquide por "el diferencial" en pesos para efectos de riesgos de mercado es igual a uno que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación (en este último caso se "asegura" la convertibilidad mas no un tipo de cambio).

En el evento que el contrato de que se trate implique que el "importe a liquidar" se determine no sólo por "el diferencial" a favor o a cargo que resulte en función del índice de referencia, la institución deberá enviar un comunicado al Banco de México, a la Subgerencia de Información de Requerimientos de Capitalización, en el que se indiquen las características de la operación de que se trate, a efecto que dicho Banco de México, resuelva sobre la clasificación de las "distintas operaciones" que se deriven de la transacción. Por ejemplo, un contrato adelantado del IPC que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre un tipo de cambio establecido desde la fecha de contratación de la transacción; en este caso la transacción podría "desdoblarse" como dos contratos adelantados: uno de IPC y otro de dólares.

IX. MONEDA DE LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

Continuando con algunas de las ideas de la instrucción anterior, debe tenerse presente que la "moneda de liquidación" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. El ejemplo más evidente son los UDIBONOS, cuyo riesgo está referido al INPC y a la "tasa real", no obstante que la "moneda de su liquidación" son pesos.

Otros ejemplos para ilustrar lo anterior son:

- Supóngase un swap: variación de IPC por tasa de UDIBONO, liquidable en pesos. En este caso, la parte de la operación relativa al IPC está sujeta a riesgo accionario (RC05) y la parte relativa al UDIBONO está sujeta a riesgo de INPC y de "tasa real", (RC03); no obstante que la liquidación es en pesos, ninguna de sus partes está sujeta a riesgo de tasa nominal en pesos.
- Supóngase el swap anterior, con la variante que la liquidación será en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación. El riesgo y clasificación de este swap son exactamente iguales a los del anterior; no obstante que la "moneda de liquidación" son dólares, no existe riesgo de tipo de cambio ni de tasa de interés en dólares, y sólo se está "asegurando" la convertibilidad más no un tipo de cambio.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse a valor razonable, conforme a los criterios establecidos por la Comisión.

Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores) los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas.

XI. MONTO A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC04

La forma de determinar el "monto de referencia" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. Por ejemplo, supóngase un contrato adelantado (de compra o venta) de acciones de Telmex, con precio pactado en pesos, por el equivalente a 100 dólares, cuya diferencia del precio pactado y el observado, en pesos, combinado

con el movimiento cambiario, se traducen en una entrega de más o menos acciones, de tal forma que siempre se liquidan 100 dólares. Esta operación sólo está expuesta a riesgo de tasa de interés nominal en pesos y a riesgo accionario; el hecho de que el monto de la operación esté referido a dólares y la moneda de liquidación también sean dólares, no implica que la misma esté expuesta a riesgo de tipo de cambio o de tasa de interés en dólares. Para efectos de reporte, las partes de la operación, durante su vigencia, tendrían que reportarse: el dinero (RC01) por el importe en pesos equivalente a 100 dólares al tipo de cambio que corresponda, y la posición accionaria (RC05) por el importe en pesos que resulte de multiplicar el precio de mercado (de la acción) del día último del mes de que se trate por el número de acciones que dado el precio de ejercicio y el tipo de cambio del peso frente al dólar futuro observado se derivarían de los 100 dólares.

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC04

Concepto 40050: Depósitos bancarios a la vista

En este concepto deben incluirse las disponibilidades distintas de depósitos bancarios a plazo. A discreción de la institución, en este concepto podrá incluirse el saldo de caja.

Conceptos 40100 – 40126: Depósitos bancarios a plazo

En estos conceptos deben incluirse, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. Asimismo, deben incluirse los depósitos a plazo en Banco de México. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor razonable (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Conceptos 40150 – 40176: Cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los préstamos y créditos concedidos: cartera de crédito vigente o en etapa 1 y 2 así como vencida o en etapa 3; operaciones de arrendamiento financiero; préstamos al personal; la cartera de créditos comprada a descuento, sin responsabilidad del cedente; el financiamiento otorgado a intermediarios financieros relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, etc. Incluye, en su caso, el refinanciamiento o capitalización de intereses.

En estos conceptos no debe incluirse la cartera de créditos cedida en descuento por la institución, con responsabilidad de la institución, ya que tal cartera debe incluirse en los conceptos 40180 a 40193.

En el caso del financiamiento otorgado a intermediarios financieros, relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento otorgado a tales intermediarios, independientemente de las características de los créditos objeto del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida

o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 40180 – 40193: Cartera de créditos cedida en descuento
En estos conceptos debe reportarse la cartera de créditos cedida en descuento por la Institución, con responsabilidad de la Institución.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de las operaciones se considerarán las características de los créditos cedidos en descuento por la Institución, independientemente de las características del financiamiento recibido por la Institución a través del descuento.
La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la Institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Concepto 40195: Moneda extranjera a recibir por compras fecha-valor de divisas
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por operaciones fecha-valor de compra de cualquier divisa.

Concepto 40197: Moneda extranjera a recibir por ventas fecha-valor de divisas
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por operaciones fecha-valor de venta de cualquier divisa.

Concepto 40200-40212: Moneda extranjera a recibir por ventas fecha-valor de valores
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir, por ventas de valores (títulos de deuda o acciones) fecha-valor pendientes de liquidar. Según lo señalado en el artículo 101 de la circular 3/2012.

Concepto 41771 - 41772: Moneda extranjera a recibir por venta de acciones, títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha-valor
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir, por ventas de acciones, de títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha valor pendientes de liquidar.

Concepto 41774: Moneda extranjera a recibir por venta al contado de mercancías
En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por venta al contado de mercancías

Concepto 40250: Moneda extranjera a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportado

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir, por reportos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como reportado (incluye el dinero a recibir por reportos sobre títulos de deuda y/o acciones).

Conceptos 40300 – 40326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Conceptos 40350 – 40376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Conceptos 40400 – 40426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Conceptos 40450 - 40476: Tenencia de títulos

En estos conceptos debe incluirse el valor razonable de la tenencia de títulos de deuda (incluyendo los "Cetes especiales" y los títulos emitidos por el FOBAPROA o el IPAB) que estén vigentes a la fecha de que se trate.

En estos conceptos no debe incluirse:

a) La tenencia de títulos emitidos por la propia Institución.

b) La tenencia de títulos de deuda subordinados (la cual debe informarse en la sección "RC09").

c) La tenencia de títulos (o notas) estructurados (la cual debe informarse en los conceptos 41380 a 41406).

d) La tenencia de títulos de deuda con vinculación crediticia (la cual debe informarse en los conceptos 41440 a 41466).

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 40500 – 40526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Concepto 40550 - 40576: Moneda extranjera a recibir por reportos de valores, actuando como reportador

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 40600 – 40626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Conceptos 40630 – 40656: "Forwards" de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 40660 – 40686: "Forwards" de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de

interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 40690 – 40716: Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 40720 – 40746: Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 40750 – 40776: "Forwards" de compra de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 40780 – 40806: "Forwards" de venta de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de venta de cualquier divisa.

Conceptos 40810 – 40836: Futuros de compra de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por futuros de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 40840 – 40866: Futuros de venta de divisas-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a recibir por futuros de venta de cualquier divisa.

Conceptos 41776 – 41789: "Forwards" de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de contratos adelantados de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 41791 – 41804: "Forwards" de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de contratos

adelantados de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 41806 – 41819: "Forwards" de compra de otros subyacentes -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Conceptos 41821 – 41834: "Forwards" de venta de otros subyacentes -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de contratos adelantados de venta de otros subyacentes.

Conceptos 41836 – 41849: Futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 41851 – 41864: Futuros de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de futuros de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 41866 – 41879: Futuros de compra de otros subyacentes -fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Conceptos 41881 – 41894: Futuros de venta de otros subyacentes - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de futuros de venta de otros subyacente.

Conceptos 40990 – 41016: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa
En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés fija en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 41020 – 41046: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés variable en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 41050 – 41076: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo dela fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés fija en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 41080 – 41106: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés variable en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 41896 – 41909: "Swaps" relativos a acciones, canastas accionarias, e índices accionarios – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a acciones, canastas accionarias e índices accionarios.

Conceptos 41911 – 41924: "Swaps" relativos a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 41926 – 41939: "Swaps" relativos a otros subyacentes– fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte activa (subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero cuya parte activa corresponde a otros subyacentes.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 41140 – 41166: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés fija en moneda extranjera – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Conceptos 41170 – 41196: "Swaps" en los que se reciba una tasa de interés variable en moneda extranjera – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés variable en moneda extranjera.

Conceptos 41200 – 41226: Emisión de opciones de compra de tasa de interés en m.e. tipo "CAP" – fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41230 – 41256: Emisión de opciones de venta de tasa de interés en m.e. tipo "FLOOR" – fase activa

Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41260 – 41286: Emisión de opciones de compra de divisas – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41290 – 41316: Emisión de opciones de venta de divisas – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41941 – 41954: Emisión de opciones y warrants de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41956 – 41969: Emisión de opciones y warrants de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41971 – 41984: Emisión de opciones y warrants de compra de otros subyacentes - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de opciones sobre otros subyacentes.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41986– 41999: Emisión de opciones y warrants de venta de otros subyacentes – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41380– 41406: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB en las que la institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluirse la tenencia de títulos o notas estructuradas emitidas por otras instituciones.

Conceptos 41410– 41436: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte activa de los mismos.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 41440– 41466: Tenencia de títulos con vinculación crediticia
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la tenencia de títulos de deuda, por la adquisición de títulos con vinculación crediticia, a que se refiere el segundo párrafo de la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 41470 – 41496: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés en m.e. tipo "FLOOR"
Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 41500 – 41526: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés en m.e. tipo "CAP"
Se determinará la parte activa considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 41530 – 41556: Tenencia de opciones de venta de divisas – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 41560 – 41586: Tenencia de opciones de compra de divisas – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a recibir por opciones en las que se entregue cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42001– 42014: Tenencia de opciones y warrants de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42016– 42029: Tenencia de opciones sobre futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir por opciones sobre futuros de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42031– 42044: Tenencia de opciones y warrants de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir por opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42046 – 42059: Tenencia de opciones y warrants de venta de otros subyacentes - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a recibir de opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42061– 42074: Tenencia de opciones y warrants de compra de otros subyacentes – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a recibir de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 41650– 41676: Emisión de opciones de compra de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "CAP" – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés variable en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41680– 41706: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "CAP" – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 41710– 41736: Emisión de opciones de venta de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "FLOOR" – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 41740– 41766: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "FLOOR" – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un rendimiento referido a una tasa de interés variable en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 42800– 42826: Otros financiamientos otorgados y demás operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés en moneda extranjera
En estos conceptos deben incluirse, entre otras, las operaciones conocidas como "call money" otorgadas a otros bancos, tanto residentes en México como en otros países.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

Conceptos 43050 – 43058: Depósitos a la vista sin interés.
En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal y, en su caso, intereses devengados no pagados) de los depósitos a la vista, sin interés. Estos depósitos deben clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A de las CUB.

Conceptos 43100 – 43102: Depósitos a la vista con tasa de interés.
En estos conceptos debe reportarse el valor contable (principal e intereses devengados no pagados) de los depósitos a la vista con tasa de interés. Estos depósitos deben

clasificarse en las bandas correspondientes conforme a lo señalado en el Anexo 1-A de la CUB.

Concepto 43195: Moneda extranjera a entregar por compras fecha-valor de divisas

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por operaciones fecha-valor de compra de cualquier divisa.

Concepto 43197: Moneda extranjera a entregar por ventas fecha-valor de divisas

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por operaciones fecha-valor de venta de cualquier divisa.

Concepto 44921 - 44922: Moneda extranjera a entregar por compra de acciones, títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha-valor

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar, por compra de acciones, de títulos de deuda referidos a canastas de acciones, y títulos de deuda referidos a índices accionarios fecha valor pendientes de liquidar.

Concepto 44924: Moneda extranjera a entregar por compra al contado de mercancías

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por compra al contado de mercancías

Conceptos 43250 – 43276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluirse los instrumentos de captación a plazo (certificados de depósito, pagarés, bonos bancarios, depósitos retirables en días preestablecidos, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, certificados bursátiles bancarios etc.) a cargo de la institución, con excepción de los títulos propios pendientes de entregar por ventas fecha-valor, así como los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor razonable (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 43350 – 43376: Préstamos y Depósitos de Bancos

En estos conceptos deben incluirse los préstamos y depósitos de bancos (depósitos y préstamos de bancos nacionales a plazo, depósitos y préstamos de bancos del extranjero, etc.) a cargo de la institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor razonable (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 43380 – 43393: Préstamos interbancarios recibidos por operaciones de cesión de cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los financiamientos recibidos correspondientes a operaciones de cesión de cartera de créditos por parte de la institución, en descuento (con responsabilidad de la institución).

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución a través del descuento, independientemente de las características de los créditos objeto de descuento.

Concepto 43400: Moneda extranjera a entregar por compras fecha-valor de valores

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar, por compras de valores (títulos de deuda o acciones) fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. Según lo señalado en el artículo 101 de la circular 3/2012.

Concepto 43450: Moneda extranjera a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportador

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar, por reportos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como reportador (incluye el dinero a entregar por reportos sobre títulos de deuda y/o acciones).

Conceptos 43500– 43526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 44530 a 44556.

Conceptos 43550– 43576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 44530 a 44556.

Conceptos 43600 – 43626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado. El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor razonable

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 44530 a 44556.

Conceptos 43650 – 43676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 44530 a 44556.

Conceptos 43700 – 43726: Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 44530 a 44556.

Concepto 43750 - 43776: Moneda extranjera a entregar por reportos de valores, actuando como reportado

En este concepto debe incluirse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes.

Conceptos 43780 – 43806: "Forwards" de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de compra de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo dela fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 43810 – 43836: "Forwards" de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de contratos adelantados de venta de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 43840 – 43866: Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés variable) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 43870 – 43896: Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva (referida a una tasa de interés fija) de las operaciones distintas a los paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera a los que se refiere el segundo párrafo dela fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 43900 – 43926: "Forwards" de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por contratos adelantados de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por contratos adelantados de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 43930 – 43956: "Forwards" de venta de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por contratos adelantados de venta de cualquier divisa.

Conceptos 43960 – 43986: Futuros de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por futuros de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 43990 – 44016: Futuros de venta de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la moneda extranjera a entregar por futuros de venta de cualquier divisa.

Conceptos 44926 – 44939: "Forwards" de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar por contratos adelantados de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 44941 – 44954: "Forwards" de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de

contratos adelantados de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 44956 – 44969: "Forwards" de compra de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de contratos adelantados de compra de cualquier otro subyacente.

Conceptos 44971 – 44984: "Forwards" de venta de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de contratos adelantados de venta de cualquier otro subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Conceptos 44986 – 44999: Futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Conceptos 45001 – 45014: Futuros de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de futuros de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 45016 – 45029: Futuros de compra de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de futuros de compra de cualquier otro subyacente.

Conceptos 45031 – 45044: Futuros de venta de otros subyacentes -fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de cualquier otro subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Conceptos 44140 – 44166: Paquetes de "Forwards" de compra de tasa de interés en moneda extranjera- fase pasiva
En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 44170 – 44196: Paquetes de "Forwards" de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo de la fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 44200 – 44226: Paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo dela fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 44230 – 44256: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase pasiva

En estos conceptos deben incluirse únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el segundo párrafo dela fracción VII del Art. 2 Bis 100 de la. Al efecto debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) equivalente a la parte pasiva de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 45046 – 45059: "Swaps" relativos a acciones, canastas accionarias, e índices accionarios –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entreguen acciones, canastas accionarias e índices accionarios.

Conceptos 45061 – 45074: "Swaps" relativos a mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entreguen mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Conceptos 44260 – 44286: "Swaps" relativos a otros subyacentes - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte pasiva, de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se entregue cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 44290 – 44316: "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Conceptos 44320 – 44346: "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera.

Conceptos 44350 – 44376: Emisión de opciones de compra de tasa de interés en m.e tipo "CAP" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44380 – 44406: Emisión de opciones de venta de tasa de interés en m.e. tipo "FLOOR" – fase pasiva

Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44410 – 44436: Emisión de opciones de compra de divisas – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44440 – 44466: Emisión de opciones de venta de divisas – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 45091– 45104: Emisión de opciones y warrants de venta de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a entregar por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 45106– 45119: Emisión de opciones y warrants de venta de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a entregar por opciones sobre mercancías, canastas de mercancías, e índices referidos a mercancías.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 45121 – 45134: Emisión de opciones y warrants de compra de otros subyacentes – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 45136– 45149: Emisión de opciones y warrants de venta de otros subyacentes – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de opciones sobre otros subyacentes.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44530– 44556: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluirse los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución.

Conceptos 44560–44586: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos)

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos 44590–44616: Emisión de títulos propios con vinculación crediticia
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la emisión propia de títulos de deuda con vinculación crediticia, a que se refiere el primer párrafo de la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 44620 – 44646: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés en m.e. tipo "FLOOR" – fase pasiva
Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el FLOOR. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44650 – 44676: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés en m.e. tipo "CAP" – fase pasiva
Se determinará la parte pasiva considerando la operación como un "swap", por un monto igual a la posición delta equivalente en sensibilidad para el CAP. La posición delta equivalente en sensibilidad se calculará de acuerdo al modelo de la valuación que corresponda a cada institución.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44680 **– 44706: Tenencia de opciones de venta de divisas – fase pasiva**
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44710 – 44736: Tenencia de opciones de compra de divisas – fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la moneda extranjera a entregar por opciones en las que se reciba cualquier divisa.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 45151– 45164: Tenencia de opciones y warrants de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones sobre acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 45166– 45179: Tenencia de opciones sobre futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones sobre futuros de compra de acciones, canastas accionarias, e índices accionarios.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 45181– 45194: Tenencia de opciones y warrants de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías - fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar por opciones de compra de mercancías, canastas de mercancías e índices referidos a mercancías.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 45196 – 45209: Tenencia de opciones y warrants de venta de otros subyacentes **– fase pasiva**

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al subyacente a entregar de opciones sobre otros subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 45211 – 45224: Tenencia de opciones y warrants de compra de otros subyacentes – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (considerando el valor "delta" correspondiente) de la parte relativa al "dinero" (es decir, al precio de ejercicio pactado denominado en moneda extranjera) a entregar de opciones sobre otros subyacentes.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44800– 44826: Emisión de opciones de compra de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones de compra tipo "CAP" – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44830– 44856: Tenencia de opciones de compra de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "CAP" – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés variable en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44860– 44886: Emisión de opciones de venta de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones tipo "FLOOR" – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés variable en moneda extranjera.
Sin excepción deben incluirse todas las operaciones.

Conceptos 44890– 44916: Tenencia de opciones de venta de tasa de interés en m.e., distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" – fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés fija en moneda extranjera.

Deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Concepto 49288: Indicador relativo al tratamiento que la institución dará a las posiciones no significativas.

En este concepto debe reportarse:

- El número 1000, cuando la Institución elija dar el tratamiento de la misma forma que en el caso de una posición significativa, los mismos procedimientos indicados en el Artículo 2 Bis 102.
- El número 2000, cuando la Institución elija dar el tratamiento de forma agregada sin aplicar las compensaciones del numeral 2 a 4 del inciso f) de la fracción II del Artículo 2 Bis 102.

Al realizar el cómputo de capital por riesgo mercado, cuando en este concepto se anote el número 2000, no se generarán los requerimientos siguientes: Por compensación al interior de las bandas, Por compensación entre bandas de una misma zona y Por compensación entre bandas de distintas zonas.

Este concepto es de carácter obligatorio, por lo que para los casos que no tengan operaciones a registrar en esta sección, deberán anotar el valor por defecto 3000.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 05

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES (AYUDAS) PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC05 RELATIVA AL RIESGO DE MERCADO POR OPERACIONES CON ACCIONES Y SOBRE ACCIONES O CON RENDIMIENTO REFERIDO A ÉSTAS Y POR POSICIÓN EN ORO.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC05

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de mercado de las posiciones en acciones, canastas de acciones e índices accionarios - en lo sucesivo "acciones" con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados u otros derivadas de: la tenencia de "acciones"; operaciones - con "acciones" - de compra, venta, préstamos, futuros, contratos adelantados e intercambio de flujos de dinero (swap); opciones y títulos opcionales (warrants) sobre "acciones"; "acciones" en garantía (con transferencia de propiedad), cedidas y recibidas cuyo rendimiento esté referido a la variación en el precio de una acción, de una canasta de acciones o de un índice accionario, en los que contractualmente la Institución que recibe u otorga la garantía mantenga el derecho de conservar los flujos de efectivo generados por dichos bienes objeto de la garantía, o las plusvalías y minusvalías derivadas de cambios en su precio.; tenencia y emisión de títulos de deuda así como otros activos y pasivos, con rendimiento referido al de una acción, una canasta de acciones o un índice accionario. Adicionalmente debe reportarse la posición neta larga y corta en oro.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC05

Las cifras que se reporten se referirán exclusivamente a operaciones de la institución. Por ningún motivo deberán reportarse cifras que sean producto de la consolidación de estados financieros.

Tratándose de operaciones que en una de sus partes el rendimiento se determine por la variación en el precio de "acciones", y en otra tal rendimiento se determine de una manera distinta (Por ejemplo, instrumentos derivados o notas estructuradas), en esta sección sólo computará la parte relativa al rendimiento de "acciones".

Tratándose de las acciones en esta sección NO deberán incluirse las inversiones, directas e indirectas, en:

- Acciones de organismos multilaterales de desarrollo o fomento de carácter internacional, a que se refiere el segundo párrafo del inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de la CUB.

- Acciones de controladoras de grupos financieros; acciones de entidades financieras del país y del exterior; acciones representativas del capital fijo de fondos de inversión; patrimonio fijo (capital), bajo cualquier modalidad de participación, de fondos de inversión; acciones de sociedades operadoras de fondos de inversión; acciones de administradoras de fondos para el retiro, y acciones de sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro.
- Acciones de inmobiliarias bancarias, a que se refiere el artículo 88 de la L.I.C.
- Acciones de empresas que les presten servicios auxiliares en su administración o en la realización de su objeto a que se refiere el artículo 88 de la L.I.C.
- Acciones de empresas accionistas de la propia institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo financiero o de filiales financieras de todas estas.
- Acciones, distintas a las del Capital Fijo, de fondos de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas, respecto de las cuales la tenencia de la institución exceda del 15% del total de las acciones del fondo de inversión de que se trate sin considerar las relativas al Capital Fijo.
- Inversiones indirectas realizadas a través de índices de valores que incluyan las inversiones en el capital de la propia Institución o en el capital de cualquier entidad financiera.
- Las demás inversiones en acciones (o parte de las inversiones según sea el caso) que se resten del Capital Fundamental a que se refiere la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de la CUB.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC05

La sección RC05 está conformada por los conceptos 55001 a 55143, con dos columnas en donde deberá reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la institución en sus oficinas en México y en sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Posiciones accionarias o en oro- por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, las Posiciones accionarias - por su inversión, que no corresponda al patrimonio fijo en fondos de inversión, bajo cualquier modalidad de participación, derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

La columna 2 deberá reportarse considerando las diversas posiciones individuales, una por cada serie accionaria u oro de que esté conformado el portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones,

del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción IX del Art. 2 Bis 100 e inciso d) de la fracción I del Art. 2 Bis 109 de la CUB).

Las inversiones en el capital variable de fondos de inversión, tanto de capitales como de objeto limitado, que se encuentren cotizadas en la Bolsa Mexicana de Valores o alguna otra bolsa de valores reconocida por las autoridades, en las que la institución mantenga hasta el 15% del capital contable de fondos de inversión, serán consideradas para efectos del cómputo como una posición individual y deberán reportarse dentro de la columna 1.

A partir de enero 2017 también se consideran las inversiones en acciones de bolsas de valores.

A partir de abril 2017 se considerarán las acciones de instituciones para depósitos de valores.

IV. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR.

Tratándose de entidades financieras filiales del exterior, en el reporte de cada una de éstas (adicional al de la Institución): sus operaciones, directas, deberán reportarlas en la columna 1; las inversiones realizadas indirectamente a través de "fondos de inversión" deberán reportarlas en la columna 2. Asimismo, la moneda nacional serán los pesos mexicanos y la moneda extranjera cualquier moneda distinta de dichos pesos, inclusive la del país donde resida la entidad financiera del exterior de que se trate.

V. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC05

En esta sección se solicita la suma y resultados de las operaciones a que cada concepto se refiere; sin embargo, los cálculos deben realizarse, en su caso, por cada posición accionaria y mercado geográfico conforme al procedimiento que establece la "CUB".

La información de RCs se solicita en forma agregada, por lo que la institución previamente deberá clasificar las posiciones por emisión y mercado geográfico e informarlas según corresponda al tipo de acción y operación de que se trate. La sección RC05 no considera abrir conceptos por mercado.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos. Al efecto, el valor de las "acciones" de empresas establecidas en el extranjero, deberá convertirse de la moneda del país de residencia de la empresa, a moneda nacional, al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VI. MONTOS A COMPUTAR LA SECCIÓN RC05

Las "acciones" y posiciones en oro deben reportarse a valor razonable conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

Las operaciones de futuro, contratos adelantados, intercambio de flujos de dinero (swap), opciones y títulos opcionales (warrants) sobre canastas de acciones o índices accionarios así como la tenencia y emisión de títulos de deuda con rendimiento referido a dichas canastas o índices, computarán como una acción más o como una posición por cada acción subyacente de que estén conformados las canastas o índices, según lo decida cada institución (conforme a lo señalado en los párrafos segundo y tercero de los incisos b) o c) fracción I Art. 2 Bis 109 según se trate de la "CUB").

Las opciones y títulos opcionales, sobre acciones, computarán como una posición equivalente a la de las acciones subyacentes, al valor que resulte de multiplicar el valor de mercado de las acciones de que se trate, por el número de acciones que ampare la opción o título opcional y por la "Delta" de la opción. Las operaciones de opciones y títulos opcionales sobre canastas de acciones o índices accionarios, computarán como una acción más, al valor que resulte de multiplicar el valor de una unidad de la canasta o índice, por el número de unidades que ampare la opción y por "Delta" de la opción. El valor de una unidad será el que se obtenga de ponderar la composición accionaria de una unidad por los correspondientes valores de mercado.

En las operaciones con títulos de deuda que presenten características que permitan su conversión en acciones, éstas deberán clasificarse como operaciones en acciones cuando el rendimiento de dichos instrumentos exhiba un comportamiento similar al de las acciones por las que podría intercambiarse.

Los "American Depositary Receipts" (ADR'S) y otros títulos que la CNBV considere similares a éstos, computarán como "acciones" por un importe igual al de los títulos subyacentes (conforme a lo señalado en el inciso a) fracción I Art. 2 Bis 109 de la "CUB").

VII. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC05

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, deberá considerarse:

1. Si la operación es

   - Con acciones o sobre acciones (conceptos 55001 al 55013 y/o 55053 al 55064).
   - Sobre o referido a canastas de accionaria (conceptos 55014 al 55026 y/o 55065 al 55077).
   - Sobre o referidos a índices accionarios (conceptos 55027 al 55039 y/o 55078 al 55090).
   - Con Certificados Bursátiles, distinguiendo aquellos que otorgan créditos o inviertan en financiamientos (conceptos 55040 al 55050 y/o 55091 al 55101).

- Con Oro o con rendimiento referido a éste (conceptos 55141 al 55143).

2. La posición (larga y/o corta) de la Institución en la "acción".

3. El tipo de operación que origina la posición en la "acción"

VIII. TIPOS DE OPERACIONES A CONSIDERAR EN ESTA SECCIÓN

Las posiciones en "acciones" se registrarán conforme al tipo de operación en los conceptos correspondientes a:

- Compras y ventas, ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, y otras operaciones pendientes de liquidar.

- Tenencia. Incluye el total de las "acciones" en tenencia (inclusive los valores adjudicados), independientemente de la operación de donde provienen y de los derechos y obligaciones subyacentes respecto de las propias "acciones".

- Préstamos actuando como prestatario y prestamista (operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

- Préstamos actuando como prestamista y prestatario. Incluye todas las operaciones, inclusive las ya pactadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas. En este último caso como si las "acciones" ya se hubieren recibido o entregado.

- Contratos adelantados (forwards) de compra y venta.

- Futuros de compra y venta.

- Emisión de opciones y títulos opcionales de compra y venta. Sin excepción incluye todas las operaciones.

- Tenencia de opciones y títulos opcionales de compra y venta. Deben incluirse todas las posiciones derivadas de operaciones que se encuentren "dentro del dinero", y queda a elección de la Institución exclusivamente el incluir o no las posiciones derivadas de operaciones que se encuentren "fuera del dinero".

- Swaps a recibir y a entregar, respecto de las cuales se pactó el intercambio de flujos.

- Tenencia de opciones sobre futuros de compra y venta. Queda a elección de la Institución el incluir o no las acciones o índices de las operaciones en las que el precio futuro observado de la acción o del índice de que se trate, en operaciones celebradas el día último del mes, sea menor al "precio establecido en la opción" de que se trate (fuera del dinero).

- Títulos de deuda, a recibir por garantías otorgadas o recibidas con transferencia de propiedad. Deben incluirse todas las "acciones" cedidas o recibidas en garantía, sin importar la operación que se esté garantizando.

- Emisión de títulos de deuda. En este renglón deberá reportarse el importe de aquellos títulos cuyo rendimiento se determine exclusivamente en función de la variación en el precio de una acción, de una canasta de acciones o de un índice accionario. Deberá reportarse el importe de los títulos ya colocados: emisión total menos títulos "en tesorería". Tratándose de títulos de deuda, o la parte de éstos, cuyo rendimiento se determine alternativamente entre dos o más tasas de interés, y dentro de éstas una que implique un rendimiento en función de la variación en el precio de una acción, de una canasta de acciones o de un índice accionario; la institución deberá enviar con toda oportunidad un comunicado al Banco de México, a la Subgerencia de Requerimientos de Capitalización, en el que se especifiquen las características del título así como, en su caso, las consideraciones, el procedimiento y/o fórmula para determinar el importe de la "posición accionaria" derivada del título, a efecto que dicho Banco de México, resuelva sobre el particular.

Certificados Bursátiles, deben distinguir aquellos que otorgan créditos o inviertan en financiamientos.

- Tratándose de inversiones en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios o de desarrollo cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que no cuenten con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes, se aplicará un ponderador del 1,250 por ciento a la posición.
- Aquellos certificados bursátiles que no entren en el supuesto anterior, se determinará un requerimiento de capital conforme al artículo 2 bis 109.

Las Operaciones con Oro o con rendimiento referido a éste, se determinará la posición neta corta (negativa) o neta larga (positiva) para el total de las operaciones.

Las operaciones activas y pasivas celebradas por la institución, relativas a "acciones", que no queden comprendidas en los conceptos anteriores, deben ser informadas bajo el tipo *Otras operaciones activas y/o pasivas con rendimiento referido a "acciones"*. Con independencia de tal reporte, será obligación de la institución enviar un comunicado a la Subgerencia de Información de Capitalización, Crédito y Estados Financieros, en el que se indiquen las características de la operación de que se trate así como, en su caso, las consideraciones, el procedimiento y/o fórmula para determinar el importe de la "posición accionaria" derivada de la operación.

IX. POSICIONES NETAS, LARGAS Y CORTAS EN ACCIONES

Las posiciones deben obtenerse individualmente para cada serie accionaria y mercado geográfico, por lo que posiciones largas y cortas no podrán compensarse entre acciones, canastas o índices que coticen en distintos mercados.

Posición Neta por cada serie accionaria

Se determinará la posición neta por cada serie accionaria, larga o corta, sumando algebraicamente las posiciones activas y pasivas de cada una. En el caso de canastas

de acciones o índices accionarios, su composición deberá ser de la misma naturaleza para que se permita la compensación de posiciones activas y pasivas.

Posición Total Larga y Total Corta

Se determinará, en cada caso, la posición total larga y la total corta, sumando las posiciones netas por cada serie accionaria, largas o cortas según se trate.

Posiciones Neta del Portafolio

Se determinará la posición neta del portafolio accionario, sumando algebraicamente las posiciones netas de las acciones que se obtengan.

X. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC05

Concepto 55104: Suma de los montos que se compensan al determinar la posición neta.

Suma de los montos que se compensan (la parte de la posición activa con la parte de la posición pasiva) al determinar la posición neta de cada acción conforme a la fracción II del Art. 2 Bis 109 de la "CUB".

- Concepto 55105. Con acciones o sobre acciones
- Concepto 55106. Sobre o referido a canastas de accionaria.
- Concepto 55107. Sobre o referidos a índices accionarios.
- Concepto 55108. Con Certificados Bursátiles que otorgan créditos o inviertan en financiamientos.
- Concepto 55109. Con Certificados Bursátiles que NO otorgan créditos o inviertan en financiamientos.

Concepto 55111: Posición Total Larga

Suma de las posiciones activas por cada acción conforme al inciso b) fracción II del Art. 2 Bis 109 de la "CUB".

- Concepto 55112. Con acciones o sobre acciones (Suma de los conceptos 55002 a 55013 menos 55105).
- Concepto 55113. Sobre o referido a canastas de accionaria (Suma de los conceptos 55015 a 55026 menos 55106).
- Concepto 55114. Sobre o referidos a índices accionarios (Suma de los conceptos 55028 a 55039 menos 55107).

- Concepto 55115. Con Certificados Bursátiles que otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Suma de los conceptos 55042 a 55045 menos 55108).

- Concepto 55116. Con Certificados Bursátiles que NO otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Suma de los conceptos 55047 a 55050 menos 55109).

Concepto 55117: Posición Total Corta

Suma de las posiciones pasivas por cada acción conforme al inciso b) fracción II del Art. 2 Bis 109 de la "CUB".

- Concepto 55118. Con acciones o sobre acciones (Suma de los conceptos 55054 a 55064 menos 55105).

- Concepto 55119. Sobre o referido a canastas de accionaria (Suma de los conceptos 55066 a 55077 menos 55106).

- Concepto 55120. Sobre o referidos a índices accionarios (Suma de los conceptos 55079 a 55089 menos 55107).

- Concepto 55121. Con Certificados Bursátiles que otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Suma de los conceptos 55093 a 55096 menos 55108).

- Concepto 55122. Con Certificados Bursátiles que NO otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Suma de los conceptos 55098 a 55101 menos 55109).

Concepto 55123: Posición Neta del Portafolio

Suma algebraica de las posiciones netas de las acciones conforme al inciso c) fracción II del Art. 2 Bis 109 de la "CUB".

- Concepto 55124. Con acciones o sobre acciones (Concepto 55112 menos concepto 55118).

- Concepto 55125. Sobre o referido a canastas de accionaria (Concepto 55113 menos concepto 55119).

- Concepto 55126. Sobre o referidos a índices accionarios (Concepto 55114 menos concepto 55120).

- Concepto 55127. Con Certificados Bursátiles que otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Concepto 55115 menos concepto 55121).

- Concepto 55128. Con Certificados Bursátiles que NO otorgan créditos o inviertan en financiamientos (Concepto 55116 menos concepto 55122).

Concepto 55141: Operaciones con "Oro" o con rendimiento referido a éste.

Se determinará la posición neta corta (negativa) o neta larga (positiva) para el total de las operaciones conforme al Art. 2 Bis 108 de la "CUB".

- Concepto 55142. Posición neta larga en oro.

- Concepto 55143. Posición neta corta en oro.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Secciones 6A, 6B Y 6C

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC06 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO (CONTRAPARTE, AJUSTE POR VALUACIÓN CREDITICIA Y EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO EN CÁMARAS DE COMPENSACIÓN)

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC06

Esta sección con tres apartados tiene como objetivo:

-Obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito (contraparte) en las operaciones de compra-venta fecha valor de títulos de deuda y/o divisas, reporto, préstamo de valores, intercambio de flujos de dinero (swap), contratos adelantados, opciones y títulos opcionales (warrants) adquiridas tanto de compra como de venta, incumplimientos bajo mecanismos de libre entrega y otras operaciones sujetas a riesgo de la contraparte.

-Obtener la información conforme a la CUB para calcular el requerimiento de capital por ajuste al valor crediticio de las operaciones derivadas.

-Obtener la información conforme a la CUB para calcular el requerimiento de capital por exposición al fondo de incumplimiento en cámaras de compensación por su participación en el mercado de derivados.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC06 A

En esta sección deberán incluirse todas las operaciones (compras-ventas fecha valor de títulos de deuda y/o divisas, reportos, swaps, contratos adelantados, derivados de rendimiento total, etc.) vigentes de la institución, incumplimientos bajo mecanismos de libre entrega, así como, según lo señalado en la Circular Única de Bancos (CUB), del "Fondo de Reservas para Pensiones, Jubilaciones y demás Prestaciones del Personal", de la Institución, en caso que éste sea de "Beneficios Definidos".

En esta sección NO deberán incluirse

- Las operaciones de compra-venta al contado de metales preciosos (liquidables fecha valor 24, 48, 72 o 96 horas, según se trate).
- Las operaciones concertadas con personas relacionadas que establece el art. 73, 73 Bis y 73 Bis I de la L.I.C.

III. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC06 B Y C

En esta sección deben incluirse todas las operaciones activas y pasivas en las cuales mantenga una exposición a riesgo por contraparte, en derivados con requerimiento por ajuste de valuación crediticia y por exposición al fondo de incumplimiento en las cámaras de compensación.

Deben incluir también las operaciones realizadas por el "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", en caso que este fondo sea de "beneficios definidos", identificándolas en el campo "Clase de Operación" con la clave correspondiente.

Las operaciones registradas en el apartado A de esta sección no deben incluirse en otras secciones de riesgo de crédito (RC07, RC08, RC15).

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN RC6

La sección RC06 está conformada por tres apartados como se muestra en la sección de "Estructuras".

En el caso que no aplique registro en alguna de las columnas de los distintos apartados, deben reportarse con el valor que por defecto se defina.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate conforme a lo siguiente: los campos relativos a plazos deberán expresarse en años; los relativos a montos, deberán reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

IV. REGISTROS A INFORMAR EN LA SECCIÓN RC06

Las operaciones que reporte la Institución relativas a sus agencias y sucursales en el exterior, deben clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubieren sido celebradas por una oficina en México.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

APARTADO A RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR CONTRAPARTE

Cada uno de los registros informados en esta sección corresponde a la agrupación de operaciones con una misma contraparte, clase y rango del plazo remanente. La unicidad del registro está definida por los siguientes "campos llave": Institución, Fecha de Corte, Contraparte, Clase, Plazo remanente, Tipo de mercado, Identificador Interno de la Operación, Identificador Interno del contrato de compensación de operaciones con la misma contraparte, Grado de Riesgo, es decir, en el registro deberán agrupar las operaciones que cuenten con las mismas características.

INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DEL "APARTADO A" DE LA SECCIÓN RC06

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información

En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información

En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave de la contraparte

En este campo debe informar la clave de la contraparte de la operación asignada por Banco de México en el Catálogo General de Contrapartes (CGC).

Campo 4: Tipo de mercado

En este campo debe reportar el tipo de mercado en el que se ha negociado la operación, al efecto deben reportar la clave asociada al mercado que corresponda.
Tratándose de operaciones diferentes a las derivadas, deben reportar el valor "10"

Clave	Descripción
10	No aplica
20	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
30	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación establecida en el exterior, reconocida por Banco de México o estén establecidas en países cuyas autoridades financieras son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
40	Derivados negociados en Bolsa, Sociedades de administración de sistemas autorizadas cuya cámara de compensación no está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
50	Derivados negociados en Bolsa Extranjeras e Instituciones del Exterior cuya cámara de compensación está establecida en países cuyas autoridades financieras no son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
60	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, sin protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.
70	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, con protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.
80	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo III no comprendidas en la clave 60 y 70
90	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo VII_A no comprendidas en la clave 60 y 70
100	Derivados negociados en mercados no reconocidos clasificados como grupo VII_A no comprendidas en las claves 60 y 90

Campo 5: Identificador de la operación

La institución debe generar y reportar un identificador que corresponda a la agrupación de las operaciones con la misma contraparte con base en los "campos llave", considerando el reportar en registros diferentes las agrupaciones de operaciones que resulten con importe positivo, de las que no.

En el caso de incumplimientos bajo mecanismos de libre entrega, en este campo deben reportar el valor "1".

Campo 6: Identificador del contrato de compensación

La institución debe reportar una clave interna (diferente a los valores por defecto) que identifique el contrato marco bajo el cual se acordó la compensación de varias operaciones derivadas con la misma contraparte, por lo cual la clave puede repetirse en dos o más registros si cumplen dicho supuesto.

En el caso de que la operación (derivados, valores, créditos etc.) no cuente con acuerdo de compensación deben reportar el valor "1".

Campo 7: Grupo de riesgo

En este campo debe reportarse la clave correspondiente a la combinación grupo, ponderador y conversión de riesgo crédito al que pertenezca el acreditado/acreditada, la entidad emisora o la contraparte de la operación de que se trate, de acuerdo al siguiente catálogo:

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
40	Operaciones del Grupo 1-A cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 0%	I_A	0.00%
41	Operaciones del Grupo 1-A cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 10%	I_A	10.00%
42	Operaciones del Grupo 1-A cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	I_A	20.00%
127	Operaciones del Grupo 1 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 2%	I_B	2.00%
128	Operaciones del Grupo 1 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 4%	I_B	4.00%
43	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 0%	II	0.00%
44	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 10%	II	10.00%
45	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	II	20.00%
46	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	II	50.00%

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
47	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	II	100.00%
48	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	II	120.00%
49	Operaciones del Grupo 2 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	II	150.00%
51	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 0%	III	0.00%
55	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20 %	III	20.00%
57	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50 %	III	50.00%
59	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100 %	III	100.00%
61	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120 %	III	120.00%
63	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150 %	III	150.00%
19	Operaciones del Grupo 4 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 0%	IV_0	0.00%
67	Operaciones del Grupo 4 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	IV_20	20.00%
24	Operaciones sin importe positivo Grupo 5	V	0.00%
68	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 10%	V	10.00%
69	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	V	20.00%
70	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	V	50.00%
71	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%	V	115.00%
72	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	V	150.00%
167	Operaciones del Grupo 5 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es del 0%	V	0.00%
79	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 0%	VII_A	0.00%
80	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VII_A	20.00%
82	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VII_A	50.00%
84	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	VII_A	100.00%
86	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	VII_A	120.00%
88	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	VII_A	150.00%
123	Operaciones del Grupo 10 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es del 1250%	X	1250.00%

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
166	Operaciones del Grupo 10 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es del 100%	X	100.00%

Campo 8: Plazo de la calificación de la contraparte

En este campo debe reportarse la clave del plazo de la calificación que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de que se trate, conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	Nombre corto
10	No aplica plazo de calificación	NPC
20	Largo plazo escala local	LPL
21	Corto plazo escala local	CPL
30	Largo plazo escala global	LPG
31	Corto plazo escala global	CPG

Este campo debe reportarse con valor 10 cuando se trate de un grupo de riesgo cuyo ponderador no esté determinado por el anexo 1-B, por ejemplo: I-A, IV, V, VII-B, IX, X.

Campo 9: Clase de la operación

En este campo debe reportarse la clasificación que corresponda a las operaciones de que se trate, de acuerdo al catálogo de clases de operaciones que se ubica en el anexo.

Campo 10: Plazo remanente de la operación

Deben reportar el código que corresponda al plazo remanente de la operación conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
0	No aplica al tipo de operación
1	Menor o igual a un año
2	Mayor a un año y menor o igual a 5 años
3	Más de cinco años

En el caso que no se trate de operación derivada, deben reportar este campo con valor igual a "0"

Campo 11: Coeficiente de cargo por riesgo

Deben reportar el código que corresponda al coeficiente en función del subyacente y plazo de las operaciones conforme al catálogo del anexo 1_L de la CUB. De tratarse de incumplimientos u operaciones de mercado de dinero deberán reportar este campo con el valor igual a "1".

Clave	Descripción	Ponderador
1	Un año o menos Tasa de Interés	0.0%
2	Un año o menos Divisas y Oro	1.0%
3	Un año o menos Acciones e índices accionarios	6.0%
4	Un año o menos Metales Preciosos	7.0%
5	Un año o menos Otros	10.0%
6	De uno a cinco años Tasa de Interés	0.5%
7	De uno a cinco años Divisas y Oro	5.0%
8	De uno a cinco años Acciones e índices accionarios	8.0%
9	De uno a cinco años Metales Preciosos	7.0%
10	De uno a cinco años Otros	12.0%
11	Más de cinco años Tasa de Interés	1.5%
12	Más de cinco años Divisas y Oro	7.5%
13	Más de cinco años Acciones e índices accionarios	10.0%
14	Más de cinco años Metales Preciosos	8.0%
15	Más de cinco años Otros	15.0%

Campo 12: Monto nocional efectivo

Tratándose de operaciones derivadas deben reportar el monto nocional efectivo no el aparente.

- En operaciones en las que sea posible tener múltiples montos nocionales, según la evolución de las condiciones de mercado, se deberá obtener el monto nocional para cada combinación o estado de la naturaleza y utilizar el mayor monto nocional así obtenido.

- Cuando el monto nocional sea una función de variables de mercado, deberá utilizarse el monto nocional obtenido con los valores que se tengan de dichas variables al momento de la valuación.

- Para derivados con revisión programada del monto nocional, ya sea por amortizaciones o incrementos del mismo, deberá utilizarse el monto nocional promedio sobre el plazo remanente de la operación.

En cualquier caso el monto nocional efectivo, deberá producir niveles para la exposición potencial futura que sean acordes con el nivel de riesgo de la operación.

Campo 13: Valor razonable de la parte activa
Conforme a la valuación definida en los criterios contables, deben reportar en este campo la suma de los importes de la parte activa del registro tales como: los flujos activos saldo deudor de la opción de reporto (reportador), el valor del colateral otorgado (reportado), de los títulos objeto de la operación de préstamos (prestamista) o el valor del colateral otorgado (prestatario).

Tratándose de opciones o títulos opcionales deberán registrar el precio de valuación de la operación cuando esta resulte positiva.

Campo 14: Valor razonable de la parte pasiva
Conforme a la valuación definida en los criterios contables, deben reportar en este campo la suma de los importes de la parte pasiva del registro tales como: los flujos pasivos, colateral recibido (reportador), el saldo acreedor del reporto (reportado), el valor del colateral recibido (prestamista) o el valor de los títulos objeto del préstamo (prestatario).

Tratándose de opciones o títulos opcionales deberán registrar el precio de valuación de la operación cuando esta resulte negativa.

Campo 15: Clave o folio para identificar la garantía
Se deberá anotar una clave o folio de identificación para el contrato individual de garantía, independientemente si dicho contrato considera un sólo activo o un conjunto de éstos (portafolio). Asimismo, dicho contrato podría estar asociado a una determinada operación derivada, o a un conjunto de dichas operaciones. En operaciones derivadas en caso de no contar con garantía asociada se anotará un valor por defecto de "1" o bien tratándose de otras operaciones el valor "10".

Campo 16: Importe de las garantías valuadas bajo método simple
Importe calculado conforme a los criterios contables y ajustados a través del método simple de las garantías reales admisibles que la institución haya recibido para mitigar su exposición a riesgo de crédito y que cumpla lo establecido en el anexo 24 de la CUB.

Tratándose de operaciones derivadas y en el caso de que la garantía cubra un conjunto de clases de operaciones, deberán anotar el importe total en cualquier registro (pero solo en una) del conjunto de operaciones que cuenten con una misma clave en el campo 6.

Campo 17: Importe de las garantías valuadas bajo método integral
Importe calculado conforme a los criterios contables y ajustados a través del método integral de las garantías reales admisibles que la institución haya recibido para mitigar su exposición a riesgo de crédito conforme al artículo 2 bis 37 y que cumpla lo establecido en el anexo 24 de la CUB.

En el caso de las operaciones de reportos y préstamos de valores que estén sujetas a un contrato marco que contenga una cláusula que permita extinguir por compensación todas las operaciones deben registrar la suma del valor contable de la garantía real financiera (Ci) contemplada en el marco correspondiente.

Es decir

$$\sum_{i=1}^{n} Ci$$

Tratándose de operaciones distintas a las señalas en el párrafo anterior deben registrar la suma del valor contable de las garantías reales financieras (Ci) que cubren la operación ajustado por el factor Hc y Hfx que señala el mismo artículo 2 bis 37.

Es decir $\sum_{i=1}^{n} Ci * (1 - Hc - Hfx)$

Tratándose de operaciones derivadas y en el caso de que la garantía cubra un conjunto de clases de operaciones, deberán anotar el importe total en cualquier registro (pero solo en uno) del conjunto de operaciones que cuenten con una misma clave en el campo 6.

Campo 18: Monto del importe positivo

Tratándose de operaciones en las que empleen el método simple para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras, deben reportar la diferencia entre el valor activo y pasivo del registro cuando éste resulte con signo positivo.

Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras y se trate de operaciones de reportos y préstamos de valores sujetas a un contrato marco que contenga una cláusula que permita extinguir por compensación todas las operaciones, deben registrar la exposición ajustada obtenida como la suma de las exposiciones positivas de todas las operaciones con la contraparte que se trate $(\sum EI)$, más la suma de las posiciones netas en un mismo título utilizado como colateral en alguna de las operaciones que estén sujetas al contrato marco correspondiente considerando el factor de ajuste He $(\sum Es * He)$, más la suma de las posiciones netas al amparo del contrato marco que estén denominadas en una misma moneda distinta a la de la liquidación, ponderada por Hfx $(\sum Efx * Hfx)$.

$$\sum EI + \sum Es * He + \sum Efx * Hfx$$

Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras distintas a las del párrafo anterior, deben reportar el importe positivo de las operaciones antes del reconocimiento de garantías multiplicada por uno más el factor de ajuste para el importe de la operación de que se trate, conforme al anexo 1-F de la CUB.

Es decir $\sum_{i=1}^{n} Ei * (1 + He)$

Campo 19: Monto del importe no positivo

Tratándose de operaciones en las que empleen el método simple para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras, deben reportar el valor absoluto de la diferencia entre el valor activo y pasivo del registro cuando éste resulte con signo negativo

Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras y se trate de operaciones de reportos y préstamos de valores sujetas a un contrato marco que contenga una cláusula que permita extinguir por compensación todas las operaciones, deben registrar la exposición ajustada obtenida como la suma de las exposiciones negativas de todas las operaciones con la contraparte que se trate $(\sum EI)$, más la suma de las posiciones netas en un mismo título utilizado como colateral en alguna de las operaciones que estén sujetas al contrato marco correspondiente considerando el factor de ajuste He $(\sum Es * He)$, más la suma de las posiciones netas al amparo del contrato marco que estén denominadas en una misma moneda distinta a la de la liquidación, ponderada por Hfx $(\sum Efx * Hfx)$.

$$\sum EI + \sum Es * He + \sum Efx * Hfx$$

Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras distintas a las del párrafo anterior, deben reportar el importe negativo de las operaciones antes del reconocimiento de garantías multiplicada por uno más el factor de ajuste para el importe de la operación de que se trate, conforme al anexo 1-F de la CUB.

Es decir $\sum_{i=1}^{n} Ei * (1 + He)$

Campo 20: Valor añadido

Tratándose de operaciones derivadas deben reportar el importe del valor añadido bruto, calculado conforme al anexo 1_L de la CUB. En cualquier otro caso el valor por defecto es cero.

RC06 B REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA

Cada uno de los registros informados en esta sección corresponderán a la agrupación de operaciones derivadas con una misma contraparte, lo reportado en este apartado se validará con lo informado en el APARTADO A de esta sección.

Las operaciones celebradas con el grupo I-B conforme al artículo 2 bis 12 no deben reportarse en este apartado.

INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DEL "APARTADO B" DE LA SECCIÓN RC06

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información

En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información

En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave de la contraparte

En este campo debe informar la clave de la contraparte de la operación asignada por Banco de México en el Catálogo General de Contrapartes (CGC).
Las claves de contraparte se validarán contra lo reportado en el "APARTADO A".

Campo 4: Grado de riesgo de la contraparte

Deben reportar en este campo el grado de riesgo conforme a la calificación de la contraparte de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB, al efecto deben reportar la clave asociada al grado que corresponda.

La clave enviada en este campo se utilizará para obtener el ponderador aplicable por ajuste de valuación crediticia en el cómputo de capitalización.

Clave	Descripción	Ponderador por ajuste de valuación crediticia.
10	Sin Grado de Riesgo por no ser Calificado	2.0 %
11	Grado de Riesgo 1	0.7%
12	Grado de Riesgo 2	0.8%
13	Grado de Riesgo 3	1.0%
14	Grado de Riesgo 4	2.0%
15	Grado de Riesgo 5	3.0%
16	Grado de Riesgo 6	10.0%
17	Operaciones a cargo de Banco de México	0.0%

Campo 5: Ponderador del índice

En este campo deben reportar el ponderador de riesgo de crédito asociado a coberturas mediante derivados de incumplimiento crediticio suscritos sobre índices o canastas de entidades de referencia, el cual se obtendrá como el promedio ponderado de los ponderadores de cada entidad incluida en el conjunto o índice de referencia (considerando los ponderadores del catálogo anterior).
Para el promedio ponderador deben utilizar la representatividad de cada entidad incluida en el conjunto o índice de referencia.

Campo 6: Monto de la exposición al incumplimiento neta de la contraparte
En este campo deben reportar el importe de la exposición al incumplimiento descontada para la contraparte de conformidad con la siguiente expresión.

$$EID_i^{total} = \left(\frac{1-e^{-0.05\times M_i}}{0.05\times M_i}\right) \times EI_i^{total},$$

Donde
EI_i^{total} Corresponde al valor de conversión a riesgo de crédito con la contraparte, según lo establecido en el Anexo 1-L de la CUB. Este dato se validará por Banco de México con base en la información que reporten en el "Apartado A".

Campo 7: Monto nocional de las coberturas individuales
En este campo deben reportar el monto nocional de las coberturas individuales con la contraparte.

Campo 8: Monto nocional de las coberturas mediante derivados de incumplimiento
En este campo deben reportar el monto nocional descontado de las coberturas obtenidas mediante derivados de incumplimiento crediticio, suscrito sobre índices o canastas de entidades de referencia.

$$ND_{indice} = \left(\frac{1-e^{-0.05\times M_{indice}}}{0.05\times M_{indice}}\right) \times N_{indice}.$$

Campo 9: Plazo efectivo de las operaciones con la contraparte
En este campo deben reportar el plazo efectivo de las operaciones con la contraparte.
El plazo efectivo corresponde al promedio ponderado del plazo efectivo o de vencimiento de las operaciones con la contraparte, se debe considerar como ponderador el monto nocional de cada operación.

El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

Campo 10: Plazo efectivo de las coberturas individuales
En este campo deben reportar el plazo efectivo de coberturas individuales con la contraparte.

El plazo efectivo de coberturas individuales corresponde al promedio ponderado de los plazos efectivos o de vencimiento de las coberturas de riesgo que la institución tenga contratadas para recudir su riesgo ante el incumplimiento de la contraparte mediante derivados de crédito suscritos sobre una sola entidad de referencia, se debe considerar como ponderador el monto nocional de las coberturas individuales multiplicado por el siguiente factor.

$$\left(\frac{1-e^{-0.05\times M_i^{Cob}}}{0.05\times M_i^{Cob}}\right)$$

El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

Campo 11: Plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento

En este campo deben reportar el plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento de crédito suscritos sobre índices o canastas de entidades de referencia.

El plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento corresponde al plazo efectivo o de vencimiento de la contraparte mediante derivados de incumplimiento crediticio suscritos sobre un conjunto de entidades de referencia, se debe considerar como ponderador el monto nocional de las coberturas grupales multiplicado por el factor siguiente

$$\left(\frac{1-e^{-0.05\times M_{Indice}}}{0.05\times M_{indice}}\right)$$

El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

USO LIMITADO

RC06 C EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO EN CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DE LOS PARTICIPATNES EN EL MERCADO DE DERIVADOS.

La información enviada en este formulario corresponderá a las aportaciones realizadas a la cámara de compensación de operaciones derivadas e información que las cámaras de compensación les darán a conocer trimestralmente.

INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DEL "APARTADO C" DE LA SECCIÓN RC06

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información

En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información

En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Tipo de cámara de compensación

En este campo debe reportar el tipo de cámara de compensación del mercado en el que se ha negociado la operación, al efecto deben reportar la clave asociada al mercado que corresponda, donde, se debe de reportar tomando en consideración si se trata de una posición propia o por cuenta del cliente.

Clave	Descripción
10	No aplica
20	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
30	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación establecida en el exterior, reconocida por Banco de México o estén establecidas en países cuyas autoridades financieras son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
40	Derivados negociados en Bolsa, Sociedades de administración de sistemas autorizadas cuya cámara de compensación no está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
50	Derivados negociados en Bolsa Extranjeras e Instituciones del Exterior cuya cámara de compensación está establecida en países cuyas autoridades financieras no son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
60	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, sin protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.
70	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, con protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.
80	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo III no comprendidas en la clave 60 y 70
90	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo VII_A no comprendidas en la clave 60 y 70
100	Derivados negociados en mercados no reconocidos clasificados como grupo VII_A no comprendidas en las claves 60 y 90

Campo 4: Clave de la contraparte

En este campo debe informar la clave de la cámara de compensación de acuerdo a la asignación por Banco de México en el Catálogo General de Contrapartes (CGC).

Campo 5: Metodología autorizada para el cálculo del requerimiento por exposición a fondos de incumplimiento.

En este campo deben reportar el método que están aplicando para determinar el requerimiento de capital, al efecto deben reportar la clave conforme al catálogo siguiente:

Clave	Descripción	Método aplicable al RC06C 2022
10	Método conforme al 4to párrafo del artículo 2 bis 98 e	☑
20	Método conforme al artículo 2 bis 98 f (aplica sólo hasta 31 de mayo 2022)	NA
30	Método conforme al artículo 2 bis 98 g	☑

Campo 6: Monto de la aportación realizada por el socio liquidador

En este campo deben reportar el monto de las aportaciones que haya realizado la institución para constituir el fondo de incumplimiento de una cámara de compensación.
Hasta 31/05/2022, si en el campo 5 reportaron la clave 30 y campo 15 es diferente a 3000, este campo debe ser reportado en cero.
A partir de 30/06/2022 este campo no podrá ser reportado en cero.

Campo 7: Valor de conversión

En este campo deben reportar el importe correspondiente al valor de conversión a riesgo de crédito de las posiciones que mantienen las instituciones con una cámara de compensación conforme al anexo 1-L de la CUB.

Este campo se valida contra lo reportado en el "APARTADO A".
Si en el campo 5 reportaron la clave 30, este campo debe ser reportado en cero.

Campo 8: Capital Teórico

En este campo deben reportar el valor del capital teórico o hipotético de la cámara de compensación por su exposición al riesgo de crédito frente a todos sus socios liquidadores.
Este dato debe ser publicado por la cámara de compensación.
Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.

Campo 9: Recursos totales del fondo (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)

En este campo deben reportar el monto de los recursos totales del Fondo de Incumplimientos con que dispone la cámara de compensación para mutualizar pérdidas. Bajo el supuesto de que dos socios liquidadores de tamaño promedio incumplen.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

Campo 10: Recursos propios de la cámara

En este campo deben reportar el monto de los recursos propios de la cámara de compensación para mutualizar pérdidas. Estos recursos estarán constituidos por el patrimonio de la cámara de compensación.
Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Campo 11: Recursos disponibles
En este campo deben reportar el monto de los recursos del Fondo de Incumplimientos disponibles de los socios liquidadores para mutualizar pérdidas. Estos recursos estarán constituidos por la suma de las aportaciones al fondo de incumplimientos de cada socio liquidador, así como por el patrimonio de cada socio liquidador, considerando el patrimonio mínimo y su excedente.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

Campo 12: Monto total de las aportaciones de los socios liquidadores (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)
En este campo deben reportar la suma de las aportaciones al Fondo de Incumplimiento de todos los socios liquidadores.
Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

Campo 13: Número de socios liquidadores (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)
En este campo deben reportar el número de socios liquidadores de la cámara de compensación.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

Campo 14: Beta de dos socios liquidadores (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)
En este campo deben reportar el índice Beta determinado de la siguiente forma:

β	=	$\frac{VA_{neto,1} + VA_{neto,2}}{\sum_{i=1}^{M} VA_{neto,i}}$ Donde los subíndices 1 y 2 de $VA_{neto,i}$ denotan los dos socios liquidadores con los Valores Añadidos netos mayores, calculados de igual forma que en la fracción I del presente artículo.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato o las variables que contenga la fórmula le será proporcionada al socio liquidador por la cámara de compensación.

Campo 15: Tipo de distribución del capital teórico (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)
En este campo deben reportar, según corresponda, la clave del tipo de distribución del capital teórico que está aplicando.
1000= por obligación del socio liquidador de realizar contribuciones al fondo de incumplimiento,
2000= por márgenes iniciales de cada socio liquidador

Esta información sólo debe informarse cuando no existan aportaciones en firme al Fondo de Incumplimiento.
3000= cuando la cámara de compensación cuenta con aportación en firme al fondo de incumplimiento.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.

Campo 16: Fracción asignada al socio liquidador (Campo aplicable hasta la fecha 31/05/2022)
En este campo deben reportar el valor de la fracción asignada al socio liquidador.

Si el campo 15 es igual a 1000 entonces el valor corresponde a la distribución del capital teórico según la obligación del socio liquidador de realizar contribuciones al Fondo de Incumplimiento a las que se hubiera comprometido previamente.

Si el campo 15 es igual a 2000 entonces el valor será proporcional a las aportaciones por márgenes iniciales de cada socio liquidador.

Este campo debe reportarse en cero si el campo 5 contiene un valor diferente a 30.
Este dato le será proporcionado al socio liquidador por la cámara de compensación.

USO LIMITADO

Contenido

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 07

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC07 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO (DE LA ENTIDAD ENTIDAD EMISORA) POR POSICIONES EN TÍTULOS DE DEUDA

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC07

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito (entidad emisora) bajo método estándar en las posiciones de títulos de deuda derivadas de: la tenencia; compras y ventas pendientes de liquidar; reportos; préstamos de valores; futuros, contratos adelantados y opciones sobre títulos de deuda con entrega del subyacente, y títulos en garantía con transferencia de propiedad, cedidos y recibidos; vigentes al día último del mes de que se trate. Incluye todos los títulos de deuda, independientemente de la moneda o de la tasa de rendimiento, salvo lo señalado en la "instrucción II" siguiente.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC07

En esta sección deben incluirse los valores, cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Institución. Incluyendo aquellas a cargo de fideicomisos.

Según lo señalado en la "CUB", en esta sección deben incluirse las inversiones y operaciones del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", relativas a títulos de deuda, cuando el fondo de pensiones de la Institución sea de "beneficios definidos". Éstas deben incluirse en el apartado VI de la sección.

En esta sección NO deben incluirse:

- La tenencia de títulos emitidos por la propia Institución.
- Los títulos emitidos por la propia institución, pendientes de entregar por operaciones fecha valor.
- Las inversiones en obligaciones subordinadas de conversión obligatoria, no convertibles, y de conversión voluntaria a capital, emitidas por entidades financieras o fondos controladoras de grupos financieros; inversiones en cualquier "instrumento de deuda" cuyo pago por parte de la entidad emisora o deudor, según se trate, esté previsto que se efectúe, por haberlo así convenido, después de cubrir otros pasivos, así como en títulos subordinados relativos a esquemas de bursatilización.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- Los valores emitidos por el Gobierno Federal, de conformidad con los programas de apoyo crediticio (UDIS y ADE), ya que tales financiamientos, para cuantificar el riesgo de crédito, deben incluirse en la sección RC08.
- Los "Pagarés del Nuevo Programa (Nota A) a cargo del Fondo de Protección al Ahorro (FOBAPROA), y/o a cargo del Instituto de Protección al Ahorro Bancario (IPAB), ni la cartera de créditos afecta a fideicomisos, cuyos derechos correspondan a la Institución, relativa a los acuerdos del nuevo programa con el IPAB (NOTA B), ya que tales financiamientos, para cuantificar el riesgo de crédito, deben incluirse en la sección RC08.
- Los títulos emitidos por personas relacionadas que establece el art. 73, 73 Bis y 73 Bis I de la L.I.C.

CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC07

La sección RC07 está conformada por los conceptos 70000 a 79962, con dos columnas en donde deben reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la institución, tanto de las oficinas en México, como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Posiciones en títulos - por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión) - derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, las posiciones en títulos - por su inversión en el "capital variable" de fondos de inversión, bajo cualquier modalidad de participación - derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

La columna 2 debe reportarse considerando las diversas posiciones en títulos de deuda de que esté conformado el portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma.

Sin perjuicio de lo señalado en el punto 3 de la "instrucción VI", los valores adquiridos por los fondos de inversión mediante operaciones de reporto, se considerarán como inversiones que deben clasificarse en los conceptos relativos a la tasa de interés y contraparte de las correspondientes operaciones de reporto, en lugar de las características de los valores de que se trate.

IV. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR

Tratándose de entidades financieras filiales del exterior, en el reporte de cada una de éstas (adicional al de la Institución): sus operaciones directas deben reportarlas en la columna 1; las inversiones realizadas indirectamente a través de "fondos de inversión",

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

deben reportarlas en la columna 2. Asimismo, la moneda nacional serán los pesos mexicanos y la moneda extranjera cualquier moneda distinta de dichos pesos, inclusive la del país donde resida la entidad financiera del exterior de que se trate.

V. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC07

En esta sección se solicita la suma de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo las compensaciones, en su caso, deben realizarse operación por operación.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deben reportarse con saldos al día último del mes de que se trate, en miles de pesos. Al efecto, los títulos denominados en UDIS o en moneda extranjera, deben valorizarse al "valor en pesos de la UDI" del día último del mes o al "tipo de cambio peso-dólar", aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión.

Los títulos deben reportarse conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores) los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas.

VI. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC07

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, deben considerarse:

1. La moneda de denominación, la tasa de rendimiento de referencia del título de deuda o el tipo de título (en moneda nacional con tasa de interés nominal; en unidades de inversión con tasa de interés real; en divisas con tasa de interés; con otro rendimiento; títulos con vinculación crediticia; o títulos relativos a las inversiones del "fondo de reservas para pensiones del personal").
2. El grupo al que pertenezca la entidad emisora del título y en el caso de títulos con vinculación crediticia al grupo que corresponda el deudor del activo de referencia, de los señalados en el Art. 2 Bis 11 de la CUB.
3. La posición (larga, corta y/o larga y corta en el mismo título) de la Institución en el título de deuda, conforme a la siguiente instrucción.
4. El grado de riesgo correspondiente al título de deuda, determinado conforme a su calificación y plazo.
5. El ponderador aplicable conforme a la escala Local o Global de la calificación otorgada al título de deuda.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VII. POSICIONES BRUTAS LARGAS, BRUTAS CORTAS Y LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TÍTULO

Las posiciones brutas largas, brutas cortas así como los importes de las posiciones largas y cortas en el mismo título deben calcularse conforme a lo siguiente.

Posiciones Brutas Largas

Para determinar este concepto se sumarán los importes de los títulos de deuda que impliquen una posición activa por cualquier operación

Posiciones Brutas Cortas

Para determinar este concepto se sumarán los importes de los títulos de deuda que impliquen una posición pasiva por cualquier operación.

Largas y Cortas en el Mismo Título

Estos conceptos se refieren a la suma de los títulos idénticos que se tengan como posición larga y como posición corta, sin importar de qué operación proviene una y otra posición. Se consideran títulos idénticos cuando la posición larga y la posición corta tengan la misma "clave de emisión"; es decir, que los títulos en cuestión sean idénticos en cuanto a tipo de instrumento, entidad emisora, fecha de vencimiento, tipo de cupón y fecha de revisión del cupón.

Ejemplo:

Título	**Posición Bruta Larga a reportar**	**Posición Bruta Corta a reportar**	**Larga y corta en el mismo título**
A	200	50	50
B	50	150	50
C	80	60	60
D	60	120	60
Cifras a reportar en la Sección RC07	**390**	**380**	**220**

Las operaciones activas y/o pasivas a considerar son:

Activas

- Tenencia propia (incluye los derechos de propiedad, correspondientes a la Institución, de los títulos de deuda cedidos en garantía, así como los valores adjudicados).
- Compras pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, y otras operaciones pendientes de liquidar.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- Reportos, actuando como reportador (títulos a recibir por operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

  Este rubro NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto.

- Reportos, actuando como reportado (títulos a recibir cedidos en reporto). Incluye todas las operaciones, inclusive las ya pactadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, en este último caso como si los títulos ya se hubieren entregado.

  Este rubro NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto.

- Préstamos, actuando como prestatario (títulos a recibir por operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

- Préstamos, actuando como prestamista (títulos a recibir cedidos en préstamo). Incluye todas las operaciones, inclusive las ya pactadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, en este último caso como si los títulos ya se hubieren entregado.

- Futuros y contratos adelantados de compra en los que el activo subyacente sean títulos de deuda con liquidación física. El valor de la posición corresponderá al valor razonable de los Títulos Subyacentes que ampara la operación.

- Emisión de opciones de venta, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones "dentro del dinero", cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas. El monto de la posición se determinará aplicando la "delta" de la opción.

- Tenencia de opciones de compra, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones "dentro del dinero", cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas.

  Queda a elección de la Institución el incluir o no aquellas operaciones "tipo americano" "dentro del dinero" cuyo plazo de ejercicio, respecto al citado día último, sea superior a las mencionadas 96 horas. El monto de la posición se determinará aplicando la "delta" de la opción.

- Títulos otorgados en garantía, cedidos por la Institución con transferencia de propiedad.

Pasivas

- Ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, y otras operaciones pendientes de liquidar, correspondientes a valores distintos a los emitidos por la propia Institución.

- Reportos, actuando como reportado (títulos a entregar por operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

  Este rubro NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad

del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto.

- Reportos, actuando como reportador (títulos a entregar tomados en reporto). Incluye todas las operaciones, inclusive las ya pactadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, en este último caso como si los títulos ya se hubieren recibido.

  Este rubro NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto.

- Préstamos, actuando como prestamista (títulos a entregar por operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

- Préstamos, actuando como prestatario (títulos a entregar tomados en préstamo). Incluye todas las operaciones, inclusive las ya pactadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, en este último caso como si los títulos ya se hubieren recibido.

- Futuros y contratos adelantados, de venta en los que el activo subyacente sean títulos de deuda con liquidación física. El valor de la posición corresponderá al valor razonable de los Títulos Subyacentes que ampara la operación.

- Emisión de opciones de compra, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones "dentro del dinero", cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas. El monto de la posición se determinará aplicando la "delta" de la opción.

- Tenencia de opciones de venta, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones "dentro del dinero", cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas.

  Queda a elección de la Institución el incluir o no aquellas operaciones "tipo americano" "dentro del dinero" cuyo plazo de ejercicio, respecto al citado día último, sea superior a las mencionadas 96 horas. El monto de la posición se determinará aplicando la "delta" de la opción.

- Títulos recibidos en garantía, cedidos a la Institución con transferencia de propiedad.

VIII.GRADOS Y GRUPOS DE RIESGO

Los grados de riesgo a que se refieren los conceptos del formulario corresponden los señalados en el Anexo 1-B de la CUB y deben determinarse considerando, en su caso, las calificaciones otorgadas por las Instituciones Calificadoras.

La institución para determinar su requerimiento de capital por riesgo de la entidad emisora conforme al método estándar, debe clasificar las operaciones en los grupos de riesgo a que corresponda la entidad emisora. En el caso de operaciones a cargo de fideicomisos, a partir del 5 de diciembre 2025 deberá apegarse al tratamiento establecido en la CUB para la clasificación en el grupo de riesgo considerando a partir de marzo 2026 los conceptos específicos para ello. Al efecto, los conceptos de esta sección se reportan considerando:

1.- El grupo al que pertenece la entidad emisora del Título de Deuda

- Grupo I-A
- Grupo II
- Grupo III
- Grupo IV
- Grupo V
- Grupo VII-A
- Grupo IX

2.- Y el ponderador aplicable conforme a la escala Local o Global de la calificación otorgada al título de deuda conforme el anexo 1-B de la CUB.

Tratándose de emisiones de Bolsas de derivados a las que hacen referencia los incisos a) y b) de la fracción I del artículo 2 Bis 12.a de la CUB que sean liquidadas en cámaras de compensación que no observen lo señalado en el segundo párrafo del citado artículo serán clasificadas en el Grupo III o Grupo VII, según corresponda.

X. CALIFICACIONES

Al utilizar las calificaciones para determinar los grados de riesgo deben observarse lo señalado en el Art. 2 Bis 23 de la CUB, relativo a Calificaciones Externas del Crédito.

Para efectos de ponderar las Operaciones señaladas en la fracción II del artículo 2 Bis 18 de la CUB se deberá utilizar la Calificación crediticia en escala global asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al gobierno central del país extranjero al cual pertenece la institución bancaria, casa de bolsa y sus equivalentes en el extranjero, con la cual se mantienen dichas operaciones.

En caso de no existir Calificación para la entidad emisora, contraparte o gobierno central del país extranjero de que se trate, la ponderación por riesgo de crédito será la indicada en el referido Anexo 1-B para Operaciones del Grupo VII no calificadas.

En ningún caso, el ponderador por riesgo que se asigne a las Operaciones no calificadas comprendidas en este grupo podrá ser inferior a la del gobierno central del país al que pertenezcan.

XI. GARANTÍAS REALES O PERSONALES (AVALES) RECIBIDOS

Conforme a lo señalado en el penúltimo párrafo del Art- 2 Bis 30 de la CUB, las técnicas de cobertura del riesgo de crédito no deben contabilizarse por duplicado, en consecuencia y considerando que las calificaciones otorgadas a los valores en general ya consideran las garantías reales o personales, el importe de los valores y su clasificación deben determinarse en base a las características de la entidad emisora del título, sin importar el grupo al que pertenezca el aval o garante del título, cuando éste exista.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

XII. MONTO A COMPUTAR

El monto a computar para determinar el requerimiento de capital bajo método estándar será equivalente a:

Posición Bruta Larga + Posición Bruta Corta– 2* Larga y corta en el mismo título

Contenido

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 08

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC08 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO POR DEPÓSITOS, PRÉSTAMOS, CRÉDITOS, OTROS ACTIVOS Y OPERACIONES CONTINGENTES

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC08

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito por depósitos, préstamos, créditos, otros activos y por operaciones contingentes. Incluyendo aquellas realizadas con fideicomisos.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC08

Los conceptos de esta sección RC08 se refieren exclusivamente a operaciones de la Institución. Por ningún motivo deben reportarse cifras que sean producto de la consolidación de estados financieros.

Los distintos conceptos, en su caso, deben incluir los correspondientes intereses, sumados al "principal".

En esta sección deben incluirse los depósitos, créditos y demás activos, cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Institución.

Esta sección NO incluye:

- Compra-venta al Contado de Valores: Ni los valores objeto de la operación, Ni su contravalor. Este tipo de operaciones se incluyen en la sección RC06A.
- Compra-venta al Contado de Divisas: Ni las divisas objeto de la operación, Ni su contravalor. Este tipo de operaciones se incluyen en la sección RC06A.

- Las inversiones en valores y sus correspondientes intereses, cupones, dividendos, etc. Este tipo de inversiones se incluyen en la sección RC07.
- Las inversiones en valores relativas al fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal. Este tipo de inversiones se incluyen en la sección RC07.
- Los "créditos subordinados", cuyo pago por parte del deudor esté previsto que se efectúe, por haberlo así convenido, después de cubrir otros pasivos. Este tipo de financiamientos se incluyen en la sección RC09 y/o en la sección RC10, tratándose de créditos subordinados provenientes de bursatilizaciones de activos.
- Las aportaciones para la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de otras entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de todas éstas (concepto 95300), así como los financiamientos cuyo destino directo o indirecto sea la adquisición de acciones de subsidiarias financieras de las entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución (concepto 95305). Este tipo de financiamientos se incluye en la sección RC09.
- Los descuentos de papel comercial con aval de la propia Institución.
- Los créditos simples y créditos en cuenta corriente a suscriptores de papel comercial con aval de la propia Institución.
- Las operaciones derivadas, reportos y préstamo de valores; ni los subyacentes, objeto de estas operaciones, ni sus correspondientes contravalores, premios, comisiones, cupones, etc.
- Los deudores por intereses devengados sobre inversiones en valores.
- La parte de los activos diferidos y pagos anticipados que se resten al determinar el Capital Fundamental, mismos que deben incluirse exclusivamente en la sección RC09.
- Los créditos, depósitos y otros activos concertados con personas relacionadas en términos de los artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley de Instituciones de Crédito (L. I. C.), los cuales deben incluirse exclusivamente en la sección RC15A.
- Los créditos nuevos o reestructurados que satisfacen el artículo 2 bis 17 de la CUB, los cuales deben incluirse exclusivamente en la sección RC08A o RC15A

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC08

La sección RC08 está conformada por los conceptos 80000 a 89901, con dos columnas, en donde deben reportarse la información en forma agregada, de las operaciones en moneda nacional, moneda extranjera y UDIS, tanto de las oficinas en México, como de las agencias y sucursales (oficinas) y en el exterior, así como aquellas realizadas con fideicomisos, estas últimas registrándolas exclusivamente en la columna de importe 2, considerando su clasificación contable.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC08

Las operaciones que reporte la Institución relativas a sus agencias y sucursales en el exterior, deben clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubieren sido celebradas por una oficina en México.

Las cifras de todos los conceptos, deben reportarse con saldos al día último del mes de que se trate valuada conforme a los criterios contables.

La información de esta sección debe reportarse en miles de pesos. Al efecto, las operaciones a que se refieren los conceptos deben valorizarse al "valor en pesos de la UDI" correspondiente al cierre del mes o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y De Valores (CNBV), según corresponda.

Según lo señalado en la Circular Única de Bancos (CUB), en esta sección deben incluirse en el concepto 89603, la tenencia de acciones que formen parte de las inversiones realizadas por el "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", cuando éste sea de "beneficios definidos".

En el caso de las inversiones en acciones, en esta sección se reportarán exclusivamente aquéllas que no se restan del Capital Fundamental.

V. ACLARACIONES DIVERSAS RELATIVAS A LA SECCIÓN RC08

Clasificación de las operaciones.

Las operaciones deben clasificarse conforme al grupo de riesgo crédito (de los señalados del Art. 2 Bis 11 al 2 Bis 21 de la CUB) al que pertenezca el acreditado/acreditada original, independientemente que dichas operaciones cuenten con garantías reales, personales, avales o alguna cobertura mediante derivados de crédito.

Saldo Insoluto.

En los conceptos relativos al Saldo Insoluto de los créditos, deben anotarse el importe relativo a la cartera de créditos o depósitos incluyendo, en su caso: el principal vigente, los intereses ordinarios devengados no cobrados y el refinanciamiento y capitalización de intereses. Asimismo, dicha cartera y depósitos deben reportarse brutos, sin restarle las correspondientes reservas preventivas, sin disminuir los avales recibidos y los importes de derivados de crédito. Para calcular el requerimiento de capital por riesgo crédito, al importe anterior le será disminuido el importe de la mitigación de riesgo crédito, conforme al método que corresponda (simple o integral).

Las cifras de otras partidas distintas a la cartera de créditos, según sea el caso, deben reportarse netas de los correspondientes castigos, depreciaciones y amortizaciones.

Garantías Reales Recibidas aplicando el Método Simple.

En estos conceptos deben anotarse el importe de las garantías reales admisibles que la institución haya recibido para disminuir su exposición a riesgo de crédito, a través del método simple, siempre y cuando:

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- La Institución cumpla con las Condiciones Generales establecidas en el Art. 2 Bis 30 de la CUB;
- La Institución observe los requisitos mínimos establecidos en el Art. 2 Bis 32 de la CUB;
- El instrumento que actúe como garantía real cumpla con los criterios de elegibilidad del Art. 2 Bis 33 de la CUB;
- El instrumento que actúe como garantía real cumpla con los requerimientos mínimos señalados en el Art. 2 Bis 34 de la CUB; y,
- La Institución cumpla con los Requerimientos del Anexo 24 de la CUB.

El importe de las garantías reales debe informarse en esta sección y en la sección 13 relativa al "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

Los títulos con vinculación crediticia financiados mediante efectivo que emitan las instituciones contra sus inversiones en valores, deben considerarse como garantías reales en efectivo.

En esta sección, el importe de las garantías reales debe clasificarse considerando el grupo de riesgo que corresponda al acreditado/ acreditada original de que se trate.

Importe ajustado de las Garantías Reales recibidas aplicando el Método Integral.

En estos conceptos deben anotarse el importe ajustado de las garantías reales recibidas, determinado conforme a lo establecido en el Art. 2 Bis 37 de la CUB, siempre y cuando:

- La Institución cumpla con las Condiciones Generales establecidas en el Art. 2 Bis 30 de la CUB;
- La Institución observe los requisitos mínimos establecidos en el Art. 2 Bis 32 de la CUB;
- El instrumento que actúe como garantía real, cumpla con los criterios de elegibilidad del Art. 2 Bis 33 de la CUB; y,
- La Institución cumpla con los Requerimientos del Anexo 24 de la CUB.

Los títulos con vinculación crediticia financiados mediante efectivo que emitan las instituciones contra sus inversiones en valores, deben incluirse en estos conceptos, cuyo tratamiento será como el de una garantía real en efectivo.

El importe de dichas garantías debe informarse en esta sección, y en la sección RC13 relativo a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

Monto Avalado.

En estos conceptos deben informase el monto de las garantías personales recibidas de cualquier persona, siempre y cuando:

- La Institución cumpla con las condiciones generales establecidas en el Art. 2 Bis 30 de la CUB;
- La garantía cumple con lo establecido en el Art. 2 bis 39 de la CUB, y en particular, con los requisitos señalados en el Art. 2 Bis 40 de la CUB;
- El garante es alguno de los incluidos en el Art. 2 Bis 44 de la CUB; y,
- La Institución cumpla con los Requerimientos del Anexo 24 de la "CUB".

El importe de dichas garantías debe informarse en esta sección y en la sección 13 relativa a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

En esta sección, el monto avalado debe clasificarse considerando el grupo de riesgo que corresponda al acreditado/ acreditada original de que se trate.

Importe del Ajuste por Derivados Crediticios recibidos.

En estos conceptos deben anotarse el importe ajustado de la cobertura comprada a través de derivados de incumplimiento crediticio o de derivados de rendimiento total, conforme a lo establecido en el Art. 2 Bis 39 de la CUB, siempre y cuando:

- La Institución cumpla con las Condiciones Generales establecidas en el Art. 2 Bis 30 de la CUB;
- El derivado de crédito cumpla con lo establecido en el Art. 2 Bis 39 de la CUB, y en particular, con los requisitos señalados en el Art. 2 Bis 41 de la CUB;
- El vendedor de protección es alguno de los incluidos en el Art. 2 Bis 44 de la CUB; y,
- La Institución cumpla con los Requerimientos del Anexo 24 de la CUB.

El importe de dichas coberturas debe informarse en esta sección y en la sección 13 relativa a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

En esta sección, el importe de la cobertura debe clasificarse considerando el grupo de riesgo que corresponda al activo de referencia de que se trate.

Reservas constituidas que no computen como capital complementario

En este concepto deben incluir la suma de las reservas que se encuentren constituidas al mes correspondiente al cómputo de capitalización para las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito, determinadas de conformidad con lo establecido en la Circular Única de Bancos que no computen como capital complementario.

Este importe se clasificará de acuerdo al grado de riesgo y escala correspondiente al grupo de riesgo crédito para el que fueron constituidas.

Compra de cartera

En la cartera de crédito adquirida a descuento CON responsabilidad del cedente, se considerará como persona acreditada, a la institución o entidad financiera cedente

(deudor); por lo tanto, dicha cartera se clasificará en el grupo de riesgo y etapa de crédito a que corresponda la Institución o entidad financiera cedente.

La cartera de crédito comprada a descuento SIN responsabilidad del cedente, se clasificará en el grupo de riesgo de crédito y etapa que corresponda al deudor de dicha cartera.

Cartera de Arrendamiento

La cartera de arrendamiento financiero debe reportarse neta de la respectiva "carga financiera por devengar en contratos de arrendamiento financiero".

Cartera de Crédito Reestructurada bajo los Programas de Apoyo a Deudores (Fideicomisos UDIS)

El importe que corresponda a la cartera de créditos reestructurados conforme a los programas de apoyo crediticio del Gobierno Federal (Fideicomisos UDIS), debe reportarse en los conceptos 80714 y 81106, según el tipo de acreditado/acreditada (Estados y/o municipios u Otros). El importe anterior debe incluir, de ser el caso, el principal vigente, los intereses ordinarios devengados no cobrados, el refinanciamiento y la capitalización de intereses. Asimismo, dicho importe debe reportarse bruto, sin restarle las correspondientes reservas preventivas.

Cartera de Créditos Vencida o etapa 3

En los conceptos en los que se solicita la Cartera de Créditos Vencida o etapa 3, debe informarse el saldo insoluto, el importe de las garantías, el monto avalado o el importe de las reservas, correspondientes a los créditos que se encuentren vencidos o etapa 3 registrándolas exclusivamente en la columna de importe 2 clasificando tales importes conforme a las características del acreditado/acreditada original. Al efectuar el cómputo de capital por riesgos de crédito, se determinará la parte no garantizada de los créditos en cartera vencida o etapa 3 restando al importe insoluto de los créditos la suma del importe de las garantías, de los avales y las reservas.

En caso de que el porcentaje de las reservas preventivas para riesgos crediticios, conforme a lo establecido en el Capítulo V del Título Segundo de la CUB, sea menor al 20% la ponderación por riesgo de crédito será de 150 por ciento

Otras Partidas de Activo e Inversiones Accionarias

No obstante que no están expuestos a riesgo de crédito, deben incluir en esta sección las inversiones en acciones de:

-Inversiones accionarias en empresas del art. 75 de la L. I. C.

-Activos fijos propios de la Institución; bienes Adjudicados, activos diferidos y los pagos anticipados que no se resten del Capital Fundamental.

Estas operaciones forman parte de los grupos del Art. 2 Bis 21., les aplica el ponderador de 100 por ciento o de 1,250 por ciento, según corresponda.

-Inversiones en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios o de desarrollo cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que no

cuenten con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes (ponderados a 1,250 por ciento).

VI. GRADOS Y GRUPOS DE RIESGO.

Los grados de riesgo a que se refieren los conceptos del formulario corresponden a los señalados en el Anexo 1-B de la CUB, y deben determinarse considerando, en su caso, las calificaciones otorgadas por las Instituciones Calificadoras y el grupo al que pertenece. En el caso de operaciones con fideicomisos, a partir del 5 de diciembre 2025 deberá apegarse al tratamiento establecido en la CUB para la clasificación en el grupo de riesgo.

Al efecto deberán considerar:

1. El grupo al que pertenece el acreditado/acreditada

   - Grupo I-A
   - Grupo II
   - Grupo III
   - Grupo IV
   - Grupo V
   - Grupo VI (A partir del 1 sep 2021 o la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición publicada el 20 de julio del 2021, solo créditos de este grupo que no cumplen las condiciones del artículo 2 bis 17 y a los cuales les seguirá aplicando los ponderadores previos a la publicación de la reforma).
   - Grupo VII-A
   - Grupo VII-B
   - Grupo IX

Y el ponderador aplicable conforme a la escala Local o Global de la calificación otorgada al título de deuda conforme el anexo 1-B de la CUB. Contando con hasta 90 días a partir del 4 de diciembre 2025 para apegarse a los cambios publicados en el DOF.

Tratándose de emisiones de Bolsas de derivados a las que hacen referencia los incisos a) y b) de la fracción I del artículo 2 Bis 12.a de la CUB que sean liquidadas en cámaras de compensación que no observen lo señalado en el segundo párrafo del citado artículo serán clasificadas en el Grupo III o Grupo VII, según corresponda.

Los créditos que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y cuenten con garantía hipotecaria de dichos inmuebles formarán parte del grupo IX.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VII. CALIFICACIONES DE CRÉDITO.

Al utilizar las calificaciones para determinar los grados de riesgo deben observarse lo señalado en el Art. 2 Bis 23 de la CUB.

Para efectos de ponderar las Operaciones señaladas en la fracción II del artículo 2 Bis 18 de la CUB se deberá utilizar la Calificación crediticia en escala global asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al gobierno central del país extranjero al cual pertenece la institución bancaria, casa de bolsa y sus equivalentes en el extranjero, con la cual se mantienen dichas operaciones.

En caso de no existir Calificación para la entidad emisora, contraparte o gobierno central del país extranjero de que se trate, la ponderación por riesgo de crédito será la indicada en el referido Anexo 1-B para Operaciones del Grupo VII no calificadas.

En ningún caso, el ponderador por riesgo que se asigne a las Operaciones no calificadas comprendidas en este grupo podrá ser inferior a la del gobierno central del país al que pertenezcan.

VIII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC08

Concepto 80714: Créditos a Estados y Municipios, relativos al ADE
En este concepto debe reportarse el importe de los créditos otorgados a Estados y Municipios, contratados con anterioridad al 1 de enero de 1996, que hayan sido reestructurados en UDIS, bajo los programas de apoyo a deudores del Gobierno Federal.

El importe de los créditos incluidos en este concepto debe reportarse bruto, sin restar las correspondientes reservas preventivas.

Concepto 81106: Créditos a Gobiernos de Estados y Municipios, incluyendo al D.F. (actualmente Ciudad de México), y Organismos Descentralizados de éstos, contratados con anterioridad al 1 de enero de 1996, garantizados con las participaciones que en ingresos federales le correspondan
En este concepto debe reportarse el importe de los créditos contratados con anterioridad al 1 de enero de 1996, garantizados con las participaciones que en ingresos federales les correspondan a los propios Estados y Municipios, incluyendo al D.F. (actualmente Ciudad de México) registrados ante la Unidad de Crédito Público de la Secretaría de Hacienda y Crédito Público.

El importe de los créditos incluidos en este concepto debe reportarse bruto, sin restar las correspondientes reservas preventivas.

Concepto 81214: Créditos a Gobiernos de Estados y Municipios, incluyendo al D.F. (actualmente Ciudad de México), y Organismos Descentralizados de éstos, contratados del 1 de enero de 1996 al 31 de marzo de 2000
En este concepto debe reportarse el importe de los créditos contratados del 1 de enero de 1996 al 31 de marzo de 2000, estén o no garantizados con las participaciones que en ingresos federales les correspondan a los Estados y Municipios, incluyendo al D.F.

(actualmente Ciudad de México). Incluye todas sus reestructuraciones, excepto las del "Programa UDIS" que deben reportarse en el concepto 80714.

Concepto 85401: Créditos a cargo de la Ciudad de México, garantizadas por el gobierno federal originados de conformidad con el Art. 33 Ley de Disciplina Financiera (ponderados al 0 por ciento).

En el grupo de conceptos que comprende esta clave debe reportarse el importe de los créditos a la Ciudad de México originados de conformidad con lo dispuesto en el artículo 33 de la Ley de Disciplina Financiera de las Entidades Federativas y los Municipios y cuenten con la garantía del Gobierno Federal, o bien que correspondan a deuda estatal garantizada en los términos del capítulo IV del título tercero de la ley citada.

Concepto vigente a partir de julio 2017.

Concepto 84303: Cuentas por cobrar.

En este concepto debe reportar las otras cuentas por cobrar con excepción de aquellas que se refieran a: deudores por liquidación de operaciones por inversiones en valores y compra venta de divisas, saldos a favor de impuestos e impuestos acreditables, créditos para la compra o venta de acciones y préstamos u otros adeudos al personal.

Dentro de los conceptos 843030 a 843074 deben clasificar el importe total reportado en el concepto 84303, considerando el grupo y ponderador de riesgo a que pertenece el deudor.

Las cuentas excluidas deberán reportarlas en las secciones y formularios que corresponda.

- Los deudores por liquidación de operaciones deben reportarse en la sección RC06A, bajo las claves que corresponda según los días de incumplimiento de las operaciones y el ponderador de riesgo.

-Los saldos a favor de impuestos e impuestos acreditables deben reportarse en la sección RC08 bajo el concepto 84311

-Los préstamos u otros adeudos al personal, deben registrarse en la sección RC08 integrados a la cartera de créditos del grupo VI.

-Los créditos para compra de acciones de la propia Institución, del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo o de las filiales financieras de todas las anteriores, deben reportarse en la sección RC09 bajo el concepto 92950.

Concepto 88022: Créditos que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y cuenten con la garantía hipotecaria de dichos inmuebles.

En el grupo de conceptos que comprende esta clave debe reportarse el importe de los créditos con o a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial que, individualmente o en su conjunto, respecto del mismo emisor o contraparte, sean iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 4 millones de UDIs, y cuando sus

Ingresos Netos o Ventas Netas anuales sean iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs, que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y que cuenten con la garantía hipotecaria de dichos inmuebles. Estos créditos estarán sujetos al ponderador establecido para el grupo IX, conforme al artículo 2 bis 18 fracción I.

Concepto vigente a partir de septiembre 2024.

Concepto 84903: Cargos diferidos y pagos anticipados que no se restan del capital fundamental (ponderadas al 100%).

En este concepto debe reportarse el saldo de las erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo que no se resten del Capital Fundamental. No deben incluirse los impuestos diferidos activos así como pagos provisionales de ISR.

Debe reportarse el saldo neto de las partidas a cargo que no se resten del Capital Fundamental y ser igual a la suma de los conceptos: 84904 y 84906.

Concepto 84904: Pagos anticipados cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

El saldo reportado bajo este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste.

El importe de impuestos diferidos o PTU pasivos considerados en este concepto debe incluirse también, de manera informativa, bajo la clave 95399 y/o 95406.

Concepto 84906: Cargos diferidos cuyo plazo remanente de afectación cuyo plazo de afectación a resultados sea igualo menor a un año.

El saldo reportado bajo este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste.

El importe de impuestos diferidos o PTU pasivos considerados en este concepto debe incluirse también, de manera informativa, bajo la clave 95400 y/o 95407.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Concepto 84913: Impuestos Diferidos Activos
Por lo que se refiere a impuestos diferidos activos provenientes de otras diferencias temporales debe reportarse el saldo neto de las partidas a cargo que no se reste del Capital Fundamental.

Concepto 89403: Acciones de Inmobiliarias Bancarias
En este concepto debe reportarse el importe de las inversiones en acciones de inmobiliarias bancarias a que se refiere el Artículo 88 de la L.I.C.

Las acciones deben informarse a precios que se determinen conforme a los criterios de valuación establecidos por la CNBV.

Concepto 89503: Acciones de empresas de servicios complementarios y/o auxiliares en su administración
En este concepto debe reportarse el importe de las inversiones en acciones de empresas de servicios complementarios y/o auxiliares en la administración de la Institución, a que se refiere el Artículo 88 de la L.I.C.

Las acciones deben informarse a precios que se determinen conforme a los criterios de valuación establecidos por la CNBV.

Concepto 89603: Inversiones en acciones, efectuadas por el "fondo de reservas para pensiones del personal"
En este concepto debe reportarse el importe de las inversiones en acciones que efectúe el fondo de reservas para pensiones del personal; por la parte de éstas que no se reste al determinar el capital básico.

Las acciones deben informarse a precios de mercado o, en su caso, conforme a los criterios de valuación establecidos por la CNBV.

Concepto 89704: Inversiones en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios o de desarrollo (ponderados a 1,250 por ciento)

En este concepto debe reportarse el importe de las inversiones en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios o de desarrollo cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que no cuenten con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes.

Considerando que las inversiones registradas en el concepto 89704 ponderan al 1250 por ciento, deben incluirse en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones (conceptos agrupados 55040 o 55091), donde tendrán carácter de informativo.

Conceptos 89140 a 89155: Inversiones accionarias en empresas del Artículo 75 de la L.I.C. clasificadas como Grupo X.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital de empresas de todas las fracciones del artículo 75 de la L.I.C., cotizadas y no cotizadas en bolsa.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Dichas inversiones deberán informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda, con excepción de los conceptos 89150 y 89153, estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en alguna otra sección del formulario.

Considerando que estas inversiones registradas en el concepto 89150 y 89153 no forman parte del grupo X y el registro en esta sección tiene carácter informativo, su importe debe incluirse también en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones.

Conceptos entre las claves 86951 a 86953: Portafolio de Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de vivienda y que cuenten con la garantía otorgada por alguna institución de Banca de Desarrollo que tenga garantía expresa del Gobierno Federal o de un fideicomiso público constituido para el fomento económico bajo Esquemas de Cobertura de Primeras Pérdidas.

En estos conceptos deben reportar información relativa a los portafolios de Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda y que cuenten con la garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo que tenga garantía expresa del Gobierno Federal o de un fideicomiso público constituido para el fomento económico bajo Esquemas de Cobertura de Primeras Pérdidas, siempre que dicha garantía cumpla con lo señalado en el Artículo 2 Bis 39 de la CUB para calcular su requerimiento de capital por riesgo de crédito considerando lo siguiente:

- La suma de los requerimientos de capital calculados para cada crédito del portafolio conforme a lo establecido en la CUB antes del reconocimiento del Esquema de Cobertura de Primeras Pérdidas (RK_PortafolioARC).

$$RK_Portafolio_{ARC} = \sum_{i=1}^{n} RK\ del\ i-ésimo\ crédito$$

-La suma de monto de reservas para riesgos crediticios para cada crédito del portafolio, de acuerdo con lo establecido en los Artículos 99 Bis a 99 Bis 3 de la CUB sin reconocer el Esquema de Cobertura de Primeras Pérdidas (Rvas_Portafolio).

$$Rvas_Portafolio = \sum_{i=1}^{n} Rvas\ del\ i-ésimo\ crédito$$

-El monto de la cobertura del esquema de primeras pérdidas (Mto_Cobpp) otorgada por la institución

Concepto 89900: Indicador relativo a la Autorización para reconocer la cobertura del riesgo de crédito

En este concepto deben reportarse:

- El número 1000, cuando la Institución cuente con autorización de la CNBV para reconocer la cobertura del riesgo de crédito proveniente del uso de garantías reales, conforme lo establecido en el Anexo 24 de la CUB

- El número 2000, cuando la Institución NO cuente con autorización de la CNBV señalada en el párrafo anterior o no aplica el reconocimiento de garantías reales.

Al realizar el cómputo de capital por riesgo crédito, cuando en este concepto se anote el número 1000, se disminuirá del saldo insoluto del crédito, el importe de las garantías reales recibidas, y al saldo restante se le aplicará el ponderador correspondiente al acreditado/acreditada original. En caso de anotarse el número 2000, no se disminuirá el importe de las garantías reales recibidas.

A partir de septiembre 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición publicada en el DOF el 20 de julio de 2021, en los siguientes bloques de conceptos se continuarán reportando hasta su vencimiento, aquellos créditos que no satisfacen las condiciones para la aplicación de los ponderadores del artículo 2 bis 17.

Cartera de Consumo
-86001 al 86134 (excepto 86066, 86225, 86303, 86465)

Cartera de Vivienda
-86506 al 86949

A partir del 1 de septiembre 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición publicada en el DOF el 20 de julio de 2021, los créditos a personas morales o físicas con actividad empresarial que hasta antes de dicha fecha se reportaron bajo los bloques 86066, 86225,86303, 86465 y 861380 al 861444, se registrarán en la sección RC08A bajo las clases de operación 115020 o bien 115090.

Clase	Descripción
115020	Créditos a (MiPYMES) que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17, calificados (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)
115090	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial, con importe menor a 4 millones de udis y/o con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIS, con calificación crediticia (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).

Conceptos 86935 al 86949 Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de vivienda en los que la subcuenta de vivienda del acreditado/acreditada y sus aportaciones futuras funjan como garantía y

fuente de pago, respectivamente o bien cuenten con garantía otorgada por algún banco de desarrollo o fideicomiso público para el fomento económico

Bajo estos conceptos deben reportar la información relativa a los Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, otorgados al amparo del artículo 43 BIS de la Ley del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores y del artículo 176 Ley del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado, en los que la subcuenta de vivienda del acreditado/acreditada y sus aportaciones futuras funjan como garantía y fuente de pago, respectivamente, o bien en los que los acreditados/acreditadas cuenten con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico que cumpla con los requisitos del Anexo 25 de la CUB.

Tendrán una ponderación por riesgo de crédito conforme a lo siguiente:

1. Del 50 por ciento, cuando el saldo insoluto del crédito represente 50 por ciento o menos de la suma de los recursos de la subcuenta de vivienda del acreditado/acreditada más la garantía, a la fecha de escrituración del crédito
2. Del 75 por ciento, cuando el saldo insoluto del crédito represente más del 50 por ciento y menos del 85 por ciento de la suma de los recursos de la subcuenta de vivienda del acreditado/acreditada más la garantía, a la fecha de escrituración del crédito.

En todo caso, las aportaciones a la subcuenta de vivienda del acreditado/acreditada y la garantía deberán estar disponibles sin restricción legal alguna para la Institución en caso de incumplimiento del acreditado/acreditada, así como estar libres de cualquier otro gravamen.

Asimismo, ninguna otra persona podrá disponer de los recursos mientras subsista la obligación crediticia.

De no cumplirse con todas las condiciones previstas por el párrafo anterior, la ponderación por riesgo de crédito para los créditos descritos en este inciso será de 100 por ciento.

Adicionalmente, los créditos referidos en los incisos en estos conceptos deberán destinarse para adquirir vivienda (de uso habitacional).

En ningún caso, los créditos referidos debieron haber sido reestructurados sin la autorización expresa de la Institución otorgante de la garantía o Seguro de Crédito.

Contenido

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 08_A

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC08A RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO DE CARTERA DE CONSUMO, VIVIENDA Y A MIPYMES (NUEVOS, REESTRUCTURADOS O RENOVADOS AL AMPARO DEL OFICIO P418/2020 Y SU ALCANCE P430/2020 Y DE LA RESOLUCIÓN QUE MODIFICA EL ARTICULO 2 BIS 17 DE LA CUB PUBLICADA EN EL DOF EL 20 DE JULIO DE 2021).

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC08_A

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito de operaciones que hayan sido reestructuradas o renovadas, como parte de las facilidades contables otorgadas por el COVID19, así como aquellas del artículo 2 bis 17 bajo la reforma publicada en el diario oficial de la federación (DOF) el 20 de julio de 2021.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC08_A

Los conceptos de esta sección RC08_A se refieren exclusivamente a operaciones de la Institución. Por ningún motivo deben reportarse cifras que sean producto de la consolidación de estados financieros.

Tratándose de las facilidades contables COVID (FCC).

En esta sección deben incluirse los créditos otorgados al 31 de marzo de 2020 y que al 24 de septiembre de 2020 se hayan visto modificados en sus términos originales con motivo de la pandemia referida en el acuerdo emitido por el Consejo de Salubridad General el 23 de marzo de 2011, así como los créditos otorgados, reestructurados o renovados entre el 24 de septiembre de 2020 hasta la entrada en vigor de las disposiciones publicadas el 20 de julio del 2021, en los términos establecidos del oficio P417/2020 y P429/2020, con independencia de que opten o no por ajustar los ponderadores de riesgo permitidos en el oficio P418/2020 y su alcance P430/2020.

Las operaciones registradas en esta sección no deben incluirse en las otras secciones relativas a riesgo de crédito (RC08 o RC15A)

Tratándose de la reforma publicada en el DOF el 20 de julio 2021

En esta sección deben incluirse los créditos de consumo, créditos con o a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial o créditos hipotecarios de vivienda que satisfagan los criterios definidos en el artículo 2 bis 17 de la CUB.

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC08_A

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate; los campos relativos a montos, deben reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

Las operaciones que reporte la Institución relativas a sus agencias y sucursales en el exterior, deben clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubiesen sido celebradas por una oficina en México.

Deben informar **la suma de las operaciones** agrupándolas con base en los siguientes criterios:

1. Institución
2. Fecha
3. Tipo de relación con los acreditados/acreditadas
4. Clase de la operación
5. Tipo de tratamiento (facilidad COVID o reforma art 2 bis 17) conforme al catálogo anexo
6. Periodo en el cual se realizó la reestructura, la renovación u otorgamiento del crédito
7. Situación del crédito
8. Grupo de riesgo del acreditado/acreditada
9. Grado de riesgo del acreditado/acreditada
10. Plazo de la calificación
11. Plazo remanente de las operaciones.
12. Bandera que indica si la cartera se encuentra bajo metodologías internas dentro de un periodo en paralelo de cálculo.

La unicidad del registro está definida por los siguientes "campos llave": Inst, Fecha, Tiporel, Clase, TipoTrat, Periodo_cred, Situacion, GRiesgo, Grado, Plazo_remanente, Etiq_Periodo_Paralelo, es decir, en el registro deben agrupar las operaciones que cuenten con las mismas características.

IV. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC08_A

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información
En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información
En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave del tipo de relación

En este campo debe informar la clave del Tipo de relación de los acreditados/acreditadas reportados en el registro agregado, tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
1	Personas físicas o morales que posean del 2% y hasta el 20% de los títulos representativos del capital de la institución (art. 73 de la L.I.C fracción I)
2	Personas físicas que sean miembros del Consejo de Administración (Art. 73, Fracción II de la L.I.C.)
3	Cónyuges y Personas con Parentesco (art. 73 de la L.I.C fracción III)
4	Personas físicas distintas a funcionarios y empleados que con su firma puedan obligar a la institución (Art. 7 3, Fracción IV de la L.I.C.)
5	Poseedores del 10% o más de los títulos representativos del capital de la institución (art. 73 de la L.I.C fracci ón V)
6	Personas morales en las que los funcionarios de las Instituciones sean consejeros o administradores (Art. 73 , Fracción VI de la L.I.C.)
7	Personas morales cuyos accionistas sean cualquiera de las personas mencionadas en las claves 1 a 6 (Art. 73, Fracción VII de la L.I.C.)
9	Personas físicas o morales relacionadas relevantes señaladas en la fracción CXXXI del Art. 1, Capítulo I, Tít ulo Primero de la C.U.B.
10	La contraparte no está relacionada con la Institución, conforme a lo señalado en las claves anteriores.

Campo 4: Clase de la operación

En este campo debe reportarse la clasificación que corresponda a las operaciones de que se trate, de acuerdo al catálogo de clases de operaciones siguiente (que también se ubica en el anexo en su versión extendida).

Para mayor ayuda en el llenado de la sección se agrega la correspondencia de la clase de operación con el tipo de tratamiento del campo 5.

Clave	Descripción	TIPO_TR
105000	Créditos al consumo (incluyendo microcréditos) que cumplan con los criterios establecidos en los incisos a) a b) de la fracción I del artículo 2 bis 17	{1,2,3}
115000	Créditos al consumo que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115005	Microcréditos comprendidos que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115010	Créditos a (MiPYMES) que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17, no calificados (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115020	Créditos a (MiPYMES) que satisfacen los criteerios a) a c) del artículo 2 bis 17, calificados (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	7
105002	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea a menor o igual al 50 (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}
105003	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 50 y menor o igual al 60% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}
105004	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 60 y menor o igual al 80% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

105005	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 80 y menor o igual al 90% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}
105006	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 90 y menor o igual al 100% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}
105007	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 100% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2,3,4,5}
115030	Créditos hipotecarios destinados a la adquisición en propiedad de suelo destinado para la construcción de vivienda, a la adquisición, construcción, autoproducción, remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, al igual que los créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado/acreditadas que no cumplen con las condiciones previstas en la fracción II del artículo 2 bis 17 (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
115040	Créditos hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía cuando el saldo insoluto del crédito sea menor o igual al 50 por ciento de la suma de la subcuenta (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
115050	Créditos hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía cuando el saldo insoluto del crédito sea mayor que 50 y menos del 85 por ciento de la suma la subcuenta (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
115060	Créditos Hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE, con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía, pero con restricción legal (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
105001	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial cuyo importe no exceda el equivalente en moneda nacional a 4 millones de UDIS (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2,3}
115070	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIS y que no cumplen los criterios de la fracción IV inciso b) del artítulo 2 bis 17 (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115080	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial y con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIs que cumplan los criterios de la fracción IV inciso b) del artítulo 2 bis 17, no calificados (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115090	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial, con importe menor a 4 millones de udis y/o con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIS, con calificación crediticia (a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	7
105008	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial que individualmente o en su conjunto respecto a su entidad emisora o en su conjunto sean iguales o mayores al equivalente m.n. a 4 millones de UDIS y sus ingresos 14 millones de UDIS art. 2 bis 18 (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2,3}
105009	Cartera bajo Facilidades Contables COVID Vencida o en etapa 3 (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2,3}
115100	Créditos al consumo vencidos o en etapa 3, cuya fecha de otorgamiento o reestructura fue a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}
115105	Microcréditos vencidos o en etapa 3, cuya fecha de otorgamiento o reestructura fue a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}
115110	Créditos hipotecarios vencidos o en etapa 3 cuya fecha de otorgamiento o reestructura fue a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}
115120	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial y con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIs y/o cuyo saldo sea menor o igual a 4 millones de UDIS, cuya fecha de otorgamiento o reestructura fue a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}

Campo 5: Tipo de tratamiento (facilidad COVID o reforma art 2 bis 17)

En este campo debe reportarse la clave del tipo de tratamiento que se le aplicará a los créditos reportados al determinar la exposición ponderada sujeta a riesgo (facilidades contables COVID, reforma) conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	
1	Créditos reestructurados considerando los términos del oficio P417/2020, hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	FCC
2	Créditos renovados considerando los términos del oficio P417/2020, hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	
3	Créditos nuevos otorgados con posterioridad al 24 de septiembre 2020 y hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	
4	Créditos reestructurados considerando la resolución de la CUB que entró en vigor a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	REFORMA
5	Créditos nuevos otorgados bajo la resolución de la CUB a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	
6	Créditos reestructurados que no cumplen las condiciones de la resolución de la CUB que entró en vigor a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	RC15A
7	Créditos otorgados a los cuales se les aplican los ponderadores art 2 bis 17 de la CUB vigente antes de la reforma y otras operaciones sin cambio de ponderador.	RC08A y RC15A
8	No aplica. Clase de operación diferente a crédito o constitución de base	RC08A y RC15A

La clave 8 es un valor por defecto en caso de retransmisiones de los créditos bajo facilidades contable COVID de la sección RC08A, sólo aplica a instituciones que reportaron créditos en esta sección durante septiembre 2020 hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición. La clave 6 es un valor no permitido para esta sección.

Campo 6: Periodo crédito

Se debe anotar el periodo en el que se está otorgando el crédito, la reestructura o renovación. Al efecto deberá anotar únicamente el año seguido del mes en el cual se dio el evento, es decir: AAAAMM

La clave 999901 es un valor por defecto en caso de retransmisiones de los créditos bajo facilidades contable COVID de la sección RC08A, sólo aplica a instituciones que reportaron créditos en esta sección durante septiembre 2020 hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.

Campo 7: Situación del Crédito

Se debe anotar la clave de la situación del crédito conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	Vigente sin pagos vencidos (antes de IFRS9)
2	Vencido (antes de IFRS9)
3	Vigente con pagos vencidos (antes de IFRS9)
4	Vigente en prórroga (antes de IFRS9)
5	Etapa 1

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

6	Etapa 2
7	Etapa 3
8	No aplica. Clase de operación diferente a crédito.
9	Cartera de crédito valuada a valor razonable

La clave 8 es un valor por defecto en caso de retransmisiones de los créditos bajo facilidades contable COVID de la sección RC08A, sólo aplica a instituciones que reportaron créditos en esta sección durante septiembre 2020 hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición

Bajo la clave 2 ó 7 (esta última a partir de la vigencia correspondiente) se reporta en esta sección, exclusivamente la cartera vencida o en etapa 3 de los créditos que si satisfacen los criterios FCC o de la reforma al artículo 2 bis 17 de la CUB. Aquella cartera vencida o en etapa 3 que no cumpla los criterios se reportará en la sección RC08 en los conceptos que corresponda.

A partir de la entrada en vigor de IFRS 9 ya no aplicarán las claves 1 a 4, estas solo podrán ser utilizadas para fechas anteriores al 1 de enero de 2022.

Campo 8: Grupo de riesgo

En este campo debe reportarse la clave correspondiente a la combinación grupo, ponderador y conversión de riesgo crédito al que pertenezca el acreditado/acreditada de la operación, de acuerdo al siguiente catálogo (se muestran los valores permitidos para esta sección, la versión extendida se encuentra en el anexo):

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
80	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VII_A	20.00%
82	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VII_A	50.00%
84	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	VII_A	100.00%
86	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	VII_A	120.00%
88	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	VII_A	150.00%
89	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 172.5%	VII_A	172.50%
158	Operaciones del Grupo 8 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115% (cartera vencida vencida o en etapa 3))	VIII	115.00%
159	Operaciones del Grupo 8 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150% (cartera vencida o en etapa 3)	VIII	150.00%
170	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 75%	VI	75.00%
171	Operaciones del Grupo 9 FCC cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 85%	IX	85.00%

172	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VI	20.00%
173	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 25%	VI	25.00%
174	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 30%	VI	30.00%
175	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 40%	VI	40.00%
176	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VI	50.00%
177	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 70%	VI	70.00%
178	Operaciones del Grupo 7 FCC cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 90%	VII_A	90.00%
179	Operaciones del Grupo 8 FCC cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115% (cartera vencida o en etapa 3)	VIII	115.00%
180	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 85%	VI	85.00%

Grupo VII_A aplica a aquellos créditos de consumo o comerciales a pymes que cuenten con calificación.

Campo 9: Grado de riesgo

En este campo debe reportarse la clave del grado de riesgo crédito que corresponda al acreditado/acreditada (de acuerdo al Anexo 1-B de la CUB); conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
10	Sin Grado de Riesgo por no ser Calificado o, no aplica
11	Grado de Riesgo 1
12	Grado de Riesgo 2
13	Grado de Riesgo 3
14	Grado de Riesgo 4
15	Grado de Riesgo 5
16	Grado de Riesgo 6

Campo 10: Plazo de la calificación

En este campo debe reportarse la clave del plazo de la calificación que corresponda al acreditado/acreditada conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	Nombre corto
10	No aplica plazo de calificación	NPC
20	Largo plazo escala local	LPL
21	Corto plazo escala local	CPL
30	Largo plazo escala global	LPG
31	Corto plazo escala global	CPG

Este campo debe reportarse con valor 10 cuando se trate de un grupo de riesgo cuyo ponderador no esté determinado por el anexo 1-B.

Campo 11: Plazo remanente de la operación

Deben reportar la clave del rango del plazo remanente en el que se ubiquen las operaciones agregadas conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	Menor a un año
2	Mayor o igual a un año y menor a dos años
3	Mayor o igual a dos años y menor a tres años
4	Mayor o igual a tres años y menor a cuatro años
5	Mayor o igual a cuatro años y menor a cinco años
6	Mayor o igual cinco años

Campo 12: Importe insoluto

Debe anotarse el importe relativo a la cartera de crédito que incluya el principal vigente, los intereses ordinarios devengados no cobrados y el refinanciamiento y capitalización de intereses. Asimismo, dicha cartera debe reportarse bruta, sin restarle las correspondientes reservas preventivas, sin disminuir los avales o garantías recibidos ni los importes de derivados de crédito. Para calcular el requerimiento de capital por riesgo crédito, al importe anterior le será disminuido el importe de la mitigación de riesgo crédito, conforme al método que corresponda (simple o integral).

Campo 13: Garantías Reales Recibidas aplicando el Método Simple.

En este campo debe anotarse la suma del importe de las garantías reales admisibles que la institución haya recibido para disminuir su exposición a riesgo de crédito, que considere bajo el método simple, siempre y cuando cumpla lo establecido en el apartado E del capítulo III título primero bis de la CUB y su anexo 24.

El importe de estas garantías debe informarse en esta sección y en la sección RC13 relativo a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

En este campo, el importe de las garantías reales debe clasificarse considerando el grupo de riesgo crédito que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de la operación de que se trate.

Campo 14: Garantías Reales recibidas aplicando el Método Integral.

En este campo debe anotarse la suma del importe ajustado de las garantías reales recibidas que la institución haya recibido para cubrir su exposición a riesgo de crédito, determinado conforme a lo establecido en el Art. 2 Bis 37 de la CUB, siempre y cuando cumpla las condiciones establecidas en el apartado E del capital III título primero bis de la CUB y su anexo 24.

El importe de estas garantías debe informarse en esta sección y en la sección RC13 relativo a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

En este campo, el importe de las garantías reales debe clasificarse considerando el grupo de riesgo crédito que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de la operación de que se trate.

Campo 15: Monto Avalado.

En este campo debe reportarse el monto correspondiente a las garantías personales con las que cuenten las operaciones.

El importe de las garantías personales debe informarse en esta sección, y en la sección RC13 relativo a "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

Campo 16: Monto de la cobertura recibida por Derivados Crediticios.

En este campo debe reportarse el monto correspondiente a la cobertura recibida a través de Derivados de Incumplimiento Crediticio establecido en el Art. 2 Bis 43 de la CUB, siempre que cumpla las condiciones establecidas en el apartado E del capital III título primero bis de la CUB y su anexo 25.

En esta sección, el importe de la cobertura debe clasificarse considerando el grupo de riesgo que corresponda al activo de referencia de que se trate.

Campo 17: Reservas constituidas que no computen como capital complementario

Deben incluir la suma de las reservas que se encuentren constituidas al mes correspondiente al cómputo de capitalización para las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito, determinadas de conformidad con lo establecido en la Circular Única de Bancos y que no hayan sido contabilizadas como capital complementario.

Este importe se clasificará de acuerdo al grado de riesgo y escala correspondiente al grupo de riesgo crédito para el que fueron constituidas.

Campo 18: Monto del Requerimiento de Capital bajo Metodología Estándar

Deben reportar el monto del Requerimiento de Capital calculado bajo la Metodología Estándar utilizando los ponderadores vigentes en la CUB antes de la entrada en vigor de la reforma al artículo 2 bis 17 o bien antes de las facilidades relativas a Reservas y Capital P418 2020 y P430/2020.

Campo 19 Razón del Crédito a Valor de la Vivienda (Razón CVV).

En el caso de cartera de vivienda, deben reportar el promedio de la razón de crédito a valor de la vivienda del grupo de créditos a los cuales se les aplica el mismo ponderador de riesgo. El valor CVV que se considere debe ser antes de la aplicación de cualquier técnica de mitigación del riesgo de crédito.

Los porcentajes del valor CVV de cada crédito podrán ser ajustados al momento del cómputo de los requerimientos de capital, considerando la reducción de la cuantía del saldo del crédito en la medida que este se vaya amortizando.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Tratándose de otro tipo de cartera de créditos, el valor por defecto de este campo es cero.

Campo 20 Valor de la vivienda

En el caso de cartera de vivienda, deben reportar la suma de los valores de la vivienda del grupo de créditos a los cuales se les aplica el mismo ponderador de riesgo. El valor reportado de la vivienda será aquel que se utilice en el valor CVV, en todo momento las Instituciones deberán observar lo establecido en el Anexo 24 de estas disposiciones.

Tratándose de otro tipo de cartera de créditos, el valor por defecto de este campo es cero.

Campo 21 Valor de la subcuenta

Deben reporta la suma de los recursos de la subcuenta de la vivienda que funjan como garantía en aquellos créditos hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial.

Tratándose de otro tipo de cartera de créditos, el valor por defecto de este campo es cero.

Campo 22 Bandera para indicar si la cartera está bajo la metodología estándar o interna.

Deben reportar la clave de la situación que le aplique a la cartera conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
0	Cartera exclusiva bajo enfoque estándar
1	Cartera bajo método interno en periodo de cálculo en paralelo (cuando opte por aplicar FCC)
2	Cartera bajo método interno en periodo de cálculo en paralelo
4	No aplica. Clase de operación diferente a crédito, constitución de base

Debe considerarse que aquella cartera reportada:

Bajo la clave 1, será considerada como parte de los resultados del requerimiento bajo el enfoque estándar con facilidades contables COVID y por tanto no se debe incluir en la sección RC14.

Bajo la clave 2, no será considerada como parte de los resultados del requerimiento bajo método estándar y por tanto debe ser reportada simultáneamente en la sección RC14.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 09

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC09 RELATIVA A LA INTEGRACIÓN DEL CAPITAL NETO

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC09

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para determinar el Capital Neto de la Institución, conforme a lo establecido en la Circular Única de Bancos (CUB).

II. DEFINICIONES DE LA SECCIÓN RC09

Para efectos de esta sección, se entenderá como: Valor contable o valor actualizado, al cierre del mes correspondiente, al que se determine conforme a los criterios que en materia contable establezca la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV). En su caso, el valor anterior debe considerar conforme a lo indicado en el concepto de que se trate, las amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades diferida pasiva.

III. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR

Cuando en esta sección y en la CUB se hace referencia a "entidades financieras del exterior" o a "entidades financieras del exterior filiales (subsidiarias) de la Institución", debe entenderse que se trata de una institución no mexicana y, por lo tanto, no debe entenderse como una referencia hecha a los bancos mexicanos cuya matriz está ubicada en el exterior.

Las entidades financieras filiales (subsidiarias) del exterior de la Institución, al elaborar esta sección deben proceder considerando que:

- La entidad financiera matriz, será una entidad financiera del país.
- Las entidades financieras del país, son las mexicanas, residencia o accionistas
- Las entidades financieras del exterior, son las que no son mexicanas y que la institución tiene inversión en acciones y por lo tanto control de estas.

IV. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC09

Se deben reportar las operaciones celebradas por la Institución en la República Mexicana y en sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. En su caso, se debe, reportar también esta sección por separado, por cada una de sus entidades financieras del exterior filiales (subsidiarias) de la Institución.

V. CONCEPTOS Y COLUMNA DE LA SECCIÓN RC09

La sección RC09 está conformada por los conceptos 90075 al 95677, con dos columnas, en donde debe reportarse en moneda nacional y conforme a saldos contables respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la institución en sus oficinas en México y en sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. En el caso de inversiones accionarias se reportarán en esta columna las que se hayan realizado de manera directa.

Columna 2: Esta columna sólo aplica a las inversiones accionarias que se hayan realizado de manera indirecta.

VI. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC09

La información de esta sección, en su única columna, debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos y formato a milésimas.

No obstante que la naturaleza de las cuentas que conforman el capital son acreedoras para efectos de este formulario las utilidades o plusvalías serán reportadas con signo positivo y las pérdidas o minusvalías con signo negativo.

VII. INVERSIONES

En el apartado relativo a INVERSIONES deben incluirse, según correspondan y conforme a la CUB:

- Las inversiones del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", bajo el esquema de beneficios definidos
- Las acciones y títulos cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Institución, y
- De la parte correspondiente a las acciones distintas al capital fijo, las inversiones comprendidas en esta sección, provenientes de la desagregación que se haga en sus diversas posiciones individuales, del portafolio del fondo de inversión, tanto de capitales como de objeto limitado, no cotizadas en bolsa.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VIII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC09

CUENTAS DEL CAPITAL

Concepto 95005 al 90035: Partidas del capital contribuido.
En estos conceptos deben reportarse los títulos representativos del capital social incluyendo, en su caso, la prima por la venta de dichos títulos y las aportaciones ya realizadas para para futuros aumentos de capital, formalizadas por su órgano de gobierno.

Según corresponda, se debe reportar el importe totalmente pagado de cada concepto incluyendo sus incrementos por actualización, al cierre del mes de que se trate, antes de cualquier proceso de consolidación de sus estados financieros con los de las entidades financieras filiales.

Conceptos 95005 y 95010: Títulos representativos del capital social incluyendo en su caso la prima en venta de acciones que cumplan con el anexo 1-Q.
Los títulos representativos del capital social que cumplen con la totalidad los criterios establecidos en el anexo 1-Q de la Circular Única de Bancos (CUB) de la CNBV. Tratándose de Bancos Múltiples, los títulos se refieren a las acciones series "O", "F" y "B", según sea el caso, mientras que para Bancos de Desarrollo se refieren a los certificados de aportación patrimonial serie "A" y "B".

De la suma de estos conceptos se parte para la integración del Capital Fundamental.

Conceptos 95015 y 95020: Títulos representativos del capital social incluyendo en su caso la prima en venta de acciones que cumplan con el anexo 1-R.
Los títulos representativos del capital social que cumplen con la totalidad los criterios establecidos en el anexo 1-R de la CUB. Tratándose de Bancos Múltiples se refieren a las acciones serie "L" no acumulativas.

De estos conceptos se parte para la integración del Capital Básico No Fundamental.

Conceptos 95025 y 95030: Títulos representativos del capital social incluyendo en su caso la prima en venta de acciones que cumplan con el anexo 1-S.
Los títulos representativos del capital social que cumplen con la totalidad los criterios establecidos en el anexo 1-S de la CUB. Tratándose de Bancos Múltiples se refieren las acciones serie "L" acumulativas.

De estos conceptos se parte para la integración del Capital Complementario.

Concepto 95035: Aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno.
En este concepto deben reportarse las aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital, respecto de las cuales ya existe un acuerdo por parte de la asamblea de

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

accionistas para dicho aumento y su respectiva suscripción, que cumplan con los requisitos contenidos en la NIF C-11 "Capital Contable".

Este concepto se suma al Capital Fundamental hasta febrero 2026. A partir de marzo 2026 será la suma de los conceptos 95036, 95037 y 95038.

Concepto 95036: Aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno con un plazo no mayor a 12 meses desde que fueron acordadas en asamblea.

En este concepto deben reportarse las aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital, respecto de las cuales ya existe un acuerdo por parte de la asamblea de accionistas para dicho aumento y su respectiva suscripción y que no haya transcurrido un plazo mayor a doce meses desde que dichas aportaciones fueron acordadas por parte de la asamblea de accionistas.

Este concepto se suma al Capital Fundamental.

Concepto 95037: Aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno con un plazo mayor a 12 meses desde que fueron acordadas en asamblea y con una prórroga autorizada de hasta 6 meses para ser capitalizables.

En este concepto deben reportarse las aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital, respecto de las cuales ya existe un acuerdo por parte de la asamblea de accionistas para dicho aumento y su respectiva suscripción, cuyo plazo transcurrido desde que se acordaron sea mayor a 12 meses y que a su vez la CNBV haya determinado que dichas aportaciones continuarán computando como capital fundamental hasta por un plazo adicional de seis meses.

Este concepto se suma al Capital Fundamental.

Concepto 95038: Aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno con un plazo mayor a 12 meses desde que fueron acordadas en asamblea y sin prórroga autorizada para ser capitalizables.

En este concepto deben reportarse las aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital, respecto de las cuales ya existe un acuerdo por parte de la asamblea de accionistas para dicho aumento y su respectiva suscripción, pero que luego de transcurridos doce meses no han sido capitalizadas y tampoco cuentan con prórroga autorizada para computar en el capital fundamental.

Este concepto es informativo no se considerará como parte del Capital Fundamental.

Conceptos del 95045 al 90065: Capital ganado.

En estos conceptos debe reportarse la suma de los conceptos del capital ganado que se consideran para efectos regulatorios para la integración del Capital Neto (resultado neto

de ejercicios anteriores, resultado neto, reservas de capital, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta y el resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo correspondientes a partidas cubiertas valuadas a valor razonable).

Según corresponda, estos conceptos deben incluir los incrementos por actualización.

La integración del capital ganado en este apartado es para efectos regulatorios y puede diferir de la integración del capital ganado para efectos contables.

Conceptos del 95045 al 95055: Reservas de capital, resultados de ejercicios anteriores y resultado neto.
En estos conceptos se debe reportar el importe de las reservas de capital, los resultados de ejercicios anteriores y resultado neto.

Dichos conceptos deben reportarse junto con su correspondiente actualización.

Estos conceptos se suman al Capital Fundamental.

Concepto 95060: Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.
En este concepto debe registrar el importe de la valuación de los títulos disponibles para la venta valuadas conforme a los criterios de la CNBV.

Este concepto se suma al Capital Fundamental.

Concepto 95065: Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo partidas a valor razonable.
En este concepto debe registrar el importe de la valuación de efectivo correspondiente a partidas cubiertas valuadas a valor razonable.

Este concepto se suma al Capital Fundamental. Clave vigente hasta diciembre 2016

Concepto 95066: Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo.
En este concepto debe registrar el importe de la valuación de efectivo.

Este concepto se suma al Capital Fundamental. Clave vigente a partir de enero 2017

Concepto 95068: Resultado por remediciones por beneficios definidos a los/las empleados/as.
En este concepto debe registrar el importe de la valuación de remediciones por beneficios definidos a los empleados. La determinación de este importe atenderá lo establecido en las normas de información financiera D-3 "Beneficios a los empleados" y el artículo tercero transitorio de la CUB publicada en el DOF del 31 diciembre de 2015.

Este concepto se suma al Capital Fundamental.

INTRUMENTOS DE CAPITAL

Los instrumentos de capital de esta sección, son los emitidos a partir del 1 de enero del 2013 o con anterioridad, siempre que cumplan con la totalidad de los criterios de los anexos 1-R o 1-S de la CUB, según corresponda.

Concepto 95075: Instrumentos de Capital que cumplan anexo 1-R

En este concepto debe reportarse el importe de los Instrumentos de Capital, que cumplan con la totalidad de las condiciones establecidas en el anexo 1-R de la CUB.
Sólo podrán incluirse estos instrumentos, cuando los títulos representativos del capital social de la propia institución de banca múltiple o de la controladora del grupo financiero a la que pertenezca dicha institución, se encuentren inscritos en el Registro Nacional de Valores y cumplan con los requisitos de listado y mantenimiento de la Bolsa en la que listen sus acciones, conforme a lo establecido en la Ley de Mercado de Valores. Excepto que, en términos de lo dispuesto por el Reglamento Interior de la Bolsa, no se encuentren en posibilidades de inscribir sus títulos representativos del capital social en la Bolsa en razón de su fecha de inicio de operaciones.

Sin perjuicio de lo anterior y conforme al artículo segundo transitorio (DOF 13 abril de 2013 y hasta noviembre 2017), cuando no se encuentren inscritos en el Registro Nacional de Valores o cumplan con los requisitos de listado y mantenimiento de la Bolsa en la que listen sus acciones, conforme a lo establecido en la Ley de Mercado de Valores, podrán registrar importe en este concepto y deben indicarlo en el concepto 95662.

A partir de la información de diciembre 2017 deben indicar en el concepto 95685 la situación bajo el cual computarían los instrumentos de capital dentro del Capital Básico no fundamental.

Este concepto se suma al Capital Básico No Fundamental hasta por el monto aplicable.

Concepto 95080: Instrumentos de capital que computen como Capital Complementario.

En este concepto debe reportarse el importe de los Instrumentos de Capital que no hayan sido considerados en el Capital Básico No Fundamental, siempre y cuando dichos instrumentos cumplan con las condiciones establecidas en el anexo 1-S de la CUB.

El importe se integra de la suma del 100% de lo reportado en el concepto 95085, el 80% de lo reportado en el concepto 95090, el 60% de lo reportado en el concepto 95095, el 40% de lo reportado en el concepto 95100, y el 20% de lo reportado en el concepto 95105.

Sin perjuicio de lo anterior y conforme al artículo segundo transitorio (DOF 13 abril de 2013 y hasta noviembre 2017), cuando no se encuentren inscritos en el Registro Nacional de Valores o cumplan con los requisitos de listado y mantenimiento de la Bolsa en la que listen sus acciones, conforme a lo establecido en la Ley de Mercado de Valores, pueden registrar importe en este concepto y deben indicarlo en el concepto 95662.

A partir de la información de diciembre 2017 deben indicar en el concepto 95685 la situación bajo el cual computarían los instrumentos de capital dentro del Capital Complementario.

El importe de los instrumentos referidos, computa como Capital Complementario en función del ponderador aplicable o su plazo de amortización o vencimiento, conforme a lo siguiente.

Concepto 95085: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea más de 5 años.

Concepto 95090: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea mayor a 4 años y hasta 5 años.

Concepto 95095: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea mayor a 3 años y hasta 4 años.

Concepto 95100: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea mayor a 2 años y hasta 3 años.

Concepto 95105: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea mayor a 1 año y hasta 2 años.

Concepto 95110: Cuyo plazo de amortización o vencimiento sea hasta un año (este concepto es informativo).

El plazo de amortización a que se refieren estos conceptos es el comprendido entre el último día del mes de que se trate y la correspondiente fecha de amortización. En el evento que una colocación de estos Instrumentos de Capital tenga amortizaciones en distintas fechas, cada una de esas amortizaciones se informa en el respectivo concepto, dependiendo de su particular plazo de amortización.

En dichos conceptos se registra el monto total; sin embargo, para efectos del cómputo se toma el importe registrado en el concepto 95080.

Concepto 95115: Otros Instrumentos de Capital que no cumplan con los anexos 1-R o 1-S.
En este concepto debe registrarse el importe de los Instrumentos de Capital distintos a los registrados en 95075 y 95080.

Este concepto es informativo.

INVERSIONES EN ENTIDADES FINANCIERAS

a) Inversiones en el capital

Concepto 95130: Acciones propias adquiridas conforme a lo previsto en la L.I.C.
En este concepto debe reportarse el importe de acciones propias adquiridas por la institución de conformidad a lo previsto en la Ley de Instituciones de Crédito (L.I.C.).

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95135: Subsidiarias financieras sujetas a requerimiento de capital.
Suma de los conceptos 95140 y 95145.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Concepto 95140: Inversión accionaria en la entidad financiera nacional o extranjera.
En este concepto debe reportarse el valor contable de la inversión accionaria en la entidad financiera filial (subsidiaria) de que se trate, sujeta a requerimientos de capital.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

El cálculo debe realizarse individualmente por cada filial (subsidiaria) conforme a lo ya indicado.

En aquellos casos en los que la inversión no corresponda al 100 por ciento del capital social de la entidad financiera filial (subsidiaria), debe ponderarse por la participación accionaria en la entidad financiera filial (subsidiaria).

Concepto 95145: Faltante de capital mínimo regulatorio requerido proporcional a la tenencia accionaria.
En este concepto debe reportarse la suma del faltante de capital de entidades financieras filiales (subsidiarias).

El cálculo debe realizarse conforme a lo indicado en la fracción II de estas ayudas.

En aquellos casos en los que la inversión no corresponda al 100 por ciento del capital social de la entidad financiera filial (subsidiaria), debe ponderarse por la participación accionaria en la entidad financiera filial.

Concepto 95146: Inversiones en acciones de controladoras de grupos financieros.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital de cualquier "controladora de grupo financiero," inclusive en el de la controladora del grupo al que pertenezca la Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95150: Inversiones en acciones de sociedades financieras de objeto múltiple
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital de sociedades financieras de objeto múltiple.
Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95151: Inversiones en acciones de administradoras de fondos para el retiro y sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital de administradoras de fondos para el retiro y en el de sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92350: Inversiones o aportaciones al capital de cámaras de compensación, empresas, fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad actuar como socio liquidador.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones o aportaciones efectuadas en el capital de empresas, en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares, que tengan por finalidad compensar y liquidar operaciones celebradas en bolsa, deduciendo, en su caso, la participación de tales empresas o fideicomisos en dicha bolsa, sean o no filiales (subsidiarias) de la Institución, vigente hasta 30 de septiembre 2015.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones o aportaciones efectuadas en el capital de empresas o en el patrimonio mínimo de fideicomisos u otro tipo de figuras similares, que tengan por finalidad actuar como socio liquidador, cámara de compensación, u otra figura equivalente, para compensar y liquidar operaciones celebradas en bolsa, deduciendo, en su caso, la participación de tales empresas o fideicomisos en dicha bolsa, sean o no filiales (Subsidiarias) de la Institución. Lo anterior en el entendido que por capital de empresas o patrimonio mínimo de los fideicomisos debe excluirse las inversiones o aportaciones al fondo de aportaciones iniciales mínimas, fondo de compensación, fondo complementario o cualquier otra aportación que no sea mutualizable. A partir de 1 octubre de 2015.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95152: Inversiones en acciones del capital fijo de fondos de inversión.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital fijo de fondos de inversión; sean o no filiales (subsidiarias) de la Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95155: Inversiones de fondos de inversión (en acciones distintas a la de capital fijo).

Suma de los conceptos: 92790, 92792, 95156, 92808 y 92810.

Concepto 92790: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión tanto de capitales como de cobertura , cotizadas en bolsa, respecto de las cuales la tenencia de la institución no exceda del 15 % del capital del fondo inversión, por la parte de tales fondos que esté representada por títulos accionarios.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de fondos inversión tanto de capitales como de cobertura, cotizadas, respecto de las cuales la Institución no tenga más del 15% del total de las

acciones del fondo de que se trate (sin considerar las relativas al capital fijo). Dicho importe actualizado debe comprender exclusivamente la parte proporcional del fondo invertida en acciones, ponderado por la participación de la Institución que no corresponda al capital fijo.

Este concepto es informativo.

Considerando que estas inversiones no se restan para integrar el Capital Básico, su importe debe incluirse (en forma desagregada) también en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones.

Concepto 95156: Inversiones distintas al capital fijo de fondos de inversión de renta variable, tanto de capitales como de cobertura no cotizadas en bolsa, cuyo portafolio contenga acciones que deban restarse al Capital Fundamental.
Sin perjuicio de que el importe de estas inversiones debe incluirse también en el resto de los conceptos de esta sección RC09, según corresponda, y para determinar de manera agregada, cuáles inversiones corresponden a la Institución y cuáles a fondos de inversión, en este concepto debe reportarse el importe actualizado (exclusivamente la parte proporcional a la tenencia respectiva) de las inversiones en acciones y títulos que deban restarse para integrar el Capital Fundamental, que hayan sido realizadas por los fondos de inversión de que se trate.
Las inversiones del portafolio en acciones que no se resten del capital, deben incluirse en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones.

Este concepto es informativo.

Concepto 92792: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión tanto de capitales como de cobertura, cotizadas en bolsa, respecto de las cuales la tenencia de la institución exceda del 15% del capital del fondo de inversión, por la parte de tales fondos que esté representada por títulos accionarios.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de fondos de inversión tanto de capitales como de cobertura, cotizadas en bolsa, respecto de las cuales la institución tenga más del 15% del total de las acciones del fondo de inversión de que se trate sin considerar las relativas al capital fijo. Dicho importe actualizado debe comprender exclusivamente la parte proporcional del fondo invertida en acciones, ponderado por la participación de la Institución que no corresponda al capital fijo.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 92808: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión de renta variable (cotizadas y no cotizadas en bolsa), cualquiera que sea el porcentaje de participación.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de fondos de inversión de renta variable **(cotizadas y no cotizadas en bolsa)**, cualquiera que sea su porcentaje de participación, de la parte que no se hayan restado al Capital Fundamental

Este concepto es informativo.

Considerando que este concepto no se resta para integrar el Capital Fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC01 o RC03 o RC04 o RC05 o RC07, según corresponda.

Concepto 92810: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión de instrumentos de deuda (cotizadas y no cotizadas en bolsa), cualquiera que sea el porcentaje de participación.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de fondos de inversión de instrumentos de deuda **(cotizadas y no cotizadas en bolsa)**, cualquiera que sea el porcentaje de participación de la Institución, de la parte que no se haya restado al Capital Fundamental.

Este concepto es informativo.

Considerando que este concepto no se resta para integrar el Capital Fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC01 o RC03 o RC04 o RC07, según corresponda.

Concepto 95160: Organismos Multilaterales de Desarrollo o de Fomento Internacional que cuenten con calificación crediticia asignada por alguna de las instituciones calificadoras a la entidad emisora, igual o mejor al grado de riesgo 2 a largo plazo.
El importe a reportar se integra de la suma del 25% del concepto 95165 y 50% del concepto 95170.

Concepto 95165: Organismos Multilaterales de Desarrollo o de Fomento Internacional que cuenten con calificación crediticia asignada por alguna de las instituciones calificadoras a la entidad emisora, igual o mejor al grado de riesgo 2 a largo plazo, cuya tenencia accionaria sea hasta por el 10% del capital del organismo.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en Organismos Multilaterales de Desarrollo o Fomento Internacional que cuenten con una calificación de largo plazo, igual o mejor a grado de riesgo 2, y cuya inversión represente hasta el 10% del organismo de que se trate.

El importe equivalente al 25% del valor de estas inversiones debe restarse del Capital Básico 1.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en esta sección.

Concepto 95170: Organismos Multilaterales de Desarrollo o de Fomento Internacional que cuenten con calificación crediticia asignada por alguna de las instituciones calificadoras a la entidad emisora, igual o mejor al grado de riesgo 2 a largo plazo, cuya tenencia accionaria sea mayor al 10% del capital del organismo.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en Organismos Multilaterales de Desarrollo o Fomento Internacional que cuenten con una calificación de largo plazo, igual o mejor a grado de riesgo 2, cuya inversión represente más del 10% del citado organismo de que se trate.

El importe equivalente al 50% del valor de estas inversiones debe restarse del Capital Fundamental.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en esta sección.

Concepto 95175: Otras inversiones en acciones de otras entidades financieras del país.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en acciones de cualquier entidad financiera del país (distintas a las comprendidas en los conceptos: 95130, 95135, 95146, 95150, 92255, 92350, 95152 y 95155).

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95176: Otras inversiones en acciones de entidades financieras del exterior o controladoras.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, en el capital de entidades financieras del exterior, Filiales y no Filiales de la Institución (distintas a las comprendidas en los conceptos: 95130, 95135, 95146, 95150, 95151, 92350, 95152 y 95155).

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Este concepto no aplica para la sección que reporten las entidades financieras filiales del exterior, ya que todas las inversiones "piramidadas", una a una, las debe reportar la institución matriz (el banco múltiple).

En este concepto deben incluirse las inversiones en Organismos Multilaterales de Desarrollo o de Fomento Internacional no calificados, o que cuenten con calificación crediticia asignada por alguna de las instituciones calificadoras a la entidad emisora, igual o peor al grado de riesgo 3 a largo plazo.

El cálculo debe realizarse individualmente por cada filial o cada no filial y conforme a lo ya indicado.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

Concepto 95177 Inversiones en Entidades financieras cuya tenencia accionaria sea mayor al 10% del capital social o cuando la entidad sea una subsidiaria.

En este concepto debe incluirse la suma de todas las inversiones en entidades financieras cuya tenencia accionaria sea mayor al 10% del capital social o se trate de una inversión en una sbusidiaria. Este es un concepto agregado e informativo. Las inversiones que conformen el agregado deberán reportase también en los conceptos de inversiones en entidades financieras con base en sus características.

Concepto 95178 Inversiones en Entidades Financieras cuya tenencia accionaria sea menor o igual al 10% del capital social.

En este concepto debe incluirse la suma de todas las inversiones en entidades financieras cuya tenencia accionaria sea menor al 10% del capital. Este es un concepto agregado e informativo. Las inversiones que conformen el agregado deberán reportase también en los conceptos de inversiones en entidades financieras con base en sus características.

b) Inversiones en otros instrumentos:

Concepto 95185: Instrumentos de deuda, cuyo pago pueda realizarse después de cubrir otros pasivos.
Suma de los conceptos 91950 y 95190.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

Concepto 91950: Inversiones en obligaciones subordinadas emitidas por otras entidades financieras.
Se deben reportar las inversiones en obligaciones subordinadas emitidas por entidades financieras valuadas conforme a los criterios de la CNBV.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

Concepto 95190: Otra deuda subordinada.
Se debe reportar cualquier otra deuda subordinada emitida por entidades distintas a las comprendidas en el concepto 91950, cuyo pago sólo pueda realizarse después de cubrir otros pasivos, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

Concepto 95195: Beneficio sobre el remanente en operaciones de bursatilización.
Los beneficios generados por el vehículo de bursatilización representados por títulos de deuda, contratos o documentos (constancias de aportación, constancias de derechos fiduciarios, etc.) debido a que el valor de los activos fideicomitidos es mayor a los pasivos emitidos.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

Concepto 95200: Utilidad o incremento en el valor de los activos respecto del valor registrado en el balance del originador.
En este concepto se debe reportar la utilidad o incremento en el valor de los activos respecto de los activos anteriormente registrados en balance; originados por la adquisición de posiciones de bursatilización.

Este concepto se resta al Capital Fundamental.

c) Inversiones indirectas realizadas a través de:

Concepto 95215: Inversiones en valores referenciados a índices accionarios.
Suma de los conceptos 95220 y 95235.

Concepto 95220: Índices accionarios que incluyan, acciones en el capital de la propia institución.

En este concepto se debe reportar el importe actualizado de la posición neta larga (positiva) de la inversión en valores referenciados a índices accionarios, que incluyan acciones de la propia institución. Dicho importe resulta de restar al valor la posición larga el valor de la posición corta, siempre que se trate del mismo índice accionario.

El importe será la diferencia positiva del concepto 95225 menos el concepto 95230.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra sección del formulario.

Concepto 95225: Posición Larga.
En este concepto debe reportarse el importe de la posición larga de las inversiones en valores referenciados a índices accionarios que incluyan acciones en el capital de la propia institución.

Estas posiciones deben registrarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra sección del formulario.

Concepto 95230: Posición corta.
En este concepto debe reportarse el importe de la posición corta de las inversiones en valores referenciados a índices de accionarios que incluyan acciones en el capital de la propia institución.

Estas posiciones deben registrarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra sección del formulario.

Concepto 95235: Inversiones en valores referenciados a índices accionarios que incluyan, acciones en el capital de cualquier entidad financiera
En este concepto se debe reportar el importe actualizado de la posición neta larga (positiva) de la inversión en valores referenciados a índices accionarios, que incluyan acciones de otra entidad financiera. Dicho importe resulta de restar al valor de la posición larga, el valor de la posición corta, siempre que se trate del mismo índice accionario.

El importe será la diferencia positiva del concepto 95240 menos el concepto 95245.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra de la sección del formulario.

Concepto 95240: Posición larga.
En este concepto debe reportarse el importe de la posición larga de las inversiones en valores referenciados a índices accionarios que incluyan acciones de cualquier entidad financiera.

Esta posición debe registrarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra sección del formulario

Concepto 95245: Posición corta.
En este concepto debe reportarse el importe de la posición corta de las inversiones en valores referenciados a índices accionarios que incluyan acciones de cualquier entidad financiera.

Esta posición debe registrarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en ninguna otra sección del formulario

EN ENTIDADES NO FINANCIERAS (INVERSIONES DIRECTAS)

Concepto 92375 Inversiones en acciones de empresas (cotizadas y no cotizadas en bolsa) que a su vez sean accionistas de la propia institución, de la controladora del grupo financiero o de las demás entidades financieras integrantes del grupo financiero o de las filiales financieras de todas estas.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, directas, en acciones cotizadas y no cotizadas en bolsa de sociedades que sean a su vez, directa o indirectamente, accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de todas éstas.
Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92389: Inversiones en acciones de empresas (Art.75), cotizadas y no cotizadas en bolsa, relacionadas con la institución, cuya inversión no derive de capitalizaciones o daciones en pago.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones (que no provengan de capitalizaciones o daciones en pago) en acciones de empresas de cualquiera de las fracciones del Artículo 75 de la L.I.C., cotizadas y no cotizadas, relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la L.I.C.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92384: Inversiones en acciones (Art.75), derivadas de capitalizaciones de adeudos, correspondientes a empresas de personas físicas y morales relacionadas con la Institución.
Suma de los conceptos: 92385 y 92387.

Concepto 92385: Inversiones en acciones (Art.75), cotizadas y no cotizadas en bolsa, relacionadas con la institución, conforme los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1, derivadas de capitalizaciones de adeudos o daciones en pago, con más de 5 años de haberse efectuado.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones de empresas de cualquiera de las fracciones del Artículo 75 de la L.I.C., cotizadas y no cotizadas en bolsa, relacionadas con la institución en los términos del Artículo 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la L.I.C., que se deriven de capitalizaciones o daciones en pago de adeudos (totales o parciales), y cuya capitalización tenga más de 5 años de haberse efectuado.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92387: Inversiones en acciones (Art.75), cotizadas y no cotizadas en bolsa, relacionadas con la Institución, derivadas de capitalizaciones de adeudos o daciones en pago, con no más de 5 años de haberse efectuado.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones de empresas de cualquiera de las fracciones del Artículo 75 de la L.I.C., cotizadas y no cotizadas en bolsa, relacionadas con la Institución en los términos del Artículo 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la L.I.C., que se deriven de capitalizaciones o daciones en pago de adeudos (totales o parciales), y cuya capitalización tenga no más de 5 años de haberse efectuado.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

Este concepto es informativo.

Considerando que estas inversiones no se restan para integrar el capital fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC08 Grupo X.

Concepto 95251: Inversiones en acciones de las conocidas como "capital de riesgo".
Este concepto aplica únicamente para bancos de desarrollo.

En este concepto debe reportarse el 100% del importe actualizado de las inversiones en "capital de riesgo".

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

El importe equivalente al 50% del valor de estas inversiones, debe restarse para integrar el Capital Básico 1.

Considerando que sólo el 50% de estas inversiones se resta para integrar el Capital Básico 1, el 50% de tales inversiones debe informarse también en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones.

RESERVAS

Concepto 95691: Reservas admisibles totales para operaciones en las que se utilicen método estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

En este concepto deben incluir la suma de las reservas que se encuentren constituidas al mes correspondiente al cómputo de capitalización para las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito, determinadas de conformidad con lo establecido en el Capítulo V del Título Segundo de la CUB, en etapa 1,2 ó 3.

Dentro de este concepto se consideran las reservas originadas por:

Carteras de Consumo.
Cartera Hipotecaria.
Cartera de Estados y Municipios
Cartera comercial de empresas no financieras.
Cartera comercial de empresas financieras.
Cartera comercial con fuente de pago propia.

Este concepto es la suma de los conceptos 95692, 95693, 95694.

Concepto 95695: Pérdidas esperadas totales relativas a operaciones en las que se utilicen método estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

En este concepto deben incluir la suma de los montos de las Pérdidas Esperadas para cada una de las posiciones individuales sujetas a riesgo de crédito, conforme a lo dispuesto en el Capítulo V Bis del Título Segundo de las presentes disposiciones

Para fines de cálculo de las reservas para riesgos crediticios, la Pérdida Esperada se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento y la Exposición al Incumplimiento.

Dentro de este concepto se consideran las pérdidas esperadas de los créditos mencionados en el concepto 95691 excepto los créditos para proyectos de inversión con fuente de pago propia ya que no existe pérdida esperada.

El importe positivo que resulte de la resta entre las reservas totales admisibles menos este concepto se sumará al Capital Complementario hasta por un monto que no exceda

el límite vigente estipulado en el artículo 2 bis 7 o las disposiciones especiales sobre reservas.

Este concepto es la suma de los conceptos 95696, 95697, 95698.

Concepto 95699: Reservas Pendientes de constituirse relativas a operaciones en las que se utilicen metodología estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas preventivas pendientes de constituirse que resulten cuando las pérdidas esperadas totales sean superiores a las reservas admisibles totales, conforme lo establece el art. 2 bis 95 de la CUB.

Este concepto se resta para la integración el Capital Fundamental. Vigente hasta mayo 2026.

Concepto 95700: Reservas constituidas con cargo a cuentas distintas de resultados o de capital relativas a operaciones en las que se utilicen metodología estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas preventivas constituidas con cargo a cuentas distintas de resultados o de capital relativas a las operaciones en las que se esté utilizando el método estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. Vigente hasta mayo 2026.

Concepto 95701: Reservas que constituyan en exceso respecto de las calculadas con base en las metodologías de calificación autorizadas por la Comisión para la cartera bajo método estándar.

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas que constituyan en exceso respecto de las calculadas con base en las metodologías de calificación autorizadas por la Comisión, **distintas** a aquellas que se indican en los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión.

Concepto 95702: Reservas que constituyan en exceso de conformidad con los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión para la cartera bajo método estándar.
(informativo)

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas que constituyan en exceso de conformidad con los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión

Este dato es de carácter informativo.

Concepto 95704: Reservas admisibles totales relativa a operaciones en las que se utilicen métodos basados en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito

En este concepto deben reportarse las reservas admisibles totales de conformidad con las disposiciones de carácter general aplicables.

Cuando el resultado de restar al importe de las pérdidas esperadas totales (concepto 95708) menos la suma del importe de este concepto sea positiva, dicho resultado se restará para integrar el Capital Fundamental.

Este concepto es la suma de los conceptos 95705, 95706, 95707.

Concepto 95708: **Pérdidas Esperadas Totales para operaciones en las que se utilicen métodos de calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital.**

En este concepto deben reportarse las pérdidas esperadas totales de conformidad con las disposiciones de carácter general aplicables.

Cuando el resultado de restar al importe de las reservas admisibles totales (concepto 95704) la suma del importe de este concepto sea positivo, dicho resultado se sumará para integrar el Capital Complementario hasta por un monto que no exceda el límite vigente estipulado en el artículo 2 bis 7 o disposiciones especiales sobre reservas.

Este concepto es la suma de los conceptos 95709, 95710, 95711.

Concepto 95713: Reservas que constituyan en exceso respecto de las calculadas con base en las metodologías de calificación autorizadas por la Comisión, para la cartera basado en calificaciones internas.

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas que constituyan en exceso respecto de las calculadas con base en las metodologías de calificación autorizadas por la Comisión, **distintas** a aquellas que se indican en los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión.

Concepto 95714: Reservas que constituyan en exceso de conformidad con los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión, para la cartera basado en calificaciones internas (informativo).

En este concepto debe reportarse el importe de las reservas que constituyan en exceso de conformidad con los artículos 38 y 39 o haya sido ordenada por la Comisión

Este dato es de carácter informativo.

OTRA INFORMACIÓN

Concepto 95300: Cualquier aportación para adquisición de acciones del grupo financiero, de las demás entidades integrantes del grupo financiero o de las filiales financieras de todas.

En este concepto debe reportarse el importe de cualquier tipo de aportación cuyos recursos, directa o indirectamente, se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de todas.

Estas aportaciones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95305: Financiamiento cuyo destino directo o indirecto sea la adquisición de acciones de subsidiarias financieras de las entidades financieras integrantes del grupo.

En este concepto debe reportarse el importe de los financiamientos (valores, préstamos y créditos) que directa o indirectamente, se destinen a la adquisición de acciones de subsidiarias financieras de las entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la institución.

Estos financiamientos deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto, no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95310: Activos intangibles de la institución que, en su caso, impliquen el diferimiento de la aplicación de gastos o costos en el capital de la institución

Suma de los conceptos: 95315, 95320 y 95335.

Concepto 95315: Intangibles diferente al Crédito Mercantil

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los activos "intangibles" diferentes al crédito mercantil correspondientes.

El importe de este concepto se considerará netos de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95395 y 95403.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto vigente.

Concepto 95320: Crédito mercantil

Suma de los conceptos: 95325 y 95330

Concepto 95325: Crédito mercantil relativo a las inversiones en acciones de las que se restan para determinar el Capital Fundamental.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado del crédito mercantil relativo exclusivamente a las inversiones en acciones que se restan para determinar el Capital Fundamental.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste.

El importe de impuestos diferidos o PTU pasivos considerados en este concepto se debe incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95396 y 95404.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95330: Crédito mercantil relativo a las inversiones en acciones distintas a las que se resten para determinar el Capital Fundamental
En este concepto debe reportarse el importe actualizado del crédito mercantil relativo exclusivamente a las inversiones en acciones distintas a las que se restan para determinar el Capital Fundamental.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95396 y 95404.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95335: Pagos anticipados y cargos diferidos que representen erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo.
Suma de los conceptos: 95340 y 95345

Concepto 95340: Pagos anticipados y cargos diferidos que representen erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, iguales o menores a un año.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo provenientes de pagos anticipados y cargos diferidos que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste

y deben incluirse también, de manera informativa, en los conceptos 95399, 95400 o 95406, 95407 según corresponda.

A su vez el importe reportado debe ser igual a la suma de los conceptos 95337 y 95338.

Concepto 95337 Pagos anticipados, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los pagos anticipados que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95399 o 95406 según corresponda.

Concepto 95338 Cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los cargos diferidos que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95400 o 95407 según corresponda.

Concepto 95345: Pagos anticipados y cargos diferidos que representen erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, mayores a un año.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, provenientes de pagos

anticipados y cargos diferidos que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva. A su vez el importe reportado debe ser igual a la suma de los conceptos 95341 y 95342

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en los conceptos 95401, 95402 o 95408, 95409 según corresponda.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95341 Pagos anticipados, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los pagos anticipados que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95401 o 95408 según corresponda.

Concepto 95342 Cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los cargos diferidos que a la fecha para la cual se realiza el cómputo del capital, el plazo remanente de afectación a resultados sea igual o mayor a un año.

El importe de este concepto se considerará neto de sus correspondientes amortizaciones, deterioro, impuestos diferidos pasivos, y la participación de los trabajadores en las utilidades (PTU) diferida pasiva.

Los impuestos diferidos o PTU pasivos que hayan sido restados en este concepto no podrán considerarse para disminuir el monto neto de otros conceptos diferentes a éste y deben incluirse también, de manera informativa, en los conceptos 95402 o 95409 según corresponda.

Concepto 95355: Partidas a favor provenientes de impuestos a la utilidad y PTU diferidos
Suma de los conceptos: 95360, 95375, 95376 y 95380.

Conceptos 95360: Impuestos diferidos a favor correspondientes por pérdidas fiscales por cualquier concepto.
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los impuestos diferidos a favor correspondientes a Pérdidas Fiscales por cualquier concepto.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95375: Impuestos diferidos a favor correspondientes por Créditos fiscales por cualquier concepto.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de impuestos diferidos a favor correspondientes a Créditos fiscales por cualquier concepto

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95376: participación de los trabajadores en la utilidad diferida.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de la participación de los trabajadores (PTU) en la utilidad diferida activa neta de la partida pasiva.

La PTU pasiva que haya sido restada en este concepto no podrá considerarse para disminuir el monto de otros conceptos diferentes a éste y debe incluirse también, de manera informativa, en el concepto 95410.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 95380: Impuestos diferidos a favor provenientes de diferencias temporales
En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los impuestos diferidos activos provenientes por cualquier concepto distinto a las pérdidas fiscales y créditos fiscales.
Este concepto neto de las correspondientes partidas pasivas (concepto 95390) se resta para integrar el Capital Fundamental.

Los impuestos diferidos pasivos que se hubieren restado con los conceptos: 95315, 95320 y 95335, en ningún caso podrán disminuir este concepto.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Concepto 95385: Partidas a cargo provenientes de impuestos a la utilidad y PTU diferidos

Suma de los conceptos: 95390, 95395, 95396, 95397, 95403, 95404, 95406, 95407, 95408, 95409, 95410.

Conceptos 95390: Impuestos diferidos partidas a cargo provenientes de diferencias temporales.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los impuestos diferidos pasivos, provenientes de diferencias temporales que no se disminuyeron en los conceptos: 95315, 95320 y 95335.

Concepto 95395: Impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales utilizadas para compensar intangibles distintos al crédito mercantil.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se restan a otros intangibles distintos al crédito mercantil.
Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95315

Concepto 95396: Impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales utilizadas para compensar el crédito mercantil.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se restan al crédito mercantil.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95320.

Concepto 95397: Otras diferencias temporales utilizadas para compensar erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se restan a erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en los conceptos 95340 y 95345. A su vez el importe reportado debe ser igual a la suma de los conceptos: 95399, 95400, 95401 y 95402.

Concepto 95399 Otras diferencias temporales utilizadas para compensar pagos anticipados iguales o menores a un año.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se utilizan para compensar los pagos anticipados iguales o menores a un año.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95337

Concepto 95400 Otras diferencias temporales utilizadas para compensar cargos diferidos iguales o menores a un año.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se utilizan para compensar los cargos diferidos iguales o menores a un año.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95338.

Concepto 95401 Otras diferencias temporales utilizadas para compensar pagos anticipados mayores a un año.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se utilizan para compensar los pagos anticipados mayores a un año.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95341.

Concepto 95402 Otras diferencias temporales utilizadas para compensar cargos diferidos mayores a un año.

En este concepto deben reportarse los impuestos diferidos pasivos por diferencias temporales que se utilizan para compensar los cargos diferidos mayores a un año.

Este concepto es de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en el concepto 95342.

Conceptos 95403 al 95410 Participación de los trabajadores en las utilidades diferida pasiva utilizada para compensar las partidas referidas en la fracción n) y p) del artículo 2 bis 6.

En los conceptos 95403 al 95410 deben reportar el importe actualizado de la participación de los trabajadores (PTU) en la utilidad diferida pasiva que utilicen para compensar: i) intangibles, ii) cargos diferidos y pagos anticipados según su plazo, así como iii) PTU diferida activa, respectivamente.

Estos conceptos son de carácter informativo dado que el importe correspondiente ya se contempló en los conceptos 95337, 95338, 95341 o 95342 y 95376.

Concepto 93916: Operaciones relacionadas relevantes celebradas con posterioridad al 3 de marzo de 2011.

En este concepto se debe reportar el monto agregado de las operaciones sujetas a riesgo de crédito, a cargo de personas relacionadas relevantes, celebradas después del 4 de marzo de 2011. El monto agregado será el que se calcule conforme a lo dispuesto en el art. 2 bis 6 inciso s) y el art. 238 de la CUB.

Para efectos del cómputo, el monto de este concepto que rebase el 25 por ciento de la cantidad positiva que resulte de restar al importe referido en el párrafo anterior el importe de la suma de los conceptos referidos en los incisos b) a r) del artículo 2 bis 6 se restará para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 93910: Créditos y demás operaciones que se realicen en contravención a las disposiciones aplicables.

En este concepto deben reportarse todas aquellas operaciones (activas y pasivas) no autorizadas, o que se realicen en contravención a las disposiciones regulatorias aplicables, por ejemplo: crédito relacionados en exceso al límite legal; realizar operaciones de derivados sin contar con la autorización correspondiente; otorgar créditos o contratar pasivo en condiciones fuera de mercado, etc.

Este concepto se resta para integrar el Capital Básico.
El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto vigente hasta febrero 2026.

Concepto 95398: Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, únicamente cuando corresponda a partidas valuadas a costo amortizado

En este concepto deben reportar el resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, únicamente cuando corresponda a partidas valuadas a costo amortizado. Lo anterior, sin incluir el efecto de los impuestos a la utilidad diferida correspondientes a dicho resultado.

El importe reportado en este concepto también debe incluirse al determinar el 95066 de esta sección.

Este concepto es una deducción al Capital Fundamental siempre y cuando se registre con signo mayor a cero, si es negativo se suma al Capital.

GRANDES EXPOSICIONES

Concepto 96500: Monto excedente de grandes exposiciones, que supera los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB.

Suma de los conceptos: 96510, 96520 (hasta noviembre 2025), 96552 (a partir de diciembre 2025) y 96530. El monto excedente a reportar se refiere exclusivamente a la parte de grandes exposiciones que supera el límite correspondiente.
El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 96510: Monto excedente de grandes exposiciones, que supera el límite del 25% del capital básico.
Suma de los conceptos: 96511, 96512 (hasta noviembre 2025), 96513 y 96551(a partir de diciembre 2025). El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 96511: Monto excedente de grandes exposiciones de cualquier contraparte que en lo individual está sujeta al límite del 25%.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las exposiciones que la Institución mantenga con cualquier contraparte que en lo individual están sujetas al límite del 25% del capital básico.

Concepto 96512: Monto excedente de grandes exposiciones de contrapartes bajo el control de entidades y organismos integrantes de la administración pública federal paraestatal, que en lo individual están sujetas al límite del 25% (hasta noviembre 2025).

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las exposiciones que la Institución mantenga con contrapartes bajo el control de entidades y organismos integrantes de la administración pública federal paraestatal, que cumplen con los criterios de interdependencia económica con aquellas, pero que en lo individual están sujetas al límite del 25% del capital básico.

Concepto 96513: Monto excedente de grandes exposiciones con Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) que en lo individual están sujetas al límite del 25% del capital básico.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las exposiciones, tratándose de Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) cuando mantengan una grande exposición con Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) durante el año calendario posterior a aquel en que la Institución respectiva haya quedado incluida en la lista de entidades publicadas de importancia sistémica, que en lo individual están sujetas al límite del 25% del capital básico (art. 54 inciso b).

Concepto 96551: Monto excedente de grandes exposiciones que no estan consideradas en las fracción III del artículo 54, pero quedan bajo el control de las entidades y empresas a las que se refiere esas fraccion, o cumplen con los criterios de interdependencia económica en los términos del artículo 52, fracción IV de las disposiciones sujetas al límite del 25% (vigente a partir de diciembre 2025).

En este concepto deben reportar el monto excedente de grandes exposiciones relativo a la suma de las exposiciones con una o más contrapartes de una Institución que no estan

consideradas en las fracción III del artículo 54, pero quedan bajo el control de las entidades y empresas a las que se refiere esas fraccion, o cumplen con los criterios de interdependencia económica en los términos del artículo 52, fracción IV de las disposiciones (último párrafo del artículo 54) sujetas al límite del 25% del capital básico.

Concepto 96552: Monto excedente de grandes exposiciones, que supera el límite del 15% del capital básico (concepto vigente a partir de diciembre 2025).

Suma de los conceptos: 96520, 96553 y 96554. El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 96520: Monto excedente de grandes exposiciones con Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) que en lo individual están sujetas al límite del 15% del capital básico.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las exposiciones, tratándose de Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) cuando mantengan una grande exposición con Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local (o Global) que ya se encuentren en la lista de entidades publicadas de importancia sistémica, previo al momento de realizar el cálculo (art. 54. inciso a), que en lo individual están sujetas al límite del 15% del capital básico.

Concepto 96553: Monto excedente de grandes exposiciones con una o más contrapartes de una Institución estén bajo el Control de Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local o Instituciones de Importancia Sistémica Global, o cumplan con los criterios de interdependencia económica con las mismas, en los términos del artículo 52 (vigente a partir de diciembre 2025).

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las exposiciones, tratándose de una o más contrapartes de una Institución que estén bajo el Control de Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local o Instituciones de Importancia Global, o cumplan con los criterios de interdependencia económica con las mismas, en los términos del artículo 52 (artículo 54 inciso c), sujetas al límite del 15% del capital básico.

Concepto 96554: Monto excedente de grandes exposiciones que no estan consideradas en las fracción II del artículo 54, pero quedan bajo el control de de las sociedades financieras de objeto múltiple, o cumplen con los criterios de interdependencia económica en los términos del artículo 52, fracción IV de las disposiciones sujetas al límite del 15% (vigente a partir de diciembre 2025).

En este concepto deben reportar el monto excedente de grandes exposiciones relativo a la suma de las exposiciones con una o más contrapartes de una Institución que no estan consideradas en las fracción II del artículo 54, pero quedan bajo el control de las

sociedades financieras de objeto múltiple, o cumplen con los criterios de interdependencia económica en los términos del artículo 52, fracción IV de las disposiciones (último párrafo del artículo 54) sujetas al límite del 25% del capital básico.

Concepto 96530: Monto excedente de grandes exposiciones cuyo límite es del 100% del capital básico.

Suma de los conceptos: 96531, 96532 y 96533. El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 96531: Monto excedente de grandes exposiciones con sociedades financieras de objeto múltiple que en lo individual están sujetas al límite del 100% del capital básico y se trate de exposiciones.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las grandes exposiciones, que la institución mantenga con cada sociedade financiera de objeto múltiple respecto de las cuales la Institución sea titular de más del 50 por ciento de las acciones representativas de su capital social y cuyo límite es del 100% del capital básico.

Concepto 96532: Monto excedente de grandes exposiciones con entidades y organismos integrantes integrantes del grupo IV a los que se refiere el artículo 2 Bis 15 que en lo individual están sujetas al límite del 100% del Capital Básico.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de los valores de las exposiciones que la Institución mantenga con integrantes del grupo IV a los que se refiere el artículo 2 Bis 15 y cuyo límite es del 100% del capital básico y se trate de exposiciones

Concepto 96533: Monto excedente de grandes exposiciones que la Institución mantenga con los 4 mayores deudores que en conjunto excedan el 100% del capital básico (concepto vigente hasta noviembre 2024).

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a la suma de las Grandes Exposiciones que la Institución de que se trate mantenga con los 4 mayores deudores individuales o grupos de deudores que representen Riesgo Común, cuyo límite conjunto es del 100% del Capital Básico. Las grandes exposiciones que hayan sido consideradas bajo este concepto de manera conjunta no requerirá que se reporten en otro concepto de manera individual.

Concepto 96534: Monto excedente de grandes exposiciones cuando se trate de financiamientos que otorguen las instituciones de banca de desarrollo a intermediarios financieros que en lo individual excedan el 100% del capital

básico de la institución de banca de desarrollo acreditante, conforme al artículo 55 de la CUB.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a los financiamientos que otorguen las instituciones de banca de desarrollo a intermediarios financieros, para destinarse a la contratación de créditos de conformidad con los programas que para la canalización de dichos recursos expidan las instituciones de banca de desarrollo, con independencia de que aquéllas establezcan o no una relación jurídica con los acreditados finales, recayendo el riesgo de crédito preponderantemente en los referidos intermediarios, conforme al artículo 55 de la CUB.

Concepto 96535: Monto excedente de grandes exposiciones cuyo límite es establecido conforme al artículo 59 de la CUB.

En este concepto deben reportar el monto excedente relativo a los financiamientos que otorgados por instituciones a las cuales la CNBV les establezca límites máximos inferiores o superiores a los establecidos en el artículo 54 de las Disposiciones, conforme al primer y segundo párrafo del artículo 59 de estas. El importe de las operaciones reportadas en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 96540: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Suma de los conceptos: 96541, 96542, 96543, 96544, 96545, 96546, 95647, 96548 y 96549 y 96550

Este concepto es informativo.

Concepto 96541: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de la Administración Pública Federal centralizada a que se refiere el artículo 1 de la Ley Orgánica de la Administración Pública Federal , así como aquellos sujetos de crédito a los cuales éste otorgue su garantía.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con, la Administración Pública Federal centralizada a que se refiere el artículo 1 de la Ley Orgánica de la Administración Pública Federal , así como aquellos sujetos de crédito a los cuales este otorgue su garantía en términos de la Ley Federal de Deuda Pública y,

en su caso, la Ley de Disciplina Financiera de las Entidades Federativas y los Municipios, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96542: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate del Gobierno de la Ciudad de México, entidades federativas y municipios, que correspondan a Financiamientos o a deuda estatal, (concepto vigente hasta noviembre 2024).

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con el Gobierno de la Ciudad de México, entidades federativas y municipios, que correspondan a financiamientos originados de conformidad con lo dispuesto en el artículo 33 de la Ley de Disciplina Financiera de las Entidades Federativas y los Municipios y cuenten con la garantía del Gobierno Federal, o bien que correspondan a deuda estatal

garantizada en los términos del Título Tercero, Capítulo IV de la ley citada, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96543: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de Banco de México.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con Banco de México, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96544: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate del IPAB.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con con el IPAB, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96545: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos

establecidos y se trate de los integrantes del grupo IV a que se refiere el artículo 2 Bis 15.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con los integrantes del grupo IV a que se refiere el artículo 2 Bis 15en los que, conforme a sus respectivas leyes orgánicas, el Gobierno Federal responda en todo momento por las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito materia de esta sección, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96546: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de instituciones financieras del exterior que ejerzan control de las instituciones, filiales o subsidiarias.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con grandes exposiciones con instituciones financieras del exterior que ejerzan control de las instituciones, filiales o subsidiarias directas o indirectas, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Concepto 96547: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de las cámaras de compensación de derivados, así como las contrapartes centrales en Bolsas de derivados o mercados extrabursátiles de derivados.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con las cámaras de compensación de instrumentos financieros derivados, autorizadas por la Secretaría para operar en México, así como las contrapartes centrales en Bolsas de derivados o mercados extrabursátiles de derivados, o ambos, establecidas en el exterior, que sean reconocidas por el Banco de México, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96548: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate del Banco de Pagos Internacionales, el Fondo Monetario Internacional, el Banco Central Europeo y la Unión Europea.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con el Banco de Pagos Internacionales, el Fondo Monetario Internacional, el Banco Central

Europeo y la Unión Europea, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96549: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de los organismos multilaterales de desarrollo o fomento de carácter internacional.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con los organismos multilaterales de desarrollo o fomento de carácter internacional que cumplan con los requisitos establecidos en el Anexo 1-C de la CUB, que sean publicados por la Comisión en su página de Internet, sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos.

Este concepto es informativo.

Concepto 96550: Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos y se trate de gobiernos centrales de países extranjeros y/o sus bancos centrales.

Monto relativo a la suma de las grandes exposiciones que la Institución mantenga con los gobiernos centrales de países extranjeros y/o sus bancos centrales, siempre y cuando estos cuenten con una calificación de Grado de Riesgo 1 conforme al Anexo 1-B de la CUB, distintos a aquellos registrados en los conceptos 96541, 96543 o 96548.

Este concepto es informativo.

Concepto 96550: Monto excedente de grandes exposiciones a que se refieren los artículos 54 y 59 de la CUB , que son exceptuados de la resta del concepto establecido en el artículo 2 Bis 6, fracción I, inciso t). Concepto vigente a partir de diciembre 2025.

Monto relativo a la suma de los excedentes de las grandes exposiciones a que se refieren los artículos 54 y 59 de la CUB, que conforme a lo establecido en el artículo 61, la Institución obtiene aprobación de la CNBV para tratarla como una excepción a lo establecido en el artículo 2 Bis 6, fracción I, inciso t). Este concepto se restará del concepto 96500 para no considerarse como una deducción al capital fundamental.
Al dejar no ser un concepto que se reste del capital fundamental el monto de estas operaciones se deben registrar para efectos de la ponderación por riesgo de crédito de los activos sujetos a riesgo en las secciones que corresponda.

Concepto 94500: Acciones y títulos relativos a las inversiones del "Fondo de reservas de pensiones y jubilaciones y demás prestaciones al personal"

Sin perjuicio de que el importe de estas inversiones debe incluirse también en el resto de los conceptos de esta sección RC09, según corresponda, y para poder determinar de manera agregada cuáles inversiones corresponden a la Institución y cuáles al fondo de reservas, en este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones y títulos que deban restarse para integrar el Capital Básico de la Institución, que hayan sido realizadas por el "Fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal" siempre que este sea de "beneficios definidos".

Este concepto es informativo.

Concepto 95662: Indicador relativo al registro, listado y mantenimiento en la bolsa de valores de los Títulos Representativos del Capital.

En este concepto debe reportarse hasta noviembre 2017 conforme a lo siguiente:

El número 1000, cuando los Títulos Representativos de Capital de la Institución o la Sociedad Controladora del grupo financiero al que, en su caso pertenezca, se encuentran inscritos en el Registro Nacional de Valores y cumplen con los requisitos de listado y mantenimiento de la bolsa de valores en la que listen sus acciones, conforme a los establecido en la Ley del Mercado de Valores y las disposiciones de carácter general que de ella emanen.

El número 2000, cuando los Títulos Representativos de Capital de la Institución o la Sociedad Controladora del grupo financiero al que, en su caso pertenezca, NO se encuentran inscritos en el Registro Nacional de Valores o NO cumplan con los requisitos de listado y mantenimiento de la bolsa de valores en la que listen sus acciones, conforme a los establecido en la Ley del Mercado de Valores y las disposiciones de carácter general que de ella emanen.

Este concepto se utilizará dentro de la regla de decisión para determinar el monto a computar en el Capital Básico No Fundamental y/o Capital Complementario, conforme lo dispone el artículo segundo transitorio.

Concepto 95685: Indicador relativo a si los instrumentos de capital emitidos a partir del 1 de enero de 2013 cumplen con los requisitos del anexo 1-R o 1-S y el nivel del coeficiente de capital fundamental en el que se ubica.

A partir de diciembre 2017, cuando la institución cuente con instrumentos de capital que cumplan los requisitos del anexo 1-R o 1-S, para establecer el límite de computabilidad dentro del Capital Básico no Fundamental o Complementario en este concepto debe reportar la clave correspondiente a la condición que satisfaga conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	La institución mantiene un Coeficiente de Capital Fundamental mayor o igual al 10.

2	La institución cuenta con un Coeficiente de Capital Fundamental por debajo del 10, como consecuencia de cualquier mecanismo o acto que implique una transferencia de beneficios patrimoniales a las personas a que se refiere el artículo 73 de la Ley o bien por el pago de dividendos.
3	La institución cuenta con un Coeficiente de Capital Fundamental inferior a 10 y en la solicitud de autorización que corresponde otorgar al Banco de México conforme al artículo 64 de la Ley, así como en el acta de emisión o el documento equivalente, en los títulos representativos de dichos Instrumentos de Capital, en el prospecto informativo correspondiente y en el acta de asamblea general de accionistas que autorice la emisión respectiva, contempla expresamente la obligación incondicional a cargo de la institución de banca múltiple emisora de que el monto del Capital Fundamental con el que esta cuente a la fecha en que presente la referida solicitud de autorización, no disminuirá en términos absolutos, en virtud de cualquier mecanismo o acto que implique una transferencia de beneficios patrimoniales a las personas a que se refiere el artículo 73 de la Ley o bien por el pago de dividendos, hasta en tanto dichos Instrumentos de Capital sean amortizados en su totalidad, o mientras mantenga un Coeficiente de Capital Fundamental inferior al 10.
4	La institución cuenta con un Coeficiente de Capital Fundamental por debajo del 10 % y no se encuentra en ninguno de los supuestos 2 o 3 de este catálogo

Concepto 95688: Indicador de reestructura o renovación de acuerdo al Oficio P417/2020

En este concepto debe reportarse la clave que corresponda indicando si la institución reestructura o renueva créditos cumpliendo los términos y condiciones contenidos en el oficio P417/2020.

Clave	Descripción
1000	Si aplica
2000	No aplica

Concepto 95689: Indicador de decreto de dividendos

En este concepto debe reportarse la clave que corresponda indicando si la institución realizó un decreto de dividendos en el mes.

Clave	Descripción
1000	Si decretó dividendos
2000	No decretó dividendos

DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO Y SUS COMPONENTES

El Capital Neto estará compuesto por una parte Básica y otra Complementaria.
La parte Básica a su vez se integrará por el Capital Fundamental y Capital Básico No Fundamental (Art. 2 bis 6 de la CUB vigente a partir de: 01 de abril de 2015).

Integración del Capital Básico

El Capital Fundamental se integra de los siguientes conceptos:

Operador	Concepto
+	Capital contribuido (95005 al 95037) Capital Ganado (95045 al 95068)
-	Inversiones en Entidades Financieras Nacionales o Extranjeras Inversiones en Entidades No Financieras Reservas con cargos a cuentas distintas de resultados o de capital Reservas pendientes de constituir Diferencia positiva entre Pérdidas Esperadas y Reservas Admisibles Totales Aportaciones, y Financiamientos para la adquisición de acciones de entidades distintas a las anteriores Intangibles Resultado por valuación de instrumentos por cobertura de flujos de efectivo partidas valuadas a costo amortizado Operaciones realizadas en contravención a las disposiciones aplicables Impuestos diferidos que excedan el límite establecido (Art. 2 Bis 5) Monto a deducir de operaciones realizadas con personas relacionadas relevantes Monto a deducir de operaciones realizadas con grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB

El Capital Básico No Fundamental se integra de los siguientes conceptos:

Operador	Concepto
+	Títulos Representativos del Capital Social (Anexo 1-R)
	Instrumentos de Capital (Anexo 1-R)
	Títulos a los que se refiere el Art. 64 de la L.I.C emitidos con anterioridad al 31 de diciembre 2012 y que computan conforme al cuarto artículo transitorio fracc. I, quinto transitorio fracc I y sexto transitorio

Integración del Capital Complementario

El Capital Complementario se integra de los siguientes conceptos.

Operador	Concepto
+	Títulos Representativos del Capital Social (Anexo 1-S)
	Instrumentos de Capital (Anexo 1-S), (entre 2016 y 2018 queda sujeto al límite establecido en el artículo segundo transitorio de la CUB publicada el 28 de noviembre de 2012)
	Diferencia positiva entre Reservas Totales y Pérdidas Esperadas hasta por el monto establecido en el Art. 2 Bis. 7
	Títulos a los que se refiere el Art. 64 de la L.I.C emitidos con anterioridad al 31 de diciembre 2012 y que computan conforme al cuarto artículo transitorio fracc. II y quinto transitorio frac II.

Concepto95671: Cálculo del Capital Fundamental

	Clave	Descripción
I. Capital Contribuido		
+	95005	Títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-Q
+	95010	Prima en venta de acciones de títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-Q
+	95035	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno (hasta febrero 2026)
+	95036	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno con un plazo de hasta 12 meses desde que fueron acordadas en la asamblea (a partir de marzo 2026)
+	95037	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno con un plazo de más de 12 meses desde que fueron acordadas en la asamblea en proceso de capitalización y con prórorga adicional autorizada de 6 meses para ser capitalizables (a partir de marzo 2026)
II. Capital Ganado		
+	95045	Reservas de Capital
+	95050	Resultados de ejercicios anteriores
+	95055	Resultado neto
+	95060	Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta
+	95066	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo (a partir de enero 2017)
+	95068	Resultado por remediciones por beneficios definidos a los empleados
III. Inversiones		
III.1 Inversiones en entidades financieras		
-	95130	Acciones propias adquiridas conforme a lo previsto en la LIC
-	95135	Subsidiarias financieras sujetas a requerimiento de capital
-	95146	Controladoras de grupos financieros
-	95150	Sociedades Financieras de Objeto Múltiple
-	95151	Administradoras de fondos para el retiro y Sociedades de inversión especializadas de fondos para el retiro
-	92350	Cámaras de compensación, empresas, fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad actuar como socio liquidador
-	95152	Fondos de inversión, parte relativa al capital fijo (incluye la inversión en controladoras de fondos de inversión)
-	92792	Sociedades de inversión (en acciones distintas a las del capital fijo tanto de capitales ~~como de objeto limitado~~ y de cobertura,

		cotizadas en bolsa, respecto de las cuales la tenencia de la institución exceda del 15% del capital de la sociedad de inversión, por la parte de tales sociedades que esté representada por títulos accionarios
-	95160	Organismos Multilaterales de Desarrollo o de Fomento Internacional que cuenten con calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras a la entidad emisora, igual o mejor al grado de riesgo 2 a largo plazo
-	95175	Otras entidades financieras del país distintas a las comprendidas en los conceptos anteriores
-	95176	Otras entidades financieras del exterior distintas a las comprendidas en los conceptos anteriores
III. 2 Inversiones en otros instrumentos		
-	95185	Instrumentos de deuda subordinados
-	95195	Beneficio sobre el remanente en operaciones de bursatilización
-	95200	Utilidad o incremento en el valor de los activos respecto de los activos registrados en el balance del originador
III. 3 Inversiones indirectas		
-	95215	Valores referenciados a índices accionarios
IV. Inversiones en entidades no financieras		
-	92375	Empresas (cotizadas y no cotizadas) accionistas de la propia Institución, de la controladora del grupo financiero o de las demás entidades financieras integrantes del grupo financiero, o de las filiales financieras de todas éstas
-	92389	Empresas (cotizadas y no cotizadas) relacionadas con la institución en los términos de los artículos 73, 73 BIS y 73 BIS 1 de la L.I.C., cuya inversión no derive de capitalizaciones o daciones en pago de adeudos
-	92385	Cuya capitalización o dación en pago tenga más de 5 años de haberse efectuado
-	95251	Empresas cuya Inversión derive de "capital de riesgo" (sólo para Bancos de Desarrollo). Se considera el 50% del importe.
V. Reservas		
-	95667 + 95286	Reservas constituidas con cargo a cuentas distintas de resultados o de capital
-	95668 + 95284	Reservas pendientes de constituirse
-	Cálculo sobre los conceptos 95295 y 92290 Hasta diciembre 2021	Máx. (0, (95295 Pérdidas esperadas totales – 95290 reservas admisibles totales)

-	A partir de enero 2022	Máx. (0, (95708 Pérdidas esperadas totales – 95704 reservas admisibles totales)
VI. Aportaciones y financiamientos		
-	95300	Aportaciones destinadas a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de otras entidades financieras integrantes del grupo o de las filiales financieras de todas
-	95305	Financiamiento cuyo destino directo o indirecto sea la adquisición de acciones de subsidiarias financieras de las entidades financieras integrantes del grupo
-	93910	Créditos y demás operaciones que se realicen en contravención a las disposiciones aplicables (vigente hasta febrero 2026)
VII. Intangibles		
-	95315	Intangibles distintos a crédito mercantil
-	95320	Crédito Mercantil
-	95345	Erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año, provenientes de:
Solo para fines informativos se dejarán en la vista.	C.F. 95341	Pagos anticipados, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.
Solo para fines informativos se dejarán en la vista.	C.F. 95342	Cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.

Concepto 95669: Capital Fundamental antes de Impuestos diferidos activos. = (I+II) - Suma (III a VII)

VIII. Impuestos Diferidos		
VIII.1 Impuestos diferidos, partidas a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales Se obtiene conforme al tratamiento transitorio durante 2013 a 2018, según corresponda a la fecha de cálculo:		
-	Cálculo sobre los conceptos 95360 y 95375 y 95376	Impuestos diferidos activos por pérdidas, créditos fiscales y PTU Con tratamiento transitorio de 2012 a 2018 2013 = Diferencia positiva entre (95360+95375) y10%* [(I+II) – suma (III a VII)] 2014 = Diferencia positiva entre (95360+95375) y 8%* [(I+II) – suma (III a VII)] 2015 = Diferencia positiva entre (95360+95375) y 6%* [(I+II) – suma (III a VII)] 2016 = Diferencia positiva entre (95360+95375) y 4%* [(I+II) – suma (III a VII)] 2017 = Diferencia positiva entre (95360+95375) y 2%* [(I+II) – suma (III a VII)] A partir de 2018 se restan en su totalidad los conceptos 95360 y 95375. A partir de febrero 2024 se restan en su totalidad los conceptos 95360, 95375 y 95376
VIII.2 Impuestos diferidos, partidas a favor provenientes de diferencias temporales		

-	Cálculo sobre los conceptos 95380 y 95390	Diferencia positiva (95380-95390) y 10% [(I+II) – suma (III a VIII.1)]

IX. Resultado por valuación de instrumentos por cobertura de flujos de efectivo partidas valuadas a costo amortizado		
-	(+/ -) 95398	Resultado por valuación de instrumentos por cobertura de flujos de efectivo partidas valuadas a costo amortizado (respetando el signo que reporte la institución).

Concepto 95670: Capital Fundamental antes de Personas Relacionadas Relevantes= (I+II) - Suma (III a VII)- Suma (VIII.1+VIII.2+IX)

X. Monto a deducir de operaciones realizadas con personas relacionadas relevantes		
-	Cálculo sobre el concepto 93916	Diferencia positiva entre 93916 y 25%* [(I+II) – suma (III a VIII.2)]

XI. Monto a deducir de operaciones realizadas con grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB		
-	96500	Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB. Hasta noviembre 2025.

-	Max(0, 96500-9655)	96500 Monto de operaciones realizadas con grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB menos 96555 Montos de Grandes Exposiciones que quedan exceptuados por autorización de la CNBV. A partir de diciembre 2025

Concepto 95671 Capital Fundamental total

El importe a reportar en este concepto debe ser igual a (I+II) – (III a VII) – (VIII a XI)

A partir de la información de abril 2016, el importe de este concepto también debe ser igual a la suma de los conceptos 95678 al 95681 y 95684.

Concepto 95678: CAPITAL FUNDAMENTAL que corresponde al porcentaje de la fracción II artículo 2 bis 5

Este concepto debe ser equivalente al 4.5 por ciento de los activos ponderados sujetos a riesgo totales que establece la CUB en la fracción II del artículo 2 bis 5.

En caso de que no se cumpla con el porcentaje establecido, deben reportar en este concepto el monto del capital fundamental obtenido conforme al artículo 2 bis 6.

Aplica a partir de la información de abril 2016.

Concepto 95679: CAPITAL FUNDAMENTAL que corresponde al porcentaje del suplemento de conservación de capital inciso a) del artículo 2 bis 5

En este concepto se deberá reportar el suplemento de conservación del capital equivalente al 2.5 por ciento de los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.

En caso de que no se cumpla con el suplemento hasta por el porcentaje establecido, deben reportar en este concepto la diferencia entre el monto del capital fundamental obtenido conforme al artículo 2 bis 6 y lo registrado en el concepto 95678.

Si el monto de este suplemento es cero, no se reporta el concepto.

Aplica a partir de la información de abril 2016.

Concepto 95680: CAPITAL FUNDAMENTAL que corresponde al suplemento de conservación de capital inciso b) del artículo 2 bis 5

En este concepto se reporta el suplemento de conservación de capital equivalente al porcentaje adicional de los activos ponderados sujetos a riesgo totales que corresponda al grado importancia sistémica local de la institución conforme a la siguiente tabla y a la gradualidad aplicable:

Grado de importancia sistémica definido	Porcentaje adicional al que hace mención el inciso b) de la fracción III del Artículo 2 Bis 5
I	0.60
II	0.90
III	1.20
IV	1.50
V	2.25

En caso de instituciones que hayan sido designadas con grado de importancia sistémica local pero que no cumplan con el suplemento hasta por el porcentaje establecido, deben

reportar en este concepto la diferencia entre el monto del capital fundamental obtenido conforme al artículo 2 bis 6 y lo registrado en los conceptos 95678 menos 95679.

Tratándose de instituciones que no hayan sido designadas como instituciones de importancia sistémica local o sean de la banca de desarrollo, no se reporta el concepto.

Si el monto de este suplemento es cero, no se reporta el concepto.

Aplica a partir de la información de abril 2016.

Concepto 95684: CAPITAL FUNDAMENTAL que corresponde al suplemento de conservación capital contra-cíclico inciso c) del artículo 2 bis 5

En este concepto se reporta el suplemento de conservación de capital contra-cíclico equivalente al porcentaje adicional de los activos ponderados sujetos a riesgo totales que determine la institución conforme al capítulo VI Bis 2 de la CUB.

En caso de instituciones que no cumplan con el suplemento hasta por el porcentaje determinado, deben reportar en este concepto la diferencia entre el monto del capital fundamental obtenido conforme al artículo 2 bis 6 y lo registrado en los conceptos 95678 menos 95679 y 95680.

Tratándose de instituciones que no deban mantener un suplemento de capital contra-cíclico, no se reporta el concepto.

Si el monto de este suplemento es cero, no se reporta el concepto.

Aplica a partir de la información de abril 2016.

Concepto 95681: CAPITAL FUNDAMENTAL excedente

En este concepto debe reportar la diferencia entre el capital fundamental obtenido conforme al artículo 2 bis 6 y la suma de los conceptos 95678, 95679, 95680 y 95684.
Aplica a partir de la información de abril 2016.

Si el monto de este suplemento es cero, no se reporta el concepto.

Concepto 95673: Cálculo del Capital Básico No Fundamental

XI. Títulos representativos del capital social		
+	95015	Títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-R
+	95020	Prima en venta de acciones de títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-R

Concepto 95672: Capital Básico No Fundamental antes de instrumentos de capital bajo tratamiento transitorio = Suma(XI)

XII. Instrumentos de capital		
+	Cálculo sobre el concepto 95075	Instrumentos de capital que cumplan anexo 1-R. De enero 2013 a diciembre 2015 95075 A partir de enero 2016 y hasta noviembre 2017 está sujeto al siguiente límite y condiciones: Si (Fecha>= 01/01/2016 , Fecha <=31/12/2018 , Concepto del formulario RC09 con clave "95662"=2000) entonces será el mín.{(Límite de computabilidad conforme artículo segundo transitorio, (95075)}, Si no (95075) Dónde (Límite de computabilidad conforme artículo segundo transitorio = (300,000,000 * VALOR DE LA UDI/1000) A partir de enero 2019 SI (Fecha>= 01/01/2019 y Concepto del formulario RC09 con clave "95662"=1000) entonces (95075) si no cero A partir de diciembre 2017 Máx[0, min (95075, Límite de computabilidad conjunto] Dónde Límite de computabilidad conjunto es igual a: Si concepto 95685 = 1 o 3 entonces Límite = 95075 Si concepto 95685 = 2 o 4 entonces Límite = 50% Capital Fundamental = (0.50* C.R 106053)
XIII. Títulos Art. 64 de la LIC, emitidos antes del 31 de diciembre 2012 (transitorio) Aplica hasta diciembre 2021		
+	95550	Monto máximo permitido de Obligaciones Subordinadas e Instrumentos de capital emitidos con anterioridad al 31 de diciembre de 2012 que computan como Capital Básico No Fundamental.

Concepto 95673: Capital Básico No Fundamental = XI + XII + XIII (hasta dic 2021)

Concepto 95677: Capital Básico = [(I+II) – (III a VII) – (VIII a X)]+ [(XI + XII + XIII (hasta dic 2021))]

Concepto 95640: Cálculo del Capital Complementario

XIV.	**Títulos representativos del capital social**	
+	95025	Títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-S
+	95030	Prima en venta de acciones de títulos representativos del capital social que cumplan con el anexo 1-S

Concepto 95635: Capital Complementario antes de instrumentos de capital bajo tratamiento transitorio = Suma (XIV)

XV.	**Instrumentos de capital**	
+	Cálculo sobre el concepto 95080	Instrumentos de Capital que cumplan con el anexo 1-S cuyo plazo de amortización o de vencimiento De enero 2013 a diciembre 2015 95080 A partir de enero 2016 y hasta noviembre 2017 está sujeto al siguiente límite y condiciones: SI (fecha >= 01/01/2016, fecha <=31/12/2018 y concepto del formulario RC09 con clave "95662"=2000) entonces será el mín. {(Límite de computabilidad conforme artículo segundo transitorio – XI Instrumentos de capital), (95080)}, si no (95080) A partir de enero 2019 SI (fecha >= 01/01/2019 y concepto del formulario RC09 con clave "95662"=1000) entonces (95080) si no cero A partir de diciembre 2017 Máx [0, min (95080Límite de computabilidad conforme artículo 2 bis 7 fracción II)] Dónde Límite de computabilidad conforme artículo 2 bis 7 fracción II a partir de diciembre 2017 Si concepto 95685 = 1 o 3 entonces Límite de computabilidad = 95080 Si concepto 95685 = 2 o 4 entonces Límite de computabilidad = máx [0, min (Límite de computabilidad conjunto, Monto computado en el básico)] Dónde Límite de computabilidad conjunto = 50% Capital Fundamental = (0.50* C.R 106053) Monto computado en el básico = Límite de computabilidad conjunto – Valor del concepto 95075
XVI.	**Títulos Art. 64 de la LIC, emitidos antes del 31 de diciembre 2012 (transitorio)** **Aplica hasta diciembre 2021**	
+	95555	Monto máximo permitido de Obligaciones Subordinadas e Instrumentos de capital emitidos con anterioridad al 31 de diciembre de 2012 que computan como Capital Complementario
XVII.	**Reservas que se obtiene sumando:**	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

+	Cálculo sobre los conceptos 95691,95701, 95695 A partir de enero 2022	Si Institución no utiliza met. internas entonces: Reservas admisibles computables= Min (Excedente de Reservas _ME, 1.25 % de ASRCME) Dónde: Excedente de Reservas _ME = Max(0, (95691+95701–95695) ASRCME =(Suma de los conceptos listados abajo)*12.5 Concepto REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA REQUERIMIENTO DE TOTAL FCC REQUERIMIENTO DE TOTAL CRÉDITOS ART 2 BIS 17 REFORMA REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR GARANTÍA PERSONALES (AVALES) OTORGADAS REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR APERTURA DE CRÉDITO IRREVOCABLES REQUERIMIENTOS POR OTRAS CUENTAS POR COBRAR REQUERIMIENTOS OPERACIONES RELACIONADAS REQUT.DEL ART 2 BIS 17 REQUERIMIENTO POR DEPÓSITOS Y PRÉSTAMOS REQUERIMIENTO SOBRE MONTOS NO DISPUESTOS DE LÍNEAS DE CRÉDITO REQUERIMIENTO INVERSIONES DEL FONDO DE PENSIONES BAJO EL ESQUEMA DE BENEFICIOS DEFINIDOS REQUERIMIENTO DE CAPITAL: OTRAS OPERACIONES
+	Cálculo sobre los conceptos 95704, 95713, 95708 A partir de enero 2022	Si Institución solo utiliza metodologías internas entonces: Reservas admisibles computables= Min (Excente de Reservas_MI, 0.6% de ASRCMI) Dónde: Excedente de Reservas_R_MI = Si 95704>=95708 entonces Max(0, 95704+95713–95708) Si 95704<95708 entonces 95713 ASRCMI = (Requerimiento por riesgo del acreditado/acreditada bajo metodologías internas*12.5)
+	Cálculo sobre los conceptos 95691,95701, 95695,95704, 95713,95708 A partir de enero 2022	Si Institución pertenece simultáneamente utiliza metodología estándar e interna entonces Reservas admisibles computables = Min (Reservas computables_ME, 1.25 % de ASRCME)+ Min (Reservas computables_MI, 0.6% de ASRCMI) Excedente de reservas_T = Reservas adicionales M.E.+ Reservas adicionales M.I. Reservas adicionales M.E. = Max(0, (95691+95701–95695) Reservas adicionales M.I. = Si 95704>=95708 entonces Max(0, 95704+95713–95708) Si 95704<95708 entonces 95713 Límite : 1.25% ASRCME + 0.6% ASRCMI Dónde: ASRC totales = (ASRCME + ASRCMI)*12.5 ASRCME= Activos sujetos a riesgo de acreditado/acreditada bajo metodología estándar (solo activos que generan reservas). ASRCMI = Activos sujetos a riesgo de acreditado/acreditada bajo metodología interna (solo activos que generan reservas).

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Concepto 95640: Capital Complementario = XIV + XV + XVI + XVII

Concepto 95655: Composición del Capital Neto
Conforme el Artículo 2 Bis 6, el Capital Neto se compone de dos partes:

Capital Neto (CN) = Parte Básica (CB) + Parte Complementaria (CC)

La parte básica o Capital Básico, a su vez se integra por Capital Fundamental (CF) + Capital Básico No Fundamental (CNF).

95661: Índice de Capital

En este concepto se reporta el resultado de dividir el Capital Neto entre los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales, expresado en porcentaje redondeado a la más cercana centésima de punto porcentual.

Este concepto es informativo y será validado por Banco de México.

Concepto 95674: Coeficiente de capital básico
En este concepto se reporta el resultado de dividir el Capital Básico conforme al Artículo 2 Bis 6 de LA CUB entre los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

Concepto 95675: Coeficiente de capital fundamental
En este concepto se reporta el Resultado de dividir el Capital Fundamental conforme a la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de la CUB entre los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

Concepto 95682: Coeficiente de capital fundamental sin suplementos de capital
En este concepto se reporta el Resultado de dividir el concepto 95678 entre los activos ponderados sujetos a riesgo totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

En caso que el coeficiente resulte cero, no se reporta este concepto.

Concepto 95683: Coeficiente de capital fundamental en exceso al mínimo y suplementos de capital
En este concepto se reporta el Resultado de dividir el concepto 95681 entre los activos ponderados sujetos a riesgo totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

En caso que el coeficiente resulte cero, no se reporta este concepto. Concepto 95677: Capital Básico
En este concepto se reporta la suma del capital Fundamental y el Capital Básico No Fundamental.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 10

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC10 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO POR COBERTURAS OTORGADAS A TRAVÉS DE GARANTÍAS PERSONALES, DERIVADOS DE CRÉDITO Y BURSATILIZACIONES (HASTA MAYO 2022).

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC10

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de crédito asumido por la Institución al otorgar garantías, al vender protección (mediante derivados de crédito), así como por participar en esquemas de bursatilización que se reportarán en esta sección hasta 31/05/2022.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC10

La sección RC10 está conformada por los conceptos 100000 al 104331, con dos columnas, en donde debe reportarse -en moneda nacional y conforme a los saldos contables- las cifras totales de la Institución, incluyendo los importes de agencias y sucursales en el exterior.

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC10

En esta sección se solicita la suma de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo los cálculos, en su caso, deben realizarse operación por operación.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

Tratándose de líneas de crédito irrevocables otorgadas a fideicomisos, el importe de las mismas deben registrarse exclusivamente en la columna "Importe 2" de esta sección.

IV. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deben informarse a valor razonable, conforme a los criterios establecidos por la Comisión.

V. GRADOS DE RIESGO

Los grados de riesgo a que se refieren los conceptos del formulario relativo al riesgo de crédito asumido por la Institución al otorgar garantías, al vender protección (mediante derivados de crédito) corresponden los que se señalan en el Anexo 1-B de la CUB y deben determinarse considerando, en su caso, las calificaciones otorgadas por las Instituciones Calificadoras.

VI. CALIFICACIONES

Al utilizar las calificaciones para determinar los grados de riesgo relativo al riesgo de crédito asumido por la Institución al otorgar garantías, al vender protección (mediante derivados de crédito) debe observarse lo señalado en el Art. 2 Bis 23 de la CUB relativo a Calificaciones Externas del Crédito.

VII. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC10

Esta sección no incluye la inversión en títulos con vinculación crediticia (credit linked notes) ya que tales inversiones deben reportarse en la sección RC07.

En ningún apartado de esta sección del formulario RC se incluyen las operaciones con personas relacionadas.

Se deben considerar las reservas que se encuentren constituidas al mes correspondiente al cómputo de capitalización para las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito, determinadas de conformidad con lo establecido en la Circular Única de Bancos, que no computen como capital complementario.

VII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC10

Conceptos entre las claves 100010 a 104266: Garantías Personales (avales) otorgados por la Institución

En estos conceptos debe reportarse el importe bruto de las garantías otorgadas por la Institución distintas a las garantías asumidas por su participación en esquemas de bursatilización de activos.

En estos conceptos deben incluirse, entre otras operaciones, la cartera de créditos cedida en descuento con responsabilidad de la Institución; los avales, los descuentos de papel comercial con aval de la propia Institución y los créditos simples y créditos en cuenta corriente para suscriptores de papel comercial con aval de la Institución.

Concepto 100409: Líneas de crédito no comprometidas, revocables conforme al último párrafo del artículo 2 bis 22. Así como líneas de crédito irrevocables (parte no ejercida) que cuenten con contrato en el cual el Gobierno Federal responda en todo momento por la operación sujeta a riesgo de crédito (ponderada al 0 por ciento).

En este concepto deben reportar las aperturas de líneas de crédito que no estén comprometidas, que sean cancelables incondicionalmente o bien, que permitan en la práctica una cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso por parte de las instituciones, tendrán un factor de conversión de crédito de cero por ciento; lo anterior siempre y cuando la institución demuestre que realiza un seguimiento constante de la situación financiera del prestatario y que sus Sistemas de Control Interno permiten cancelar la línea ante muestras de deterioro de la calidad crediticia del prestatario. Así como las líneas de crédito irrevocables que cuenten con contrato en el cual el Gobierno Federal responda en todo momento por la operación sujeta a riesgo de crédito, deberá considerar el monto total no ejercido neto de reservas o estimaciones (ponderada al 0 por ciento).

Conceptos entre las claves 100410 a 100639: Apertura de líneas de Crédito Irrevocables

En estos conceptos deben incluirse, entre otras operaciones, los créditos comerciales y las garantías contractuales y a primer requerimiento ("Stand by" expedidas para garantizar el cumplimiento de un financiamiento; el pago de la emisión de títulos, las garantías admisibles y no admisibles, las utilizadas como garantía de sostenimiento de oferta, garantía de la propuesta, garantía de ejecución y garantía de devolución).

Tratándose de las líneas de crédito a que se refiere la fracción II el art. 2 bis 62 de la CUB, deben registrar en los conceptos relativos a líneas de crédito por liquidez admisibles y no admisible, el importe de dichas líneas de crédito o las reservas asociadas ponderado por la ponderación más alta que corresponda a los activos subyacentes individuales cubiertos por la línea de crédito. En el cálculo del requerimiento de capital, dichos importes se convertirán al factor correspondiente según lo señala el mismo artículo.

Conceptos entre las claves 100652 a 104268: Garantías personales otorgadas por instituciones de Banca de Desarrollo con una contragarantía otorgada por un "Fideicomiso de Contragarantía"

En estos conceptos debe reportarse el importe bruto respecto de las garantías personales otorgadas por instituciones de banca de desarrollo que cuenten con una contragarantía de primeras pérdidas otorgada por un "Fideicomiso de Contragarantía" cuyos acreditados/acreditadas originales estén clasificados en los Grupos: IV, Grupo VII-A, Grupo VII Bis y Grupo IX.

En estos conceptos deben incluirse, entre otras operaciones, el monto de los avales otorgados; las reservas constituidas por la Institución de Banca de Desarrollo; las garantías reales otorgadas por el acreditado/acreditada original; el monto de las contragarantías recibidas; el monto de las reservas constituidas por el fideicomiso de contragarantía y el monto del sobrante o faltante en el programa cuando el Fondo de contragarantías sea mayor al requerimiento de capital.

Conceptos entre las claves 101010 a 104327: Cobertura vendida mediante derivados de incumplimiento crediticio

En estos conceptos debe reportarse el importe (neto, en su caso, de la pérdida que tenga que absorber el comprador de protección) que cubra el derivado de crédito considerando el grupo y grado de riesgo correspondiente al activo de referencia del derivado crediticio.

Conceptos entre las claves 101612 a 104331: Cobertura vendida mediante derivados de rendimiento total

En estos conceptos debe reportarse el importe (neto, en su caso, de la pérdida que tenga que absorber el comprador de protección) que cubra el derivado de crédito considerando el Grupo y grado de riesgo correspondiente al activo de referencia del derivado crediticio. Adicionalmente, debe anotarse en los conceptos correspondientes del formulario RC06, el valor de los activos y pasivos considerando el grupo y grado de riesgo correspondiente a la contraparte del derivado de rendimiento total.

Conceptos entre las claves 103110 a 103239: Inversiones en Títulos de Bursatilización en los que la Institución no actuó como originador de los activos subyacentes (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de las inversiones en títulos emitidos por esquemas de bursatilización cuyos activos subyacentes no fueron originados directa o indirectamente por la Institución o en los que la Institución no actuó como patrocinador, es decir en los que la Institución no haya proporcionado asesoría o gestionado el programa de bursatilización, no haya colocado los títulos emitidos por esquema de bursatilización o no haya proporcionado líneas de crédito por liquidez al esquema.

Conceptos entre las claves 103310 a 103445: Inversiones en Títulos de Bursatilización en los que la Institución actuó como originador de los activos subyacentes (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de las inversiones en títulos emitidos por esquemas de bursatilización cuyos activos subyacentes fueron originados directa o indirectamente por la Institución o en los que la Institución actuó como patrocinador, es decir que la Institución proporcionó asesoría o gestionó el programa de bursatilización, o que haya colocado los títulos emitidos por esquema de bursatilización o proporcionó líneas de crédito por liquidez al esquema.

Conceptos entre las claves 103510 a 103540: Activos Originados por la Institución que hayan sido transferidos a un Vehículo de Propósito Especial (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de activos originados por la institución que hayan sido transferidos a un Vehículo de Propósito Especial, mediante bursatilizaciones tradicionales y sintéticas; por requerimiento de capital obtenido conforme a las características del esquema de Amortización Anticipada o por requerimiento de capital correspondiente a los activos, si estos no se hubieran bursatilizado.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Conceptos entre las claves 104040 a 104050: Inversiones en títulos de bursatilización de la máxima preferencia, no calificados (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de las inversiones en títulos de bursatilización de la máxima preferencia, no calificados, cuyo cedente u originador no sea una persona relacionada en términos del art. 73 de la LIC (ponderados al promedio del conjunto de activos subyacentes y ponderados al 1250 por ciento).

Conceptos entre 103542 a 103564: Créditos otorgados para proyectos de infraestructura a través del esquema de amortización anticipada(vigente hasta 31/05/2022).

Tratándose de posiciones como inversionistas que mantengan las instituciones de Banca de Desarrollo en estos conceptos debe reportarse el importe de activos originados por los créditos otorgados para proyectos de infraestructura respaldados por el esquema de amortización anticipada que posean calificaciones de: Largo y Corto plazo Escalas Local y Global; así como por el tramo subordinado objeto de la deducción, por requerimiento de capital para el resto de las posiciones de bursatilización y por el requerimiento de capital correspondiente a los activos, si estos no se hubieran bursatilizado.

Conceptos entre 103635 a 103736: Líneas de Crédito por Liquidez otorgadas por la Institución a un Vehículo de Propósito Especial (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de activos originados por la institución a través de líneas de crédito por liquidez otorgadas por la Institución a un Vehículo de Propósito Especial y que sean: Admisibles, no calificadas con independencia del plazo original de la línea (ponderados al 1250 por ciento) y Admisibles que posean una calificación, cuya ponderación más alta de los títulos de bursatilización corresponda a: Largo y Corto plazo Escalas Local y Global bajo el esquema de bursatilización de títulos bursatilizados.

Conceptos entre 103810 a 103945: Garantías a operaciones de bursatilización de activos (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de activos originados por la institución a través de garantías a operaciones de bursatilización de activos, cuyos títulos mantengan calificaciones de: Largo y Corto plazo Escalas Local y Global.

Concepto entre 103946 a 103949: Posiciones relacionadas con esquemas (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos deben reportar las posiciones relacionadas con esquemas de primeras pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición, a que se refiere el artículo 2 bis 45 de la CUB. Las posiciones deben registrarse dependiendo de si cuentan o no con calificación.

Conceptos entre las claves 104070 a 104175 Inversión en Títulos Bursatilizados cuyos Activos Subyacentes estén conformados por Títulos o Posiciones de Bursatilización (vigente hasta 31/05/2022).

Del concepto 104130 al 104115 debe reportarse el importe de las inversiones en títulos emitidos por esquemas de bursatilización cuyos activos subyacentes sean títulos bursatilizados originados por la misma institución, el registro se realizará conforme al grado de riesgo de los títulos establecido en el anexo 1-G.

En el caso de que los activos subyacentes se traten de títulos bursatilizados no originados por la institución, debe reportarlos en los conceptos 104130 al 104175.

Conceptos entre las claves 104190 a 104235: Garantías a operaciones de bursatilización de activos cuyos Activos Subyacentes estén conformados por Títulos o Posiciones de Bursatilización (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse el importe de las garantías a operaciones de bursatilización cuyos activos subyacentes estén conformados por títulos o posiciones de bursatilización, sin importar si fueron o no originados por la institución.

Conceptos entre las claves 104236 a 104238: Esquemas de Bursatilización sintéticos derivados de garantías personales (vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos debe reportarse los requerimientos de capital para dichas posiciones estos estarán sujetos a un máximo equivalente a aquel requerimiento de capital que se habría obtenido en el evento de que los activos subyacentes no hubieran sido bursatilizados.

Conceptos entre las claves 104248 a 104252: Por cobertura a portafolios de Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de vivienda (sólo aplica a banca de desarrollo).

En estos conceptos deben reportar información relativa a los portafolios de Créditos Hipotecarios de Vivienda destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda y que cuenten con la garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo bajo Esquemas de Cobertura de Primeras Pérdidas, siempre que dicha garantía cumpla con lo señalado en el Artículo 2 Bis 39 de la CUB, para calcular su requerimiento de capital por riesgo de crédito considerando lo siguiente:

- La suma de los requerimientos de capital calculados para cada crédito del portafolio conforme a lo establecido en la CUB antes del reconocimiento del Esquema de Cobertura de Primeras Pérdidas (RK_PortafolioARC).

$$RK_Portafolio_{ARC} = \sum_{i=1}^{n} RK\ del\ i-ésimo\ crédito$$

-La suma de monto de reservas para riesgos crediticios para cada crédito del portafolio, de acuerdo con lo establecido en los Artículos 99 Bis a 99 Bis 3 de la CUB sin reconocer el Esquema de Cobertura de Primeras Pérdidas (Rvas_Portafolio).

$$Rvas_Portafolio = \sum_{i=1}^{n} Rvas\ del\ i - ésimo\ crédito$$

-El monto de la cobertura del esquema de primeras pérdidas (Mto_Cobpp) otorgada por la institución

Conceptos entre las claves 104254 a 104258: Revelación del apoyo implícito que otorga una institución a una operación de bursatilización(vigente hasta 31/05/2022).

En estos conceptos deben reportar el monto total de los requerimientos de capital por riesgo de crédito de los activos subyacentes de los Esquemas de Bursatilización vigentes tanto para los casos en los cuales hubiesen sido originadoras o cedentes como aquellos en los que no fueron originadoras o cedentes, siempre que dichos esquemas se refieran al mismo tipo de activos subyacentes que los de la estructura a la cual se le prestó Apoyo Implícito.
Estos conceptos son informativos.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 10 A

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC10A RELATIVA AL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO EN ESQUEMAS DE BURSATILIZACIONES.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC10 A

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de crédito por bursatilizaciones a partir de 30/06/2022

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC10 A

En esta sección deberán incluirse todas las operaciones por bursatilizaciones vigentes al 30/06/2022 de la institución, según lo señalado en la Circular Única de Bancos (CUB).

En esta sección NO deberán incluirse:

- Las operaciones concertadas con personas relacionadas que establece el art. 73, 73 Bis y 73 Bis I de la L.I.C.

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN RC10A

La sección RC10A está estructurada por columnas, como se muestra en la sección de "Estructuras".

En el caso que no aplique registro en alguna de las columnas del apartado, deben reportarse con el valor que por defecto se defina.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada campo reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate conforme a lo siguiente: el campo relativo a plazo efectivo debe expresarse en años; el relativo a importe, debe reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

III. REGISTROS A INFORMAR EN LA SECCIÓN RC10 A

Las operaciones que reporte la Institución relativas a sus agencias y sucursales en el exterior, deben clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubieren sido celebradas por una oficina en México.

Cada uno de los registros informados en esta sección corresponde a la agrupación de operaciones.

La unicidad del registro está definida por los siguientes "campos llave": Inst, Fecha, Clave_emisión,Esquema, Tipo_activo subyacente, Forma_part, Transferencia, Clase_bursatilización, Calificacion_GradoRgo, Tipo_tramo, Plazo_efectivo, Tipo_plazo, Punto_A y Punto_D, es decir, en el registro deberán agrupar las operaciones que cuenten con las mismas características.

INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC10A

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información

En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información

En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave_emisión

En este campo debe reportarse la clave de la emisión del esquema de bursatilización conforme al "Catálogo de Títulos denominados en MN o UDIS) que utilizan en el formulario de CVT_Reportos".

Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) en caso de no tener clave del título deberán asignar una clave interna y reportar la misma hasta que mantengan la posición en el esquema.

Campo 4: Esquema

En este campo debe reportarse el tipo de esquema de bursatilización (Tradicional, sintético o estructuras similares) tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
10	Esquema tradicional
20	Esquema sintético
30	Estructuras similares

Campo 5: Tipo_activo subyacente

En este campo debe reportarse el tipo de activo subyacente del esquema tradicional o sintético de bursatilización o lineas de créditos a esquemas de bursatilización tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
10	Créditos (distintos a hipotecas)
11	Hipotecas
12	Obligaciones
13	Derechos de cobro,
14	Bonos corporativos
15	Acciones cotizadas o no
16	Títulos bursatilizados (rebursatilizaciones de los casos anteriores)
17	Líneas de crédito
18	Derivados de crédito
19	Estructuras

Campo 6: Forma_part

En este campo debe reportarse la forma en la que participa la institución en el esquema de bursatilización tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
50	Originación
51	Inversión
52	Entidad que otorguen garantías a través de mejoras crediticias
53	Entidad que otorga líneas de crédito por liquidez
54	Entidad proveedora de coberturas de riesgo de crédito
55	Entidad que posee, conserven o adquieran algún tramo de la bursatilización por haber otorgado líneas de crédito por liquidez o mejoras crediticias.

Campo 7: Transferencia

En este campo debe reportarse el tipo de transferencia de los activos en el esquema de bursatilización independientemente de la forma de participación de la institución que reporta la información, tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
60	El esquema de bursatilización se realizó con transferencia de los activos, y satisfacen los requisitos operativos para la transferencia de riesgo en bursatilizaciones tradicionales establecidas en el Anexo 1-I de las presentes disposiciones.
61	El esquema de bursatilización se realizó con transferencia de los activos, sin embargo no satisfacen los requisitos operativos para la transferencia de riesgo en bursatilizaciones tradicionales establecidas en el Anexo 1-I de las presentes disposiciones.
63	No aplica

Las claves 61 y 63 se reservan para tratamientos especiales.

Campo 8: Clase de bursatilización

En este campo debe reportarse la clasificación que corresponda a las operaciones de que se trate tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción	Tratamientos específicos.
70	Posición de bursatilización asumida por una Institución (actuando como inversionista u originador)	
71	Posiciones relacionadas con esquemas de primeras pérdidas en los que se conserva el riesgo o se porporciona protección crediticia hasta cierto límite y que si cuenten con calificación	
72	Posiciones relacionadas con esquemas de primeras pérdidas en los que se conserva el riesgo o se porporciona protección crediticia hasta cierto límite y que no cuenten con calificación	☑
73	Posiciones en Esquemas de Bursatilización sintéticos a través de derivados de crédito de primer incumplimiento (ar 2 bis 49) siempre y cuando el producto cuente con una evaluación de crédito de una Institución Calificadora reconocida	
74	Posiciones en Esquemas de Bursatilización sintéticos a través de derivados de crédito de primer incumplimiento (art 2 bis 49) siempre y cuando el producto no cuente con una evaluación de crédito de una Institución Calificadora reconocida	☑
75	Posiciones en Esquemas de Bursatilización sintéticos a través de garantías personales siempre y cuando el producto cuente con una evaluación de crédito de una Institución Calificadora reconocida	
76	Posiciones en Esquemas de Bursatilización sintéticos a través de garantías personales siempre y cuando el producto no cuente con una evaluación de crédito de una Institución Calificadora reconocida	☑
77	Que cuenten con un mecanismo de Amortización Anticipada.	☑
78	Inversiones en títulos de bursatilización de la máxima preferencia, no calificados	☑
79	Recompra de posiciones bursatilizadas	☑
80	Revelación del apoyo implícito que otorgua una institución a una operación de bursatilización	☑
81	Líneas de Crédito por Liquidez otorgadas por la Institución a un Vehículo de Propósito Especial	

Campo 9: Calificacion_GradoRgo

En este campo debe reportarse la clave que corresponda a la calificación de las operaciones de que se trate, conforme al catálogo en el anexo 31 "Calificaciones" que se encuentra dentro de las estructuras del formulario dentro del SAIFWEB.

Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) el valor por defecto será 33700 (No calificado).

Cuando se cuente con más de una Calificación por título, las Instituciones deberán ajustarse a los criterios señalados en el Artículo 2 bis 25 de las presentes disposiciones para determinar el ponderador por riesgo de crédito aplicable y por tanto en este campo deberán anotar la clave de la calificación que resulte.

Campo 10: Tipo_tramo

En este campo debe reportarse el tipo de tramo preferente o subordinado según corresponda tomando en cuenta el catálogo siguiente.

Clave	Descripción
10	Tramos Preferentes
20	Tramos Subordinados
30	no aplica

Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) el valor por defecto será 30.

Campo 11: Plazo_efectivo

En este campo debe reportarse el plazo efectivo o de vencimiento de la posición, conforme a la metodología establecida en el Artículo 2 Bis 80, fracción I. en donde los flujos de efectivo a utilizar deberán corresponder a los pagos contractuales (principal, pagos de intereses y comisiones), ser incondicionales y no deberán depender del desempeño real de los activos subyacentes transferidos a la estructura. En caso de que esta información no esté disponible, el plazo efectivo o de vencimiento corresponderá al plazo remanente para el vencimiento del título. El valor registrado debe expresarse en años.

Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) el valor por defecto será 0.

Campo 12: Tipo_plazo

En este campo debe reportarse el tipo de metodología aplicada para el cálculo del plazo efectivo conforme al siguiente catálogo.

Clave	Descripción
1	Cálculo del plazo efectivo conforme a la metodología establecida en el Artículo 2 Bis 80, fracción I
2	En caso de que esta información no esté disponible, el plazo efectivo o de vencimiento corresponderá al plazo remanente para el vencimiento del título
3	No aplica

Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) el valor por defecto será 3.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Campo 13: Pond_ Final
En este campo debe reportarse el valor del ponderador final conforme a la metodología señalada en el artículo 2 bis 55 de la CUB tomando en cuenta el plazo efectivo, nivel de subordinación, así como los ponderadores por grados de riesgo que corresponda a las calificaciones de largo o corto plazo. Este valor será verificado por el sistema durante la transmisión con la información proporcionada en los demás campos se esta sección.
Cuando se trate de clases de bursatilizaciones con tratamiento específico (campo 8) el valor por defecto será 0.

Campo 14: Punto_A
En este campo debe reportarse el cociente de la diferencia del valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura menos el valor contable de todos los tramos que tengan igual o menor subordinación respecto a la posición, incluido el tramo al que corresponda esta última, entre el valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura.
En ningún caso, podrá ser menor a cero y deberá expresarse en porcentaje. Tratándose de posiciones de corto plazo y tratamientos específicos deben reportar un valor por defecto igual a cero.

Campo 15: Punto_D
En este campo debe reportarse el cociente de la diferencia del valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura menos el valor contable de todos los tramos que tengan menor subordinación respecto a la posición, entre el valor contable de la totalidad de los activos subyacentes transferidos a la estructura.
En ningún caso, podrá ser menor a cero y deberá expresarse en porcentaje. Tratándose de posiciones de corto plazo y tratamientos específicos deben reportar un valor por defecto igual a cero.

Campo 16: Importe
En este campo debe reportarse el importe de la posición vinculada a Esquemas de Bursatilización.

Campo 17: Req_ posición
En este campo debe reportarse el requerimiento de capital de la posición. Este campo aplica exclusivamente para clases de bursatilizaciones bajo tratamiento específico (campo 8) que señale la CUB.

Campo 18: Req_ act_ suby
En este campo debe reportarse el requerimiento de capital de los activos subyacentes, como si no se hubieran bursatilizado. Este campo aplica exclusivamente para clases de bursatilizaciones bajo tratamiento específico (campo 8) que señale la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 11

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC11 RELATIVA A LAS OPERACIONES EN MONEDA NACIONAL CON RIESGO DE MERCADO POR TASA DE RENDIMIENTO REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL (S.M.G).

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC11

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de mercado en moneda nacional por rendimiento referido al S.M.G. en las operaciones de: tenencia de títulos incluidos los otorgados en garantía sin transferencia de propiedad, compras y ventas, de títulos; reportos; préstamos de valores; contratos adelantados; intercambio de flujos de dinero (swap);opciones; créditos; redescuento de cartera, bienes a recibir en garantía (con transferencia de propiedad) y otras operaciones, esta sección aplica a las operaciones concertadas hasta antes del 13 de septiembre de 2023. Las Instituciones deberán continuar reportando las operaciones referidas al S.M.G. hasta su vencimiento, porque así lo hayan acordado contractualmente, sin hacer referencia a la Unidad de Medida y Actualización (UMA).

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC11

La sección RC11 está conformada por los conceptos 110000 al 119999, con dos columnas en donde deberá reportarse, respectivamente, la información de:

Columna 1: Operaciones de la institución con riesgo de mercado por rendimiento referido al S.M.G., tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Columna 2: Operaciones con riesgo de mercado por rendimiento referido al S.M.G. -por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión" (a que se refiere la Ley de Fondos de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior. Asimismo, operaciones con riesgo de mercado por rendimiento referido al S.M.G. -por su inversión, que no corresponda al patrimonio fijo, en fondos de inversión, bajo cualquier modalidad de participación, derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichos fondos de inversión; tanto de las oficinas en México como de las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

La columna 2 deberá reportarse considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, que formen parte del portafolio del fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción IX Art. 2 Bis 100 de la CUB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC11

En esta sección se solicita la sumatoria de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos, en su caso, deberán realizarse operación por operación.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en las "Reglas", cada operación está compuesta por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos; otro ejemplo, las operaciones de reporto, actuando como reportador, se considerarán como dos operaciones simultáneas: la cantidad de dinero a recibir computará como un activo, y los títulos a entregar como un pasivo. En tales circunstancias en lo sucesivo cuando se haga referencia a "las operaciones", en singular o plural, se podrá estar hablando de alguna de las partes de una operación o de una operación como un todo, según sea el caso.

Cada parte de las operaciones debe informarse en aquella sección a que corresponda.

Cabe señalar que hay operaciones cuyas partes están sujetas al mismo riesgo de mercado, por ejemplo, un reporto de títulos denominados en UDIS, con tasa premio real: tanto el título como el dinero se informarán en la sección RC03. Sin embargo, hay diversas operaciones cuyas partes NO están sujetas al mismo riesgo de mercado, por lo tanto, cada una de tales partes tendrá que informarse en la respectiva sección que corresponda, RC01 a RC05 o RC11; por ejemplo, en una compra de títulos con rendimiento referido al S.M.G. liquidable en pesos fecha valor 48 hrs.: Los títulos tendrán que informarse en la RC11 y el dinero a liquidar en el RC01.

Para identificar a qué sección pertenece una operación debe tenerse presente lo siguiente:

- Los títulos e instrumentos, sin excepción, se clasificarán por las características del título o instrumento, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características "del dinero" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE TÍTULO	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
CETE en tenencia	RC01
CETE a recibir por compras valor 24 horas.	RC01
Acciones en tenencia	RC05
Acciones a recibir por futuros o préstamo	RC05
Acciones a entregar por ventas 48 horas.	RC05
Títulos de deuda con tasa referida a la variación en el precio de una acción.	RC05
UDIBONOS en reporto con premio a tasa real	RC03
Bonos Brady en tenencia	RC04
Pagarés bancarios en M.N.	RC01
Pagarés bancarios en UDIS	RC03
CD's bancarios en dólares	RC04
Bondes en reporto con premio a tasa fija	RC01
UDIBONOS a recibir por compras 24 horas	RC03
Créditos a tasa CCP + X	RC01
Créditos a tasa TIIE * Y	RC01
Créditos a tasa fija en M.N.	RC01
Créditos en UDIS	RC03
Créditos a tasa real	RC03
Créditos a tasa CCP-UDIS	RC03
Créditos en moneda extranjera	RC04
Créditos en moneda nacional con tasa de interés referida al S.M.G.	RC11

Como puede observarse en los ejemplos anteriores la clasificación de los títulos o instrumentos deriva de sus propias características, sin que importen, en su caso, las características de "las operaciones asociadas".

- "El dinero", sin excepción, siempre se clasificará por las características del dinero sin importar el tipo de tasa, moneda y demás características del "título o instrumento" involucrado en la operación. A continuación, se presentan algunos ejemplos:

DINERO A RECIBIR O A ENTREGAR	RIESGO (SECCIÓN) A LA QUE PERTENECE
Por reportos en M.N. a tasa nominal, de CETES	RC01
Por compras de CETES valor 24 horas	RC01
Por compras de UDIBONOS valor 48 horas	RC01
Por futuros de dólares (dólares a recibir o a entregar)	RC04
Por futuros de dólares (pesos a recibir o a entregar)	RC01
M.E. por compraventa de Bonos Brady valor 48 horas	RC04
M.N. por opciones de acciones	RC01

V. PLAZO DE LAS OPERACIONES

Deberá determinarse el plazo particular de cada una de las partes de las operaciones. Para ello se procederá en los mismos términos de lo señalado en la instrucción anterior:

- El plazo de los títulos o instrumentos, sin excepción, se determinará según las características de los títulos o instrumentos, y en aquellas operaciones que consten de más de una parte se seguirá este mismo criterio sin importar las características (plazo) del dinero involucrado en la operación, y
- El plazo del dinero se determinará según las características del dinero, sin importar las características del título o instrumento involucrado en la operación.

"El plazo" de cada operación será equivalente al número de días que se determine (según lo señalado en el Art. 2 Bis 102 de la CUB) conforme a lo siguiente:

A) En todos los casos (tasa fija y revisable, para cualquier esquema de amortización), "el plazo" de las operaciones (dinero y títulos) inicia el último día del mes de que se trate (mes a que corresponda el reporte), sin importar la fecha de emisión, otorgamiento o contratación, según sea el caso, el tipo de operación o el tipo de tasa. Por ejemplo, para el reporte relativo a junio, "el plazo" de todas las operaciones que enseguida se señalan inicia el 30 de junio:

Pagaré emitido el 28 de diciembre, con vencimiento al 15 de noviembre.

Dinero a recibir por un reporto contratado el 30 de junio con vencimiento el 2 de enero.

Crédito a tasa ajustable al final del mes, otorgado el 7 de febrero con vencimiento el 6 de febrero.

En los ejemplos anteriores, si el reporte fuera de octubre, el inicio de todas las operaciones sería el 31 de octubre.

B) En cuanto a operaciones a tasa fija y con amortización total al vencimiento, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina al vencimiento de la operación. Ejemplos de operaciones (dinero o títulos) a tasa rendimiento referido al S.M.G. fija son:

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

- Pagarés bancarios en M.N con rendimiento liquidable al vencimiento; Dinero a recibir o a entregar por reportos con premio a tasa real fija, por opciones liquidables en moneda nacional referidas al S.M.G., etc.

En todos estos casos el plazo termina al vencimiento del título, del crédito o del dinero, según se trate.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con pago de intereses periódicos y/o con amortizaciones periódicas del principal, el plazo en días será el equivalente a la "Duración" del instrumento, calculada conforme a la fórmula indicada en el Anexo 12 de las "Reglas".

D) Respecto a operaciones con tasa de interés revisable, "el plazo" inicia el último día del mes del reporte y termina en la fecha de revisión o de ajuste de la tasa o, en su caso, la de vencimiento de la operación (o parte de la operación) cuando ya no vaya a haber más revisiones o ajustes de tasa. Ejemplos de operaciones con tasa ajustable (referidas a otra tasa de una fecha y/o plazo y/o período específico, que aplica a lapsos determinados) son:

- Certificados de depósito, bonos bancarios, obligaciones subordinadas, etc., con tasa de rendimiento referida al S.M.G. ajustable; Préstamos y créditos denominados en moneda nacional con principal referido al S.M.G. etc.

En todos estos ejemplos "el plazo" termina en la fecha de ajuste de tasa del título o crédito o dinero.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, o del crédito o del instrumento, es independiente a la fecha de su vencimiento y a la fecha de pago de los intereses; en algunos casos pueden coincidir, en otros no.

Para ilustrar lo anterior, a continuación, se dan algunos ejemplos de operaciones que tienen el mismo "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa), al margen de que son distintos sus vencimientos y sus fechas de pago de intereses, y de operaciones que tienen distinto "plazo" (determinado por la fecha de ajuste de la tasa) al margen de que tienen igual fecha de vencimiento y de pago de intereses:

EJEMPLOS DE OPERACIONES AL MISMO PLAZO

- Depósito a plazo de 3 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada 3 meses.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses pagaderos cada mes.
- Bono a 10 años, con tasa ajustable el día último de cada mes y con intereses capitalizables cada mes.

Las tres operaciones anteriores, durante su vigencia, para efectos del cómputo de capitalización tienen el mismo plazo: un mes.

EJEMPLOS DE OPERACIONES CON DISTINTO PLAZO

- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada mes y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable cada dos meses y con pago de intereses el día último de cada mes.
- Crédito a 1 año, con tasa ajustable el sexto mes y con pago de intereses el día último de cada mes.

Las tres operaciones anteriores para efectos del cómputo de capitalización tienen distinto plazo:

- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente, suponiendo que se hubieran otorgado el día último del mes X;
- 1 mes, 1 mes y 5 meses, respectivamente, en el mes X+1;
- 1 mes, 2 meses y 4 meses, respectivamente, en el mes X+2;
- 1 mes, 1 mes y 3 meses, respectivamente en el mes X+3;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+5;
- 1 mes, 2 meses y 6 meses, respectivamente en el mes X+6;
- ....
- 1 mes, 1 mes y 1 mes, respectivamente en el mes X+11.

Lo señalado en los incisos anteriores podría resumirse de la siguiente manera: "el plazo" serán los días que van del último día del mes de que se trate (mes del reporte) al día en que los correspondientes recursos (operación activa u operación pasiva) van a ser objeto de una repreciación (nueva tasa), lo cual ocurre:

- Al vencimiento si la operación es a tasa fija sin pago de cupones (ni intereses ni principal), ya que los recursos al vencimiento se destinan a otra operación,
- Al plazo resultante de aplicar la fórmula de la "Duración" si la operación es a tasa fija con pagos parciales de intereses y/o de principal, ya que los recursos se destinarán a otra operación, en promedio, al plazo que se obtenga de la fórmula de la Duración, y
- A la fecha de revisión o ajuste de la tasa si la operación se pactó con tales características, en este caso aunque los recursos sigan destinados a la misma operación a partir de dicha fecha de revisión o ajuste tienen una tasa (precio) distinta.

En cuadro denominado "plazo de las operaciones" que se encuentra en las Ayudas del Sistema de Acopio, se señalan las partes de que están constituidas diversas operaciones y la forma de determinar su plazo.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC11

Considerando el procedimiento establecido en las "Reglas" para determinar la exposición a riesgo de mercado y el respectivo requerimiento de capital, esta sección está constituida por dos subsecciones:

- La primera (del concepto 110000 al 115999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportarse la totalidad de "las operaciones", clasificadas en el apartado a que correspondan y conforme a su particular plazo. Lo anterior implica que en esta subsección no podrán omitirse operaciones, no obstante que conforme a las "Reglas" sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 116000 al 119999), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del inciso a) fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, y de lo señalado en la instrucción VII siguiente.

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportarse exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en el inciso a) fracción II del Art. 2 Bis 102 de la CUB, que a la letra establece:

"(*o fracción II del Artículo 152 de las Disposiciones)* Las operaciones iguales de naturaleza contraria se compensarán por el monto en que una cubra a la otra. Al efecto, las operaciones, o la parte de que se trate de éstas, deberán tratarse del mismo título o instrumento, tener igual plazo según lo señalado en la fracción I Art. 2 Bis 102 de la CUB *(o frac. I del Art. 152)* y estar referidas a un mismo subyacente. Adicionalmente, se podrán compensar cuando estén referidas al mismo subyacente y tengan el mismo plazo las operaciones siguientes:

a) Operaciones de swap listadas en mercados estandarizados con operaciones de swap realizadas en mercados extrabursátiles, y operaciones de paquetes de futuros y de contratos adelantados, comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII Art. 2 Bis 100 de la CUB, con, indistintamente, otros de los referidos paquetes de futuros o paquetes de contratos adelantados o con operaciones de swap de tasas de interés listadas en mercados estandarizados o con operaciones de swap de tasas de interés realizadas en mercados extrabursátiles.

b) Posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija que procedan de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés conforme a la fracción VI Art. 2 Bis 100 de la CUB, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en el segundo párrafo de la fracción VII Art. 2 Bis 100 de la CUB con posiciones que computan como títulos de deuda de tasa de interés fija procedentes de operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swap") de tasa de interés y con títulos de deuda de tasa de interés fija.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Para efecto de lo dispuesto en este numeral, las operaciones se entenderán como referidas a un mismo subyacente en los siguientes casos:

i. Operaciones sobre pesos y/o moneda extranjera, cuando dichas operaciones se encuentren denominadas en la misma divisa.

ii. Operaciones sobre tasas de interés, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a una misma tasa y a un mismo plazo según lo señalado en la fracción I Art. 2 Bis 102 de la CUB.

iii. Operaciones sobre índices, acciones y/o canastas de acciones, cuando dichas operaciones se encuentren referenciadas a un mismo índice, acción y/o canasta de acciones.

Se entenderá que las posiciones activas y pasivas descritas anteriormente en los incisos a), b) y c), así como en las operaciones de futuros, tienen un mismo plazo para efectos de compensación cuando:

1. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí más de un día y la que tenga el plazo menor sea de 1 a 30 días;

2. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 7 días y la que tenga el menor plazo se ubique entre 31 y 365 días; y

3. Sus plazos de vencimiento no difieran entre sí en más de 30 días y las que tenga el menor plazo se igual o mayor a 366 días.**”**

Adicionalmente, conforme a lo señalado en el Art. 2 Bis 104 de la CUB, las operaciones activas y pasivas mencionadas anteriormente se considerarán de igual plazo, para efectos de compensación, cuando les vaya a ser aplicable en su liquidación el mismo nivel del Salario Mínimo General.

Para ilustrar lo anterior, a continuación, se dan algunos ejemplos de operaciones que pueden compensarse, suponiendo que el S.M.G. se revisa una vez al año, a pesar que sus plazos respectivos son diferentes:

- ☐ Para el reporte de diciembre, se podrá compensar un título de deuda a recibir, con rendimiento referido al S.M.G., que vence en noviembre del año siguiente, con otro título de deuda a entregar con características casi idénticas, con la única diferencia que vence en junio del siguiente año.

- ☐ Para el reporte de febrero, se puede compensar la parte activa de un swap donde se recibe un subyacente referido a S.M.G., cuyo vencimiento es marzo del mismo año, con la parte pasiva de un swap donde se entrega el mismo subyacente referido al S.M.G., y cuyo vencimiento sea cualquier mes anterior a enero del siguiente año.

Cabe señalar que:

A) Se entenderá como mismo título o instrumento, cuando el activo y el pasivo sean de naturaleza semejante. Por ejemplo, no se considerarán como un mismo título o instrumento: CD’s de la banca múltiple emitidos en México y los CD’s de un banco extranjero; los CD’s no negociables de un banco extranjero y los CD’s si negociables del mismo banco extranjero; los CD’s de un banco extranjero negociables en X país y los CD’s del mismo banco extranjero no negociables en ese X país; los pesos a

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

recibir por un reporto y los dólares a entregar por una compra de un título fecha valor 48 horas, etc.

B) Dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo. Por ejemplo, son compensables:

Los Udibonos en tenencia propia o a recibir por préstamo, por reporto o por compras fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas (activo), con los Udibonos a entregar (pasivo) por reportos, préstamo o ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas; desde luego todos al mismo plazo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones, por ejemplo:

Suponiendo que se van a recibir M.N por el equivalente a 400 S.M.G. por operaciones de reporto y se van a entregar M.N por el equivalente a 100 S.M.G. por un vencimiento de un préstamo de valores. Bajo este supuesto se compensan 100 de activo con 100 de pasivo, quedando una posición activa de 300 derivada de la M.N por el equivalente a S.M.G. a recibir. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección, en M.N por el equivalente a S.M.G. a recibir por reporto 100 S.M.G. y en Moneda Nacional por el equivalente a S.M.G. a entregar por préstamo de valores 100 S.M.G.

Suponiendo las mismas operaciones anteriores y además M.N por el equivalente a 80 S.M.G. a entregar por reporto y 220 a entregar por ventas fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, se compensan 400 de activo con 400 de pasivo, sin posición residual. En la primera subsección se reportaría cada una de las operaciones por su importe total, y en la segunda subsección en M.N. por el equivalente a S.M.G. a recibir por reporto 400, M.N por el equivalente a S.M.G. a entregar por préstamo de valores 100, M.N. por el equivalente de S.M.G. a entregar por reporto 80 y Moneda Nacional por el equivalente a S.M.G. a entregar por ventas fecha valor 220

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza, por ejemplo: crédito bancario con pagaré bancario, títulos referenciados al S.M.G. con dinero o UDIBONOS con Cetes o Bonos bancarios con pagaré bancario, etc.

VIII. CONTRATOS ADELANTADOS Y OPCIONES

En las operaciones de futuro, contratos adelantados y opciones:

A) El subyacente, en todos los casos, se clasificará por las características de éste.

B) La parte de la operación relativa al "dinero", se clasificará en el RC01 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en pesos o en el RC11 si el precio futuro o de ejercicio se pactó referenciado al S.M.G. o en el RC04 si el precio futuro o de ejercicio se pactó en moneda extranjera.

C) La parte de la operación relativa al "dinero", respecto de operaciones sobre índices accionarios, se clasificará en el RC01 si se trata del IPC o de empresas

residentes en México o en el RC04 si se trata de índices accionarios de empresas residentes en otros países, lo anterior siempre y cuando "el diferencial" a liquidar se determine exclusivamente en función del respectivo índice, en cuyo caso resulta indiferente la moneda de liquidación, por ejemplo un futuro del IPC que se liquide por "el diferencial" en pesos para efectos de riesgos de mercado es igual a uno que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación (en este último caso se "asegura" la convertibilidad mas no un tipo de cambio).

En el evento que el contrato de que se trate implique que el "importe a liquidar" se determine no sólo por "el diferencial" a favor o a cargo que resulte en función del índice de referencia, la institución deberá enviar un comunicado al Banco de México, a la Subgerencia de Proyectos C, en el que se indiquen las características de la operación de que se trate, a efecto que dicho Banco de México, resuelva sobre la clasificación de las "distintas operaciones" que se deriven de la transacción. Por ejemplo, un contrato adelantado del IPC que se liquide en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre un tipo de cambio establecido desde la fecha de contratación de la transacción; en este caso la transacción podría "desdoblarse" como dos contratos adelantados: uno de IPC y otro de dólares.

IX. MONEDA DE LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES

Continuando con algunas de las ideas de la instrucción anterior, debe tenerse presente que la "moneda de liquidación" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. El ejemplo más evidente son los UDICETES y UDIBONOS, cuyo riesgo está referido al INPC y a la "tasa real", no obstante que la "moneda de su liquidación" son pesos.

Otros ejemplos para ilustrar lo anterior son:

- Supóngase un swap: variación de IPC por tasa de UDICETE, liquidable en pesos. En este caso, la parte de la operación relativa al IPC está sujeta a riesgo accionario (RC05) y la parte relativa al UDICETE está sujeta a riesgo de INPC y de "tasa real", (RC03); no obstante que la liquidación es en pesos, ninguna de sus partes está sujeta a riesgo de tasa nominal en pesos.
- Supóngase el swap anterior, con la variante que la liquidación será en dólares que resulten de dividir "el diferencial" en pesos entre el tipo de cambio del día de la liquidación. El riesgo y clasificación de este swap son exactamente iguales a los del anterior; no obstante que la "moneda de liquidación" son dólares, no existe riesgo de tipo de cambio ni de tasa de interés en dólares, y sólo se está "asegurando" la convertibilidad mas no un tipo de cambio.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse a valor razonable, conforme a los criterios establecidos por la Comisión. Tratándose de inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores), los montos reportados deberán ser netos de estimación de pérdidas crediticias esperadas correspondientes.

XI. MONTO A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC11

La forma de determinar el "monto de referencia" de una operación es independiente al "tipo de riesgo" de la operación. Por ejemplo, supóngase un contrato adelantado (de compra o venta) de acciones de Telmex, con precio pactado en pesos, por el equivalente a 100 dólares, cuya diferencia del precio pactado y el observado, en pesos, combinado con el movimiento cambiario, se traducen en una entrega de más o menos acciones, de tal forma que siempre se liquidan 100 dólares. Esta operación sólo está expuesta a riesgo de tasa de interés nominal en pesos y a riesgo accionario; el hecho de que el monto de la operación esté referido a dólares y la moneda de liquidación también sean dólares, no implica que la misma esté expuesta a riesgo de tipo de cambio o de tasa de interés en dólares. Para efectos de reporte, las partes de la operación, durante su vigencia, tendrían que reportarse: el dinero (RC01) por el importe en pesos equivalente a 100 dólares al tipo de cambio que corresponda, y la posición accionaria (RC05) por el importe en pesos que resulte de multiplicar el precio de mercado (de la acción) del día último del mes de que se trate por el número de acciones que dado el precio de ejercicio y el tipo de cambio del peso frente al dólar futuro observado se derivarían de los 100 dólares.

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC11

Conceptos 110150 – 110176: Cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los préstamos y créditos concedidos: cartera de crédito vigente o en etapa 1 y 2 así como vencida o en etapa 3; operaciones de arrendamiento financiero; préstamos al personal; la cartera de créditos comprada a descuento, sin responsabilidad del cedente; el financiamiento otorgado a intermediarios financieros relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, etc. Incluye, en su caso, el refinanciamiento o capitalización de intereses.

En estos conceptos no debe incluirse la cartera de créditos cedida en descuento por la institución, con responsabilidad de la institución, ya que tal cartera debe incluirse en los conceptos 110180 a 110193.

En el caso del financiamiento otorgado a intermediarios financieros, relativo a descuentos de cartera con responsabilidad del cedente, para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento otorgado a tales intermediarios, independientemente de las características de los créditos objeto del descuento.

La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 110180 – 110193: Cartera de créditos cedida en descuento

En estos conceptos debe reportarse la cartera de créditos cedida en descuento por la institución, con responsabilidad de la institución.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de las operaciones se considerarán las características de los créditos cedidos en descuento por la institución, independientemente de las características del financiamiento recibido por la institución a través del descuento.
La cartera vencida o en etapa 3 (capital e intereses) se clasificará en la banda 2.

El importe de cada crédito debe informarse neto de las correspondientes reservas preventivas. Si la institución no tiene identificadas individualmente la totalidad de las reservas preventivas correspondientes a cada crédito, la sumatoria de la cartera vencida o en etapa 3 y demás créditos de la banda 2 debe reportarse neta de las reservas no identificadas con algún crédito en específico.

Conceptos 110300 – 110326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 111290 a 111316.

Conceptos 110350 – 110376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 111290 a 111316.

Conceptos 110400 – 110426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.
El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable.
En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 111290 a 111316.

Conceptos 110450 - 110476: Tenencia de títulos
En estos conceptos debe incluirse el valor razonable de la tenencia de títulos de deuda

En estos conceptos no debe incluirse:
a) La tenencia de títulos emitidos por la propia institución.
b) La tenencia de títulos de deuda subordinados (la cual debe informarse en la sección "RC09").
c) La tenencia de títulos (o notas) estructurados (la cual debe informarse en los conceptos 111290 a 111316).
d) La tenencia de títulos de deuda con vinculación crediticia (la cual debe informarse en los conceptos 111350 a 111376).

Conceptos 110500 – 110526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista
En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 111290 a 111316.

Conceptos 110600 – 110626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado
Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo la fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 111290 a 111316.

Conceptos 110630 – 110656: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes referidos al S.M.G. - fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa relativa subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 110660 – 110686: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos al S.M.G.-fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte activa relativa a subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 111080 – 111106: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba un rendimiento referida al S.M.G. – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba un subyacente referido al S.M.G.

Conceptos 111140 – 111166: Emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G., así como tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un subyacente referido al S.M.G.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Tratándose de opciones emitidas, sin excepción deben incluirse todas las operaciones. En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 111170 – 111196: Emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G., así como tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte activa de las opciones en las que se reciba un subyacente referido al S.M.G.

Tratándose de opciones emitidas, sin excepción deben incluirse todas las operaciones. En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 111290– 111316: Posición activa en operaciones estructuradas relativa a subyacentes referidos al S.M.G. (parte relativa al contrato principal)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluirse la tenencia de títulos o notas estructuradas, denominadas en moneda nacional con rendimiento referido al S.M.G., emitidas por otras instituciones.

Conceptos 111320 – 111346: Posición activa en operaciones estructuradas relativas a subyacentes referidos al S.M.G. (parte relativa a los derivados implícitos)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte activa relativa a subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 111350– 111376: Tenencia de títulos con vinculación crediticia
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la tenencia de títulos de deuda, por la adquisición de títulos con vinculación crediticia, a que se refiere el segundo párrafo de la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

Conceptos 113250 – 113276: Instrumentos de captación a plazo
En estos conceptos deben incluirse los instrumentos de captación a plazo (certificados de depósito, pagarés, bonos bancarios, depósitos retirables en días preestablecidos, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, certificados bursátiles bancarios, etc.) a cargo de la institución, con excepción de los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor razonable (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 113380 – 113396: Préstamos interbancarios recibidos por operaciones de cesión de cartera de créditos

En estos conceptos deben reportarse los financiamientos recibidos correspondientes a operaciones de cesión de cartera de créditos por parte de la institución, en descuento (con responsabilidad de la institución).

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución a través del descuento, independientemente de las características de los créditos objeto de descuento.

Conceptos 113500– 113526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 114440 a 114466.

Conceptos 113550– 113576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar, actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor razonable. En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 114440 a 114466.

Conceptos 113600 – 113626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado. El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor razonable

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 114440 a 114466.

Conceptos 113650 – 113676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluirse los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las operaciones fecha valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no deben incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 114440 a 114466.

Conceptos 113700 – 113726: Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador

Este concepto NO aplica para operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y prácticas establezcan que "el reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de "títulos a recibir o a entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

En estos conceptos deben incluirse todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las fechas valor pendientes de iniciar a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor razonable.

En estos conceptos no debe incluirse los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 114440 a 114466.

Conceptos 113780 – 113806: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes relativos al S.M.G. - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva relativa a subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 113810 – 113836: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos a S.M.G. - fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva relativa a subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 114230 – 114256: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue un rendimiento referido al S.M.G. – fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe base correspondiente) de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue un subyacente referido al S.M.G.

Conceptos 114290 – 114316: Emisión de opciones y títulos opcionales de compra subyacentes referidos S.M.G., así como tenencia de opciones y títulos opcionales de venta subyacentes referidos al S.M.G. – fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un subyacente referido al S.M.G.

Tratándose de opciones emitidas, sin excepción deben incluirse todas las operaciones. En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 114320 – 114346: Emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G., así como tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. – fase pasiva
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable (el cual incluya el importe nominal correspondiente, y considere el valor "delta" respectivo) de la parte pasiva de las opciones en las que se entregue un subyacente referido al S.M.G.

Tratándose de opciones emitidas, sin excepción deben incluirse todas las operaciones. En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluirse todas las operaciones "dentro del dinero", y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 114440 – 114466: Posición pasiva en operaciones estructuradas relativa a subyacentes referidos al S.M.G. (parte relativa al contrato principal)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB, en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluirse los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución.

Conceptos 114470– 114496: Posición pasiva en operaciones estructuradas relativa a subyacentes referidos al S.M.G. (parte relativa a los derivados implícitos)
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción VIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 114500– 114526: Emisión de títulos propios con vinculación crediticia referidos al S.M.G.
En estos conceptos debe reportarse el valor razonable de la parte relativa a la emisión propia de títulos de deuda con vinculación crediticia, a que se refiere el primer párrafo de la fracción XIII del Art. 2 Bis 100 de la CUB.

USO LIMITADO

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 12 y RC12_IN

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC12 RELATIVA AL RIESGO OPERACIONAL (PARA AQUELLAS INSTITUCIONES QUE DETERMINAN EL REQUERIMIENTO DE CAPITAL BAJO EL MÉDOTO DEL INDICADOR BÁSICO, ESTÁNDAR, ESTÁNDAR ALTERNATIVO O INDICADOR DE NEGOCIO.

I. OBJETIVO DE LAS SECCIONES RC12 Y RC12_IN

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo operacional.

II. COBERTURA DE LAS SECCIONES RC12 Y RC12_IN

Los conceptos de estas secciones RC12 se refieren exclusivamente a operaciones de la Institución, consolidadas con fideicomisos UDIS sin considerar su respectiva actualización derivada de la aplicación de los efectos inflacionarios (Boletín B-10) y deberá corresponder con la información del estado de resultados integral de la institución del mes inmediato anterior.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS

SECCIÓN RC12

La sección RC12 está conformada por los conceptos 120000 a 121800 que contienen la información de ingresos y gastos tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior de manera agregada para determinar el requerimiento bajo el modelo del indicador básico, estándar o estándar alternativo.

En la columna "Importe1" deben reportar el método utilizado para determinar el requerimiento por riesgo operacional (121600), total de los ingresos o gastos (120010 a 120560), total de los préstamos y anticipos mensuales (121700) o total requerimiento de riesgo operacional bajo método avanzado (concepto 121800), según corresponda.

En las columnas "Importe2" a "Importe9", deben registrar el monto de los conceptos 120010 a 121560 desglosado por la(s) línea(s) de negocio en que se originaron, siempre que la institución esté autorizada para obtener el requerimiento por riesgo operacional bajo el método Estándar, Estándar Alternativo o Avanzado en periodo de transitoriedad.

La suma de los montos reportados en las columnas "Importe2" a "Importe9" debe ser igual al monto del campo "Importe 1".

El valor por defecto de las columnas "Importe2" a "Importe9" cuando no haya monto que registrar es cero.

SECCIÓN RC12_IN

La sección RC12_IN está conformada por los conceptos 122000 a 125100 cuya vigencia se señala en la estructura del formulario y que deberá ser consideradas en la constitución de base histórica de los 36 meses anteriores así como en el envío de información mensual. Los conceptos contienen la información tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior, de manera agregada para determinar el requerimiento de capital bajo el método del indicador de negocio.

En la columna "Importe1" deben reportar según la descripción de cada concepto y de acuerdo con el desglose y las definiciones consideradas en el Apartado D del Anexo 1-D Bis de la CUB, tratándose de conceptos del estado de resultados el monto acumulado y tratándose de cuentas del estado financiero los saldos al cierre de mes.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC12 Y RC12_IN

Las cifras de los conceptos deben reportarse con saldos al día último del mes inmediato anterior a la fecha del cómputo, en cada una de sus columnas.

Para el cálculo del requerimiento de capital por este tipo de riesgo, el flujo mensual correspondiente al mes t se calcula restando al saldo acumulado del mes t el saldo acumulado del mes t-1, con excepción de los meses de febrero en los cuales el saldo es igual al flujo por tratarse de información del mes inmediato anterior. Adicionalmente en la sección RC12_IN en el primer mes de envío de los conceptos 123080 a 125100 vigentes que será a partir de enero 2023 o enero 2022 cuando se trate de la constitución de base histórica, deberán reportar el flujo ya calculado que corresponda, esto por el cambio de conceptos que se aplicarán en dicha fecha.

La información de esta sección debe reportarse, en miles de pesos. Al efecto, las cifras de las operaciones a que se refieren los conceptos, denominadas en UDIS o en moneda extranjera, deben valorizarse al "valor en pesos de la UDI" correspondiente al cierre del mes o al "tipo de cambio peso-divisa" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión, según corresponda.

En la sección RC12, todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

En la sección RC12_IN, en aquellos conceptos que representen una utilidad o pérdida no habrá restricción de signo al reportar el importe de la operación (permite negativos)

ACLARACIONES DIVERSAS RELATIVAS A LA SECCIÓN RC12 IN

Para aquellas Instituciones que no cuenten con información de los últimos 36 meses, el requerimiento de capital por Riesgo Operacional se determinará con la información disponible y enviada al Banco de México a la fecha del cómputo, de conformidad con el procedimiento descrito en el Anexo 1-D Bis I de la CUB.

Tratándose de una Institución fusionante que calcule los componentes CIAD, CS y CF, así como el MPI con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 115 a, siempre que presente y cumpla ante la Comisión con los requisitos establecidos en el tercer párrafo, fracciones I y II, deberá actualizar su constitución de base de los últimos 36 meses a la fecha en que surta efectos la fusión. Para ello deberán enviar a la Gerencia de Información del Sistema Financiero la solicitud con la serie de fechas y grupo de conceptos que serán actualizados.

Cuando la fusionante no cumpla lo establecido en los requisitos del artículo 2 bis 115 a o CNBV determine que la estimación de los requerimientos de capital por riesgo operacional de la Institución que resulte de la fusión a que se refieren los artículos 27 de la Ley o 17 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, está subestimada, solicite las correcciones y estas no fueren solventadas, el cálculo del requerimiento por riesgo operacional se realizará utilizando sólo la información de la Institución que resulte de la fusión como una entidad de nueva creación; y el MPI, como:

$$\max\left\{\begin{matrix}1\ ;\ MPI\ de\ la\ Institución\ fusionante\ al\ último\ mes\ disponible\ ;\\ MPI\ de\ la\ Institución\ fusionada\ al\ último\ mes\ disponible\end{matrix}\right\}$$

Para cualquier institución escindente, se calcularán los componentes CIAD, CS, CF y PI, en los términos previstos en los artículos 2 Bis 114 b y 2 Bis 115 anteriores considerando la información histórica previa a su escisión.

Cuando dicha escindente cuente con autorización de la CNBV, para excluir del cálculo de los componentes CIAD, CS y CF, así como de la PI, la información histórica correspondiente a los activos, pasivos, capital y operaciones, que se traspasarán con motivo de la escisión, conforme a lo establecido en el artículo 115 bis b de la CUB, deberá actualizar su constitución de base de los últimos 36 meses a la fecha en que surta efectos el evento corporativo. Para lo cual deberán enviar a la Gerencia de Información del Sistema Financiero la solicitud con la serie de fechas y grupo de conceptos que serán actualizados.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

V. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12

Concepto 121600: Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional.
En este concepto debe reportarse en la columna "Importe1" la clave del método autorizado a la institución para determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional, conforme a los siguientes valores:

1. Si el Método por el cual se calcula el Riesgo Operacional es el Método del Indicador Básico (MIB),
2. Si el Método por el cual se calcula el Riesgo Operacional es el Método Estándar (ME)
3. Si el Método por el cual se calcula el Riesgo Operacional es el Método Estándar Alternativo (MESA)
4. Si el Método por el cual se calcula el Riesgo Operacional es el Método Avanzado (MA).

Para este concepto, las columnas que corresponden a los montos originados por líneas de negocio, deben reportarse con ceros.

Ingresos por intereses.

Al revisar las cifras, el importe de estos conceptos registrados en el campo "Importe1"se validan con el monto relativo a la cuenta que se indica en el siguiente cuadro.

Concepto RCs	Cuenta contable	Descripción
120000	500200101001	Ingresos por intereses
120010	500200102001	Intereses de efectivo y equivalentes de efectivo
120015	500200102002	Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen
120020	500200102008	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1
	500200102009	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2
120030	500200102010	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3
120040	500200102004	Intereses y rendimientos a favor provenientes de inversiones en instrumentos financieros
120050	500200102005	Intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto
120060	500200102013	Comisiones por el otorgamiento del crédito
120070	500200102015	Premios a favor en operaciones de préstamo de valores
120080	500200102016	Primas por colocación de deuda
120100	500200102017	Dividendos de instrumentos financieros que califican como instrumentos financieros de capital
120110	500200102006	Ingresos provenientes de operaciones de cobertura

Concepto 120010: Intereses de efectivo y equivalentes de efectivo.
En este concepto deben reportar Intereses de efectivo y equivalentes de efectivo tanto los cobrados como los devengados no cobrados por los depósitos en bancos y demás disponibilidades.

Concepto 120015: Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen.

Concepto 120020: Intereses por Cartera de Crédito Vigente o en Etapa 1 y 2.
En este concepto debe reportarse el importe del rendimiento generado por la cartera de crédito vigente o en Etapa 1 y 2.

Concepto 120030: Intereses por Cartera de Créditos Vencida o en etapa 3.
En este concepto debe reportarse el importe del rendimiento generado por la cartera de crédito vencida o en etapa 3.

Concepto 120040: Intereses y Rendimientos por Inversiones en Valores.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses y rendimientos cobrados como los devengados no cobrados por inversiones en valores para negociar, disponibles para la venta y conservados a vencimiento.

Concepto 120050: Intereses y Rendimientos en Operaciones de Reporto.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses y rendimientos cobrados, así como los devengados no cobrados por inversiones relativas a operaciones de reporto.

Concepto 120060: Comisiones a Favor por Operaciones de Crédito.
En este concepto debe reportarse el importe de las comisiones derivadas del otorgamiento inicial de préstamos, así como las cobradas provenientes de operaciones de crédito.

Concepto 120070: Premios a Favor por Préstamo de Valores.
En este concepto debe reportarse el importe de los premios a favor cobrados, así como los devengados no cobrados por operaciones de préstamo de valores.

Concepto 120080: Premios por Colocación de deuda.
En este concepto debe reportarse el importe de las primas a favor cobrados, así como los devengadas no cobrados por operaciones de colocación de deuda.

Concepto 120090: Concepto de Ajuste de cuentas de Gastos con Saldos Acumulados Negativos.
En este concepto debe reportarse la suma del valor absoluto del saldo negativo perteneciente a cualesquiera de los conceptos de gastos por intereses.

Para efectos del cómputo de capitalización, el importe de este concepto se suma al de los conceptos correspondientes a Ingresos por intereses.

Al efectuar la validación de las cifras con la información contable, el importe de este concepto se resta del monto de los conceptos correspondientes a Gastos por intereses.

Concepto 120100: Dividendos de instrumentos de patrimonio neto.

Concepto 120110: Ingresos Provenientes De Operaciones De Cobertura.

En este concepto debe reportarse el importe de los ingresos cobrados, así como los devengados no cobrados provenientes de operaciones de cobertura.

Gastos por intereses.

Al revisar las cifras, el importe de estos conceptos registrados en el campo "Importe1"se validan con el monto relativo a la cuenta que se indica en el siguiente cuadro.

Concepto RCs	Cuenta contable	Descripción
120510	600400202020	Intereses por depósitos de exigibilidad inmediata
120520	600400202021	Intereses por depósitos a plazo
120530	600400202023	Intereses, costos de transacción y descuentos a cargo por emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo
120560		
120590		
120610		
120540	600400202022	Intereses por préstamos interbancarios y de otros organismos
120570	600400202026	Intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto
120580	600400202029	Premios a cargo en operaciones de préstamo de valores
120620	600400202031	Costos y gastos asociados con el otorgamiento del crédito
120630	600400202027	Gastos provenientes de operaciones de cobertura
120640	600400202033	Intereses a cargo asociados con la cuenta global de captación sin movimientos

Concepto 120510: Intereses por Depósitos de Exigibilidad Inmediata.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses pagados como, así los devengados no pagados derivados de operaciones de captación tradicional de exigibilidad inmediata

Concepto 120520: Intereses por Depósitos a Plazo.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses pagados, así como los devengados no pagados derivados de operaciones de captación tradicional a plazo.

Concepto 120530: Intereses por Títulos de Crédito Emitidos.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses pagados, así como los devengados no pagados por bonos bancarios.

Concepto 120540: Intereses por Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos.
En este concepto debe reportarse el importe de intereses pagados, así como los devengados no pagados por préstamos interbancarios y de otros organismos.

Concepto 120550: Comisiones por Operaciones relativas a Captación (vigente hasta septiembre 2006).
En este concepto debe reportarse el importe de las comisiones a cargo pagadas, así como las devengadas no pagadas a cargo derivadas de préstamos recibidos por la institución o de la colocación de deuda.

Concepto 120560: Intereses por Obligaciones Subordinadas.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses a cargo pagados y los devengados no pagados derivados de obligaciones subordinadas de cualquier tipo.

El importe de este concepto registrado en el campo "Importe1"se valida con el monto relativo a la cuenta 610600000000.

Concepto 120570: Intereses y Rendimientos a Cargo en Operaciones de Reporto.
En este concepto debe reportarse el importe de intereses y rendimientos a cargo pagados y los devengados no pagados derivados de operaciones de reporto de valores.

Concepto 120580: Premios a cargo en operaciones de préstamo de valores.
En este concepto debe reportarse el importe de los premios a cargo pagados, así como los devengados no pagados por operaciones de préstamo de valores.

Concepto 120590: Descuentos por Colocación de deuda.
En este concepto debe reportarse el importe de las primas a cargo pagadas cobradas, así como las devengadas no cobradas por operaciones de colocación de deuda.

Concepto 120600: Concepto de Ajuste de cuentas de Ingresos con Saldos Acumulados Negativos.
En este concepto debe reportarse la suma del valor absoluto del saldo negativo perteneciente a cualesquiera de los conceptos de ingresos por intereses.

Para efectos del cómputo de capitalización, el importe de este concepto se suma al de los conceptos correspondientes a Gastos por intereses.

Al efectuar la validación de las cifras con la información contable, el importe de este concepto se resta del monto de los conceptos correspondientes a Ingresos por intereses.

Concepto 120610: Gastos de emisión por colocación de deuda.

Concepto 120620: Costos y gastos asociados con el otorgamiento inicial del crédito.

Concepto 120630: Gastos Provenientes De Operaciones De Cobertura.
En este concepto debe reportarse el importe de los gastos a cargo pagados y los devengados no pagados provenientes de operaciones de cobertura.

Concepto 120640: Intereses a cargo asociados con la cuenta global destinada a la beneficencia pública.
En este concepto debe reportarse el importe de los intereses a cargo asociados con la cuenta global destinada a la beneficencia pública.

Resultado por intermediación.

Concepto RCs	Cuenta contable	Descripción
121011	501400702077 cuando el importe > 0	Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados
121022	501400702081 cuando el importe > 0	Resultado por venta de colaterales recibidos
121050	501400702079 cuando el importe > 0	Resultado por compraventa de divisas
121070	501400702080 cuando el importe > 0	Resultado por compraventa de metales preciosos amonedados
121110	501400702077 cuando el importe <=0	Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados
121122	501400702081 cuando el importe <=0	Resultado por venta de colaterales recibidos
121150	501400702079 cuando el importe <=0	Resultado por compraventa de divisas
121170	501400702080cuando cuando el importe <=0	Resultado por compraventa de metales preciosos amonedados

Concepto 121011: Saldo Neto Positivo por Compra-Venta de Valores e Instrumentos Financieros Derivados.
En este concepto debe reportarse el saldo neto positivo que resulte de restar al importe de la utilidad por Compra-Venta de Valores e Instrumentos Financieros Derivados, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de valores e instrumentos financieros derivados resulte positivo, el concepto 121110 debe informarse en cero.

Concepto 121012: Ganancias realizadas provenientes de la venta de instrumentos financieros para cobrar o vender.
En este concepto debe reportarse el importe de las ganancias realizadas provenientes de la venta de instrumentos financieros para cobrar o vender, cuando la Institución en la gestión de riesgos de mercado cuente con la autorización de la Comisión para que a estos títulos se les otorgue un tratamiento similar que a los instrumentos financieros para cobrar principal e interés de conformidad con los Criterios Contables.

El importe de este concepto se restará al importe del concepto 121011 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Concepto 121022: Utilidad por compraventa de Colaterales recibidos
En caso de que el resultado por compraventa de colaterales recibidos sea positivo, el concepto 121122 debe informarse en cero.

Concepto 121050: Saldo Neto Positivo por Compra-Venta de Divisas.
En este concepto debe reportarse el saldo neto positivo que resulte de restar al importe de la utilidad por compra-venta de divisas, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de divisas resulte positivo, el concepto 121150 debe informarse en cero.

Concepto 121070: Saldo Neto Positivo por Compra-Venta de Metales.
En este concepto deben reportarse el saldo neto positivo que resulte de restar al importe la utilidad por compra-venta de metales, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de metales resulte positivo, el concepto 121170 debe informarse en cero.

Concepto 121110: Saldo Neto Negativo por Compra-Venta de Valores e Instrumentos Financieros Derivados.
En este concepto deben reportarse el valor absoluto del saldo neto negativo que resulte de restar al importe de la utilidad por Compra-Venta de Valores e Instrumentos Financieros Derivados, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de metales resulte negativo, el concepto 121011 debe informarse en cero.

Concepto 121112: Pérdidas realizadas provenientes de la venta de instrumentos financieros para cobrar o vender.

En este concepto debe reportarse el importe de las pérdidas realizadas provenientes de la venta de instrumentos financieros para cobrar o vender, cuando la Institución en la gestión de riesgos de mercado cuente con la autorización de la Comisión para que a estos títulos se les otorgue un tratamiento similar que a los instrumentos financieros para cobrar principal e interés de conformidad con los Criterios Contables.

El importe de este concepto se restará al del concepto 121110 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Concepto 121122: Pérdida por compraventa de Colaterales recibidos
En caso de que el resultado por compraventa de colaterales recibidos sea negativo, el concepto 121022 debe informarse en cero.

Concepto 121150: Saldo Neto Negativo por Compra-Venta de Divisas.
En este concepto debe reportarse el valor absoluto del saldo neto negativo que resulte de restar al importe de la utilidad por compra-venta de divisas, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de divisas negativo, el concepto 121050 debe informarse en cero.

Concepto 121170: Saldo Neto Negativo por Compra-Venta de Metales.
En este concepto deben reportarse el valor absoluto del saldo neto negativo que resulte de restar al importe de la utilidad por compra-venta de metales, el importe de la pérdida por este mismo concepto.

En caso de que el Saldo Neto por compraventa de metales resulte negativo, el concepto 121070 debe informarse en cero.

Comisiones y tarifas.

Al revisar las cifras, el importe de estos conceptos registrados en el campo "Importe1"se validan con el monto relativo a la cuenta que se indica en el siguiente cuadro.

Concepto RCs	Cuenta contable	Descripción
121510	501000301005	Comisiones y tarifas cobradas
121560	601200301006	Comisiones y tarifas pagadas

Concepto 121510: Comisiones y Tarifas Cobradas.
En este concepto debe reportarse el importe de las comisiones y tarifas cobradas por la prestación de servicios bancarios, transferencia, custodia, administración de recursos que no formen parte del margen financiero.

Concepto 121560: Comisiones y Tarifas Pagadas.
En este concepto debe reportarse el importe de las comisiones y tarifas pagadas por la prestación de servicios bancarios, transferencia, custodia, administración de recursos que no formen parte del margen financiero.

Concepto 121700: Préstamos y el monto total dispuesto de la línea de crédito mensual

En la columna "Importe4" debe registrar el saldo insoluto de los préstamos y el monto de la línea de crédito mensual no ponderado por riesgo y bruto de provisiones, de las carteras crediticias asociadas al menudeo, pequeñas y medianas empresas tratadas como minorista y derechos de cobro adquiridos frente a menudeo.

En la columna "Importe5" debe registrar el saldo insoluto de los préstamos y el monto de la línea de crédito mensual no ponderados por riesgo y brutos de provisiones, de las cantidades ejercidas en las carteras crediticias asociadas a empresas, gobiernos extranjeros, bancos, financiamiento especializado, pequeñas y medianas empresas, derechos de cobro adquiridos frente a empresas y el valor contable de los títulos conservados a vencimiento.
Este concepto debe reportarse únicamente si la institución está autorizada para determinar el requerimiento por riesgo operacional bajo el método Estándar Alternativo. La suma de las líneas de negocio de banca minorista y comercial debe reportarse en la columna "Importe1".

Concepto 121800: Requerimiento por riesgo operacional bajo Método Avanzado.

En la columna "Importe1" deben reportar el requerimiento de capital por riesgo operacional que obtenga la institución bajo el método Avanzado, siempre que cuente

con la autorización de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, conforme a lo establecido el Artículo 2 Bis 114 a de la CUB.
Si la institución se encuentra en el periodo de cálculo simultáneo de requerimiento bajo método Avanzado y Estándar o Estándar Alternativo, adicional a este concepto deben continuar reportando los conceptos 120010 al 121560 y 121700 conforme a las ayudas anteriormente descritas.
El monto reportado en este concepto se comparará con el resultado bajo el método estándar o estándar alternativo para determinar el requerimiento del mes correspondiente, conforme a la fracción IV del artículo 2 Bis 114 a.

Concepto 121910: Observancia de la institución relativo a las evaluaciones de suficiencia de capital bajo escenarios supervisores, que se realicen conforme al artículo 2 bis 117 e.

En la columna "Importe1" deben indicar si en cualquiera de las dos evaluaciones de suficiencia de capital bajo escenarios supervisores, inmediatas anteriores a la fecha de cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional que se realizan conforme al artículo 2 bis 117 de la CUB, la institución satisface la condición de que el capital neto es suficiente para mantenerse clasificado en la categoría I. Para lo anterior utilizará los valores:

1000 = Si satisface la condición en cualquiera de las dos evaluaciones
2000 = No satisface la condición en alguna o dos de las evaluaciones o no utiliza transitoriedad.

En caso de que anoten el valor 1000 bajo este concepto, la institución debe enviar a la Subgerencia de Información de Capitalización, Crédito y Estados Financieros evidencia de
tal cumplimiento hasta que venza el plazo de transitoriedad del artículo tercero o cuarto, publicado en el Diario Oficial en diciembre **2017.**

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12_IN

Versión para Bancos y SOFOM ERs.

En el Componente de **intereses, arrendamiento y dividendos** deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento

de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

Aplican para la constitución de base de los periodos anteriores a enero 2022.

122010 Ingresos por intereses

Se refiere al ingreso por interés de todos los activos financieros y otros ingresos por interés (incluye ingreso de arrendamiento financiero y operativo, y ganancia de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a lo reportado en los conceptos 122020 a 122140

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122010			Ingresos por intereses y arrendamiento
122020	+	510500000000	Intereses de cartera de crédito vigente
122030	+	510200000000	Intereses de cartera de crédito vencida
122040	+	510300000000	Intereses y rendimientos a favor provenientes de inversiones en valores
122050	+	510400000000	Intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto
122060	+	510100000000	Intereses de disponibilidades
122070	+	510600000000	Comisiones por el otorgamiento del crédito
122080	+	510700000000	Premios a favor en operaciones de préstamo de valores
122090	+	511100000000	Premios por colocación de deuda
122100	+	511200000000	Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen
122110	+	511900000000	Ingresos provenientes de operaciones de cobertura
122120	+	510800000000	Utilidad por valorización
122130	+	519900000000	Incremento por actualización de ingresos por intereses
122140	+	505032000000	Ingresos por arrendamiento (aplica solo para Bancos)
122140	+	591000000000	Ingresos por arrendamiento (aplica solo para SOFOM ERs)

122150 Gastos por intereses

Se refiere a los gastos por intereses de pasivos financieros y otros gastos por intereses (incluyendo gastos por intereses de arrendamiento financiero y operativo, pérdidas, depreciación y deterioro de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122160 a 122290

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122150			Gastos por intereses
122160	+	610100000000	Intereses por depósitos de exigibilidad inmediata (*)
122170	+	610200000000	Intereses por depósitos a plazo
122180	+	610300000000	Intereses por títulos de crédito emitidos
122230	+	611100000000	Descuentos por colocación de deuda

	+	611700000000	Gastos de emisión por colocación de deuda
122200	+	610600000000	Intereses por obligaciones subordinadas
122190	+	611400000000	Intereses por préstamos interbancarios y de otros organismos
122210	+	610400000000	Intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto
122220	+	610700000000	Premios a cargo en operaciones de préstamo de valores
122240	+	611200000000	Costos y gastos asociados con el otorgamiento del crédito
122250	+	611900000000	Gastos provenientes de operaciones de cobertura
122260	+	610800000000	Pérdida por valorización
122270	+	616100000000	Intereses a cargo asociados con la cuenta global destinada a la beneficencia pública (*)
122280	+	619900000000	Incremento por actualización de gastos por intereses
122290	Abs(importe)	505024000000	Costo financiero por arrendamiento capitalizable

122300 Ingresos por dividendos

Corresponde a los ingresos por dividendos de inversiones en acciones y fondos no consolidados en los estados financieros de la Institución, incluyendo ingresos por dividendos de subsidiarias no consolidadas, asociadas y partes relacionadas señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122310	+	505018000000	Dividendos de inversiones permanentes
122320	+	511800000000	Dividendos de instrumentos de patrimonio neto

En el componente de **activos productivos** (concepto 122330) se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del R10 Balance General que se indique.

Activos que generan interés

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122340 a 122370

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122340	+	110000000000	Disponibilidades
122350	+	130000000000	Cartera de crédito vigente
	-	133100000000	Créditos otorgados en calidad de agente del gobierno federal (**)
122360	+	120000000000	Inversiones en valores
122370	+	120700000000	Premios a recibir en operaciones de Préstamo de valores
	+	121400000000	Derivados
	-	220700000000	Préstamo de valores
	-	221400000000	Derivados

En el componente de **servicios** (concepto 122385) deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital

que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

122380 Ingresos por comisiones y tarifas

Se refiere a los ingresos percibidos por asesoría y servicios. Incluyendo aquellos recibidos por la Institución como un intermediario de servicios financieros señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122390 a 122550

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122390	+	530100000000	Avales
122400	+	530200000000	Cartas de crédito sin refinanciamiento (*)
122410	+	530300000000	Aceptaciones por cuenta de terceras personas (*)
122420	+	530400000000	Compraventa de valores
122430	+	530500000000	Apertura de cuenta (*)
122440	+	530600000000	Manejo de cuenta (*)
122450	+	530800000000	Actividades fiduciarias
122460	+	530900000000	Transferencia de fondos (*)
122470	+	531100000000	Giros bancarios (*)
122480	+	531200000000	Cheques de caja (*)
122490	+	531300000000	Cheques certificados (*)
122500	+	531400000000	Cheques de viajero (*)
122510	+	531500000000	Custodia o administración de bienes
122520	+	531600000000	Alquiler de cajas de seguridad (*)
122530	+	531700000000	Servicios de banca electrónica (*)
122540	+	539000000000	Otras comisiones y tarifas cobradas
122550	+	532100000000	Operaciones de crédito

122560 Gastos por comisiones y tarifas

Corresponde a los gastos pagados por recibir de asesoría y servicios, incluidos los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan la realización de servicios financieros, pero sin incluir los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan servicios no financieros, como logística, tecnologías de la información y recursos humanos señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122570 a 122620

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122570	+	630100000000	Bancos corresponsales (*)
122580	+	631200000000	Comisionistas
122590	+	630200000000	Transferencia de fondos
122600	+	630400000000	Préstamos recibidos
122610	+	631100000000	Colocación de deuda
122620	+	639000000000	Otras comisiones y tarifas pagadas

122630 Otros ingresos operativos

Se refiere a los ingresos por operaciones bancarias ordinarias no incluidas en otras cuentas IN, pero de naturaleza similar (ingresos de operaciones de arrendamiento deberían ser excluidas) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122640 a 122810

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
122640	+	505040000000	Recuperación de cartera de crédito
122650	+	505023000000	Recuperaciones
122660	+	505002000000	Ingresos por adquisición de cartera de crédito
122670	+	505004000000	Utilidad por cesión de cartera de crédito
122680	+	505012000000	Ingreso por opción de compra en operaciones de arrendamiento capitalizable
122690	+	505013000000	Ingreso por participación del precio de venta de bienes en operaciones de arrendamiento capitalizable
122700	Si y solo si importe > 0	505015000000	Resultado en venta de bienes adjudicados
122710	Si y solo si importe > 0	505016000000	Resultado por valuación de bienes adjudicados
122720	Si y solo si importe > 0	505050000000	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo
122730	+	505031000000	Intereses a favor provenientes de préstamos a funcionarios/as y empleado/as
122740	Si y solo si importe > 0	505052000000	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
122750	Si y solo si importe > 0	505054000000	Resultado por valuación del activo por administracion de activos financieros transferidos
122760	Si y solo si importe > 0	505056000000	Resultado por valuación del pasivo por administracion de activos financieros transferidos
122770	Si y solo si importe > 0	505058000000	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
122780	Si y solo si importe > 0	505090000000	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
122790	Si y solo si importe > 0	505089000000	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero
122800	Si y solo si importe > 0	505088000000	Resultado por posición monetaria originado por partidas no relacionadas con el margen financiero
122810	Si y solo si importe > 0	505099000000	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación (1)

122820 Otros gastos operativos

Se refiere a los gastos y pérdidas de operaciones ordinarias no incluidas en otras cuentas, pero de naturaleza similar y de eventos con pérdida operacional (gastos de arrendamiento operativo debería ser excluidos) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

En este apartado, tratándose de instituciones de Banca de Desarrollo y a partir de agosto 2023, deben incluir el monto de los Aprovechamientos que la SHCP obtenga de las mismas de conformidad con el artículo 10 de la Ley de Ingresos de la Federación. Este no computará en el cálculo del componente de servicios en otros gastos de la operación).

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 122830 a 123000. A partir de agosto 2023 y tratándose de las instituciones de banca de desarrollo se restará lo registrado en el concepto 122985 al determinar el cómputo.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE	DESCRIPCIÓN

		(CONFRONTA DE REFERENCIA)	
122830	Abs(importe)	505003000000	Gastos por adquisición de cartera de crédito
122840	Abs(importe)	505005000000	Pérdida por cesión de cartera de crédito
122850	Abs(importe)	505026000000	Quebrantos
122860	Abs(importe)	505007000000	Donativos
122870	Abs(importe)	505008000000	Pérdida por adjudicación de bienes
122880	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505015000000	Resultado en venta de bienes adjudicados
122890	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505016000000	Resultado por valuación de bienes adjudicados
122900	Abs(importe)	505010000000	Pérdida en custodia y administración de bienes
122910	Abs(importe)	505011000000	Pérdida en operaciones de fideicomiso
122920	Abs(importe)	505027000000	Intereses a cargo en financiamiento para adquisición de activos
122930	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505050000000	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo
122940	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505052000000	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
122950	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505054000000	Resultado por valuación del activo por administracion de activos financieros transferidos
122960	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505056000000	Resultado por valuación del pasivo por administracion de activos financieros transferidos
122970	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505058000000	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
122980	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505090000000	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
122985	Abs(importe)	NA	Aprovechamientos que la SHCP obtenga de instituciones de banca de desarrollo de conformidad con el artículo 10 de la Ley de Ingresos de la Federación (**)
122990	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505099000000	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación (1)
123000	Abs(importe) si y solo si importe < 0	505089000000	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero

En el **componente financiero** se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

123020 Utilidad (pérdida) neta en cartera de inversión.

Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas y diferencia cambiaria señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 123030 a 123070 y será vigente hasta agosto de 2024
123025 Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión
Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos) , cuentas de coberturas, diferencia cambiaria y valuaciones de derivados, divisas y metales preciosos) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB. Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de los reportado en los conceptos 123030 a 123074, concepto vigente a partir de septiembre de 2024

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA CONTABLE)	DESCRIPCIÓN
123030	+	540300000000	Resultado por compraventa de valores y derivados
123040	+	540600000000	Resultado por compraventa de divisas
123050	+	540700000000	Resultado por compraventa de metales preciosos amonedados (*)
123060	+	540900000000	Resultado por compraventa de colaterales recibidos
123070	+	541000000000	Costos de transacción
123072	+	540100000000	Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable 1_/
123073	+	540400000000	Resultado por valuación de divisas 1_/
123074	+	540500000000	Resultado por valuación de metales preciosos amonedados 1_/ (*)

(*) No aplica para SOFOM ERs
(**) Aplica solo para Banca de Desarrollo
1_/ Aplica solo para la constitución de base de los meses que requiera el cómputo de septiembre 2024.

Versión para Bancos.

Vigente a partir de enero 2023, sin embargo, podrán ser utilizados en enero 2022 por aquellos que obtengan aprobación de CNBV de uso anticipado del método de indicador de negocio y en general para la constitución de base (concepto 124000)

En el Componente de **intereses, arrendamiento y dividendos** deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

124010 Ingresos por interés

Se refiere al ingreso por interés de todos los activos financieros y otros ingresos por interés (incluye ingreso de arrendamiento financiero y operativo, y ganancia de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a lo reportado en los conceptos 124020 a 124140.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124020	+	500200102008	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1
124025	+	500200102009	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2
124030	+	500200102010	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3
124040	+	500200102004	Intereses y rendimientos a favor provenientes de inversiones en instrumentos financieros
124045	+	500200102005	Intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto
124050	+	500200102001	Intereses de efectivo y equivalentes de efectivo
124060	+	500200102013	Comisiones por el otorgamiento del crédito
124070	+	500200102015	Premios a favor en operaciones de préstamo de valores
124080	+	500200102016	Primas por colocación de deuda
124090	+	500200102002	Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen
124100	+	500200102006	Ingresos provenientes de operaciones de cobertura
124110	+	500200102018	Utilidad por valorización
124120	+	500200102019	Incremento por actualización de ingresos por intereses (1)
124130	+	501600802108	Ingresos por arrendamiento
124140	Abs (importe)	600800402041	Recuperación de cartera de crédito

124150 Gastos por interés

Se refiere a los gastos por intereses de pasivos financieros y otros gastos por intereses (incluyendo gastos por intereses de arrendamiento financiero y operativo, pérdidas, depreciación y deterioro de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124160 a 124260.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124160	+	600400202020	Intereses por depósitos de exigibilidad inmediata
124170	+	600400202021	Intereses por depósitos a plazo
124180	+	600400202023	Intereses, costos de transacción y descuentos a cargo por emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo
124190	+	600400202022	Intereses por préstamos interbancarios y de otros organismos
124200	+	600400202026	Intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto
124210	+	600400202029	Premios a cargo en operaciones de préstamo de valores
124220	+	600400202031	Costos y gastos asociados con el otorgamiento del crédito
124230	+	600400202027	Gastos provenientes de operaciones de cobertura
124240	+	600400202032	Pérdida por valorización
124250	+	600400202033	Intereses a cargo asociados con la cuenta global de captación sin movimientos
124260	+	600400202036	Incremento por actualización de gastos por intereses (1)

124300 Ingresos por dividendos			
Corresponde a los ingresos por dividendos de inversiones en acciones y fondos no consolidados en los estados financieros de la Institución, incluyendo ingresos por dividendos de subsidiarias no consolidadas, asociadas y partes relacionadas señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124310 y 124320.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)**	**DESCRIPCIÓN**
124310	+	502201102139	Dividendos de inversiones permanentes
124320	+	500200102017	Dividendos de instrumentos financieros que califican como instrumentos financieros de capital

En el componente de **activos productivos** (concepto 124330) se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Balance General que se indique.

Activos que generan interés			
Corresponde a los préstamos, anticipos, ingresos por valores (incluyendo bonos de gobierno), activos en renta totales anuales señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124340 a 124370.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)**	**DESCRIPCIÓN**
124340	+	100200001001	Efectivo y equivalentes de efectivo
124350	+	101800104001	Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1
	-	101800105004	Créditos otorgados en calidad de agente del gobierno federal (**)
124355	+	101800104002	Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2
124360	+	100600001001	Inversiones en instrumentos financieros
124365	+	101200001001	Préstamo de valores
124370	+	101400001001	Instrumentos financieros derivados

En el componente de **servicios** (concepto 124385) deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

124380 Ingresos por comisiones y tarifas			
Se refiere a los ingresos percibidos por asesoría y servicios. Incluyendo aquellos recibidos por la Institución como un intermediario de servicios financieros señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124390 a 124550.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)**	**DESCRIPCIÓN**

124390	+	501000502047	Avales
124400	+	501000502048	Cartas de crédito sin refinanciamiento
124410	+	501000502049	Aceptaciones por cuenta de terceras personas
124420	+	501000502050	Compraventa de instrumentos financieros
124430	+	501000502051	Apertura de cuenta
124440	+	501000502052	Manejo de cuenta
124450	+	501000502053	Actividades fiduciarias
124460	+	501000502054	Transferencia de fondos
124470	+	501000502055	Giros bancarios
124480	+	501000502056	Cheques de caja
124490	+	501000502057	Cheques certificados
124500	+	501000502058	Cheques de viajero
124510	+	501000502059	Custodia o administración de bienes
124520	+	501000502060	Alquiler de cajas de seguridad
124530	+	501000502061	Servicios de banca electrónica
124540	+	501000502062	Otras comisiones y tarifas cobradas
124550	+	501000502045	Operaciones de crédito

124560 Gastos por comisiones y tarifas

Corresponde a los gastos pagados por recibir de asesoría y servicios, incluidos los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan la realización de servicios financieros, pero sin incluir los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan servicios no financieros, como logística, tecnologías de la información y recursos humanos señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124570 a 124620.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124570	+	601200602064	Bancos corresponsales
124580	+	601200602065	Comisionistas
124590	+	601200602066	Transferencia de fondos
124600	+	601200602068	Préstamos recibidos
124610	+	601200602069	Colocación de deuda
124620	+	601200602070	Otras comisiones y tarifas pagadas

124630 Otros ingresos operativos

Se refiere a los ingresos por operaciones bancarias ordinarias no incluidas en otras cuentas IN, pero de naturaleza similar (ingresos de operaciones de arrendamiento deberían ser excluidas) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124650 a 124810.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124650	+	501600802086	Recuperaciones
124660	+	501600802087	Ingresos por adquisición de cartera de crédito

124670	+	501600802089	Utilidad por venta de cartera de crédito
124680	+	501600802091	Ingreso por opción de compra en operaciones de arrendamiento financiero
124690	+	501600802092	Ingreso por participación del precio de venta de bienes en operaciones de arrendamiento financiero
124700	Si y solo si importe > 0	501600802098	Resultado en venta de bienes adjudicados
124710	Si y solo si importe > 0	501600802099	Resultado por valuación de bienes adjudicados
124720	Si y solo si importe > 0	501600802105	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo
124730	+	501600802107	Intereses a favor provenientes de préstamos a funcionarios/as y empleados/as
124740	Si y solo si importe > 0	501600802109	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124750	Si y solo si importe > 0	501600802110	Resultado por valuación del activo por administración de activos financieros transferidos
124760	Si y solo si importe > 0	501600802111	Resultado por valuación del pasivo por administración de activos financieros transferidos
124770	Si y solo si importe > 0	501600802112	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124780	Si y solo si importe > 0	501600802113	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
124790	Si y solo si importe > 0	501600802116	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero
124800	Si y solo si importe > 0	501600802115	Resultado por posición monetaria originado por partidas no relacionadas con el margen financiero (1)
124810	Si y solo si importe > 0	501600802117	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación (1)

124820 Otros gastos operativos

Se refiere a los gastos y pérdidas de operaciones ordinarias no incluidas en otras cuentas, pero de naturaleza similar y de eventos con pérdida operacional (gastos de arrendamiento operativo debería ser excluido señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

En este apartado, tratándose de instituciones de Banca de Desarrollo y a partir de agosto 2023, deben incluir el monto de los Aprovechamientos que la SHCP obtenga de las mismas de conformidad con el artículo 10 de la Ley de Ingresos de la Federación. Este no computará en el cálculo del componente de servicios en otros gastos de la operación).

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124830 a 125000. A partir de agosto 2023 y tratándose de las instituciones de banca de desarrollo se restará lo registrado en el concepto 124985 al determinar el cómputo.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124830	Abs (Importe)	501600802088	Gastos por adquisición de cartera de crédito
124840	Abs (Importe)	501600802090	Pérdida por venta de cartera de crédito
124850	Abs (Importe)	501600802094	Quebrantos
124860	Abs (Importe)	501600802096	Donativos
124870	Abs (Importe)	501600802097	Resultado por adjudicación de bienes

124880	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802098	Resultado en venta de bienes adjudicados
124890	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802099	Resultado por valuación de bienes adjudicados
124900	Abs (Importe)	501600802101	Pérdida en custodia y administración de bienes
124910	Abs (Importe)	501600802102	Pérdida en operaciones de fideicomiso
124920	Abs (Importe)	501600802104	Intereses a cargo en financiamiento para adquisición de activos
124930	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802105	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo
124940	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802109	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124950	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802110	Resultado por valuación del activo por administración de activos financieros transferidos
124960	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802111	Resultado por valuación del pasivo por administración de activos financieros transferidos
124970	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802112	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124980	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802113	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
124985	Abs(importe)	NA	Aprovechamientos que la SHCP obtenga de instituciones de banca de desarrollo de conformidad con el artículo 10 de la Ley de Ingresos de la Federación (**)
124990	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802117	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación (1)
125000	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501600802116	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero

(**) Aplica solo para Banca de Desarrollo

En el **componente financiero** se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

125020 Utilidad (pérdida) neta en cartera de inversión.

Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas y diferencia cambiaria señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 125030 a 125070 y será vigente hasta agosto de 2024

125025 Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión

Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos) , cuentas de coberturas, diferencia cambiaria y valuaciones de derivados, divisas y metales preciosos) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de los reportado en los conceptos 125030 a 125100, concepto vigente a partir de septiembre de 2024.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
125030	+	501400702077	Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados
125040	+	501400702079	Resultado por compraventa de divisas
125050	+	501400702080	Resultado por compraventa de metales preciosos amonedados
125060	+	501400702081	Resultado por venta de colaterales recibidos
125070	+	501400702082	Costos de transacción
125080	+	501400702072	Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable 1_/
125090	+	501400702074	Resultado por valuación de divisas 1_/
125100	+	501400702076	Resultado por valuación de metales preciosos amonedados 1_/

(**) Aplica solo para Banca de Desarrollo
1_/ Aplica a partir de septiembre 2024 y solo para la constitución de base de enero 2022 a agosto 2024

Versión para SOFOM ERs.

Vigente a partir de enero 2023, sin embargo, podrán ser utilizados en enero 2022 por aquellos que obtengan aprobación de CNBV de uso anticipado del método de indicador de negocio y en general para la constitución de base (concepto 124000).

En el Componente de **intereses, arrendamiento y dividendos** deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

124010 Ingresos por interés

Se refiere al ingreso por interés de todos los activos financieros y otros ingresos por interés (incluye ingreso de arrendamiento financiero y operativo, y ganancia de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a lo reportado en los conceptos 124020 a 124140.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124020	+	500200102008	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1
124025	+	500200102009	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2
124030	+	500200102010	Intereses de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3
124040	+	500200102004	Intereses y rendimientos a favor provenientes de inversiones en instrumentos financieros
124045	+	500200102005	Intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto
124050	+	500200102001	Intereses de efectivo y equivalentes de efectivo
124060	+	500200102013	Comisiones por el otorgamiento del crédito
124070	+	500200102015	Premios a favor en operaciones de préstamo de valores (aplicable únicamente para entidades vinculadas con instituciones de crédito)
124080	+	500200102016	Primas por colocación de deuda
124090	+	500200102002	Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen
124100	+	500200102006	Ingresos provenientes de operaciones de cobertura
124110	+	500200102018	Utilidad por valorización
124120	+	500200102019	Incremento por actualización de ingresos por intereses
124130	+	501600802066	Ingresos por arrendamiento operativo
124140	Abs(Importe)	600800402039	Recuperación de cartera de crédito

124150 Gastos por interés

Se refiere a los gastos por intereses de pasivos financieros y otros gastos por intereses (incluyendo gastos por intereses de arrendamiento financiero y operativo, pérdidas, depreciación y deterioro de activos en renta) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124170 a 124260.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124170	+	600400202020	Intereses por pasivos bursátiles
124180	+	600400202022	Intereses, costos de transacción y descuentos a cargo por emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo
124190	+	600400202021	Intereses por préstamos bancarios y de otros organismos
124200	+	600400202025	Intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto (aplicable únicamente para entidades vinculadas con instituciones de crédito)
124210	+	600400202028	Premios a cargo en operaciones de préstamo de valores (aplicable únicamente para entidades vinculadas con instituciones de crédito)
124220	+	600400202029	Costos y gastos asociados con el otorgamiento del crédito
124230	+	600400202026	Gastos provenientes de operaciones de cobertura
124240	+	600400202031	Pérdida por valorización
124260	+	600400202034	Incremento por actualización de gastos por intereses

124300 Ingresos por dividendos			
Corresponde a los ingresos por dividendos de inversiones en acciones y fondos no consolidados en los estados financieros de la Institución, incluyendo ingresos por dividendos de subsidiarias no consolidadas, asociadas y partes relacionadas señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124310 y 124320.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)**	**DESCRIPCIÓN**
124310	+	502201102119	Dividendos de inversiones permanentes
124320	+	500200102017	Dividendos de inversiones en instrumentos financieros que califican como instrumentos financieros de capital

En el componente de **activos productivos** (concepto 124330) se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Balance General que se indique.

Activos que generan interés			
Corresponde a los préstamos, anticipos, ingresos por valores (incluyendo bonos de gobierno), activos en renta totales anuales señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124340 a 124370.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)**	**DESCRIPCIÓN**
124340	+	100200001001	Efectivo y equivalentes de efectivo
124350	+	101600104001	Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1
124355	+	101600104002	Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2
124360	+	100600001001	Inversiones en instrumentos financieros
124365	+	101000001001	Préstamo de valores (aplicable únicamente para entidades vinculadas con instituciones de crédito)
124370	+	101200001001	Instrumentos financieros derivados

En el componente de **servicios** (concepto 124385) deben reportar los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

124380 Ingresos por comisiones y tarifas			
Se refiere a los ingresos percibidos por asesoría y servicios. Incluyendo aquellos recibidos por la Institución como un intermediario de servicios financieros señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.			
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124390 a 124550.			
CLAVE CONCEPTO	**OPERADOR**	**CUENTA CONTABLE**	**DESCRIPCIÓN**

		(CONFRONTA DE REFERENCIA)	
124390	+	501000502044	Avales
124420	+	501000502045	Compraventa de instrumentos financieros
124450	+	501000502046	Actividades fiduciarias
124510	+	501000502047	Administración de bienes
124540	+	501000502048	Otras comisiones y tarifas cobradas
124550	+	501000502043	Operaciones de crédito

124560 Gastos por comisiones y tarifas

Corresponde a los gastos pagados por recibir de asesoría y servicios, incluidos los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan la realización de servicios financieros, pero sin incluir los pagos por la contratación de terceras personas que ofrezcan servicios no financieros, como logística, tecnologías de la información y recursos humanos señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124580 a 124620.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124580	+	601200602050	Comisionistas
124590	+	601200602052	Transferencia de fondos
124600	+	601200602053	Préstamos recibidos
124610	+	601200602054	Colocación de deuda
124620	+	601200602055	Otras comisiones y tarifas pagadas

124630 Otros ingresos operativos

Se refiere a los ingresos por operaciones bancarias ordinarias no incluidas en otras cuentas IN, pero de naturaleza similar (ingresos de operaciones de arrendamiento deberían ser excluidas) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124650 a 124810.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124650	+	501800902070	Recuperaciones
124660	+	501800902071	Ingresos por adquisición de cartera de crédito
124670	+	501800902073	Utilidad por venta de cartera de crédito
124680	+	501800902075	Ingreso por opción de compra en operaciones de arrendamiento financiero
124690	+	501800902076	Ingreso por participación del precio de venta de bienes en operaciones de arrendamiento financiero
124700	Si y solo si importe > 0	501800902081	Resultado en venta de bienes adjudicados
124710	Si y solo si importe > 0	501800902082	Resultado por valuación de bienes adjudicados
124720	Si y solo si importe > 0	501800902088	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo

124730	+	501800902090	Intereses a favor provenientes de préstamos a funcionarios/as y empleados/as
124740	Si y solo si importe > 0	501800902091	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124750	Si y solo si importe > 0	501800902092	Resultado por valuación del activo por administración de activos financieros transferidos
124760	Si y solo si importe > 0	501800902093	Resultado por valuación del pasivo por administración de activos financieros transferidos
124770	Si y solo si importe > 0	501800902094	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124780	Si y solo si importe > 0	501800902095	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
124790	Si y solo si importe > 0	501800902098	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero
124800	Si y solo si importe > 0	501800902097	Resultado por posición monetaria originado por partidas no relacionadas con el margen financiero
124810	Si y solo si importe > 0	501800902099	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación

124820 Otros gastos operativos

Se refiere a los gastos y pérdidas de operaciones ordinarias no incluidas en otras cuentas, pero de naturaleza similar y de eventos con pérdida operacional (gastos de arrendamiento operativo debería ser excluido) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.

Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 124830 a 125000.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN
124830	Abs (importe)	501800902072	Gastos por adquisición de cartera de crédito
124840	Abs (importe)	501800902074	Pérdida por venta de cartera de crédito
124850	Abs (importe)	501800902078	Quebrantos
124860	Abs (importe)	501800902079	Donativos
124870	Abs (importe)	501800902080	Resultado por adjudicación de bienes
124880	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902081	Resultado en venta de bienes adjudicados
124890	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902082	Resultado por valuación de bienes adjudicados
124900	Abs (importe)	501800902084	Pérdida en administración de bienes
124910	Abs (importe)	501800902085	Pérdida en operaciones de fideicomiso
124920	Abs (importe)	501800902087	Intereses a cargo en financiamiento para adquisición de activos

124930	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902088	Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo
124940	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902091	Resultado por valuación de los beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124950	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902092	Resultado por valuación del activo por administración de activos financieros transferidos
124960	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902093	Resultado por valuación del pasivo por administración de activos financieros transferidos
124970	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902094	Resultado en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización
124980	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902095	Otras partidas de los ingresos (egresos) de la operación
124990	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902099	Incremento por actualización de otros ingresos (egresos) de la operación
125000	Abs (importe) Si y solo si importe < 0	501800902098	Resultado por valorización de partidas no relacionadas con el margen financiero

En el **componente financiero** se reportan los saldos acumulados del mes inmediato anterior a la fecha del cálculo del requerimiento de capital que se esté enviando y estos deben coincidir con la información de las cuentas del Reporte Regulatorio R10 que se indiquen.

125020 Utilidad (pérdida) neta en cartera de inversión.
Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas y diferencia cambiaria señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB.
Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de lo reportado en los conceptos 125030 a 125070 y será vigente hasta agosto de 2024.
125025 Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión
Se refiere a las utilidades o pérdidas originadas en los activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos) , cuentas de coberturas, diferencia cambiaria y valuaciones de derivados, divisas y metales preciosos) señalados en el anexo 1-D Bis de la CUB. Deberá tener en cuenta que el monto de este concepto debe ser igual a la suma de los reportado en los conceptos 125030 a 125090, concepto vigente a partir de septiembre de 2024.

CLAVE CONCEPTO	OPERADOR	CUENTA CONTABLE (CONFRONTA DE REFERENCIA)	DESCRIPCIÓN

125030	+	501400702060	Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados
125040	+	501400702061	Resultado por compraventa de divisas
125060	+	501400702062	Resultado por venta de colaterales recibidos
125070	+	501400702063	Costos de transacción
125080	+	501400702057	Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable
125090	+	501400702059	Resultado por valuación de divisas 1_/

1_/ Aplica a partir de septiembre 2024 y solo para la constitución de base de enero 2022 a agosto 2024

Conceptos vigentes desde la adopción del ROP IN

Concepto 123080 Promedio de pérdidas anuales por riesgo operativo.

Corresponde al monto en miles de pesos de 15 veces el promedio de pérdidas anuales por Riesgo Operacional incurridas durante los 120 meses previos al cálculo de los requerimientos de capital correspondiente. Las Instituciones para la determinación de tales pérdidas deberán cumplir lo establecido en los Anexos 1-D Bis y 12-A de las presentes disposiciones.

Para efectos de calcular el promedio de las pérdidas anuales, se deberán considerar como cero tanto las pérdidas nulas o aquellas pérdidas que hayan resultado negativas después de haber considerado recuperaciones.

Las instituciones en operación al 19 de noviembre de 2020, para el cálculo de este valor, podrán aplicar el artículo tercero transitorio considerando el número de años previos al cálculo de los requerimientos de capital de acuerdo con año en el que se efectue el requerimiento de capital por riesgo operacional:

Año en que se calcula el requerimiento de capital	Número mínimo de años previos utilizados para obtener PI (promedio de las pérdidas anuales por riesgo operacional incurridas)
2020	5 años
2021	6 años
2022	7 años
2023	8 años
2024	9 años

Para efectos de la información de los años establecidos en la tabla anterior, las instituciones de crédito deberán utilizar para la determinación de las pérdidas anuales por Riesgo Operacional incurridas durante los años 2014 a la fecha en que utilicen el método del indicador de negocio para el cálculo de sus requerimientos de capital por riesgo operacional, aquellas que hubieran sido registradas dando cumplimiento a lo establecido en el Anexo 12-A, vigente en esos años.

En caso de que las Instituciones no cuenten con una base de datos de pérdidas por Riesgo Operacional que haya sido constituida en cumplimiento con lo establecido en los

Anexos 1-D Bis y 12-A por lo menos en los últimos cinco años, o bien, tenga menos de cinco años del inicio de operaciones, el importe a reportar bajo este concepto solo considerará los años disponibles y será con fines informativos hasta alcanzar el mínimo requerido en su base.

Solo en caso de que la institución cuente con autorización de la CNBV para aplicar un MPI fijo (es decir en el concepto 123090 reporta la clave 2), este concepto no debe ser reportado.

Concepto 123090 Indicador del método de determinación del multiplicador de pérdidas internas.

Se debe anotar la clave del método bajo el cual la institución determinó el multiplicador de pérdidas internas (MPI) con base en la autorización específica sobre este parámetro que tenga o no de CNBV, de acuerdo con el siguiente catálogo.

Clave	Descripción
1	Se determinó que puede tener un MPI menor a 1 durante un periodo mayor a 6 meses, acredita los requisitos señalados en los Anexos 1-D BIS y 12-A y se calcula como: MPI= ln(exp(1)-1 + (PI/CIN)^0.8
2	Con autorización de la CNBV aplica un MPI fijo
3	Utiliza un MPI conforme al primer párrafo de la fracción III del art. 2 bis 114 b. MPI= max [ln(exp(1)-1 + (PI/CIN)^0.8 , 1]

Concepto 123110 MPI asignado por la CNBV.

Corresponde al valor del MPI ordenado por la CNBV cuando las pérdidas por eventos operacionales incurridas en los últimos cinco años o un en un periodo menor, son representativas de la exposición al Riesgo Operacional de la Institución de que se trate y arrojan un MPI mayor a uno o bien el valor fijo que determine CNBV pudiendo ser este menor a uno. En caso del incumplimiento de los requisitos señalados en los Anexos 1-D Bis y 12-A de las disposiciones, o deficiencias en la administración integral del Riesgo Operacional que para serán corregidas o subsanadas, implique realizar ajustes a la base de datos histórica de eventos de pérdida por Riesgo Operacional, el MPI para el cómputo de los requerimientos de capital será aquel que resulte de considerar dichos ajustes y según determine CNBV.

Si en el concepto 123090 reporta la clave 2, entonces este campo debe ser el valor determinado por CNBV. En otro caso no deberá reportarlo.

Concepto 123120 Indicador de antigüedad de la Base de Datos por Riesgo Operacional.

Se debe anotar la clave que indicará la antigüedad de la base de datos de pérdidas de riesgo operacional o del inicio de operaciones de la institución, de acuerdo con el siguiente catálogo

Clave	Descripción
1	La Institución cuenta con una Base de datos de pérdidas por Riesgo Operacional constituida en cumplimiento con lo establecido en los Anexos 1-D Bis y 12-A y con una antigüedad que cubra al menos los últimos cinco años
2	La Institución NO cuenta con una Base de datos de pérdidas por Riesgo Operacional constituida en cumplimiento con lo establecido en los Anexos 1-D Bis y 12-A como lo señala el segundo artículo transitorio de la modificación a la CUB publicada en el DOF al 19/11/2020 o no cuenta con una antigüedad que cubra al menos los últimos cinco **años** de conformidad al último párrafo del artículo 2 Bis 114 b**.**

USO LIMITADO

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 13

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC13 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO DE LAS GARANTÍAS REALES Y PERSONALES RECIBIDAS, ASÍ COMO AL RIESGO DE CRÉDITO POR INCUMPLIMIENTO DE LOS VENDEDORES DE PROTECCIÓN.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC13

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital relativo al riesgo de crédito de las garantías reales y de las garantías personales recibidas, así como por el incumplimiento de las personas a las que la Institución les haya comprado protección mediante derivados o seguros de crédito. Este requerimiento de capital sustituye al requerimiento correspondiente a la parte de la operación garantizada y se determina considerando las características de la garantía real o de las características del otorgante de la garantía.

En lo sucesivo cuando se haga referencia a "las Garantías", en singular o plural, se podrá estar hablando de garantías reales financieras, garantías personales, avales o a la compra de protección contratada mediante derivados de crédito.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC13

La sección RC13 está conformada por los conceptos 130000 al 139999, con dos columnas, en las que debe reportarse en moneda nacional y conforme a los saldos contables las cifras totales de la Institución, incluyendo los importes de agencias y sucursales en el exterior, conforme a lo siguiente:

Columna 1: Importe de las Garantías que están cubriendo el riesgo de crédito de la contraparte, asumido por la Institución al realizar operaciones de reporto, préstamo y de derivados, informadas en la sección RC06 o RC15.

Columna 2: Importe de las Garantías que están cubriendo el riesgo de crédito (por el incumplimiento) del deudor o acreditado/acreditada, asumido por la Institución al realizar depósitos u otorgar créditos, informadas en la sección RC08 o RC15.

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC13

En esta sección se solicita la suma de las Garantías a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos, en su caso, deben realizarse operación por operación.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

IV. IMPORTE DE LAS GARANTÍAS

El importe a informar debe corresponder al de las Garantías que efectivamente estén cubriendo total o parcialmente una operación. En caso de que la Institución haya recibido Garantías que correspondan a operaciones en las que a la fecha del cómputo no haya una exposición (por riesgo de crédito) respecto del acreditado/acreditada o deudor original, el importe de tales Garantías no debe ser incluido en esta sección. Al efecto el valor de las Garantías será determinado conforme a los criterios establecidos por la Comisión.

V. GRADOS DE RIESGO

Los grados de riesgo a que se refieren los conceptos del formulario corresponden los que se señalan en el Anexo 1-B de las Reglas y deben determinarse considerando, en su caso, las calificaciones otorgadas por las Agencias Calificadoras.

VI. CALIFICACIONES

Al utilizar las calificaciones para determinar los grados de riesgo debe observarse lo señalado del artículo 2 Bis 23 al 2 Bis 29 de la CUB relativos a Calificaciones externas del crédito.

VII. REQUISITOS QUE DEBE CUMPLIR LA INSTITUCIÓN PARA RECONOCER LA COBERTURA DE RIESGO

Para que la Institución pueda reducir el requerimiento de capital por su exposición a riesgo de crédito mediante alguna de las técnicas de cobertura debe cumplir:

- Las Condiciones Generales establecidas en el artículo 2 Bis 30 de la CUB;
- Observar los requisitos mínimos establecidos en el artículo 2 Bis 32;
- Las garantías reales financieras reconocidas conforme al anexo 24 fracción II.
- Considerar los ajustes del anexo 1-F de la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VIII. REQUISITOS QUE DEBEN CUMPLIR LAS GARANTÍAS REALES

Adicionalmente a los requisitos que debe cumplir la Institución, para que las garantías reales recibidas puedan reducir el requerimiento de capital por riesgo de crédito, los instrumentos que actúen como garantías deben:

- Ser alguno de los señalados en el inciso I artículo 2 Bis 33 de la CUB y cumpla con los requerimientos mínimos señalados en el artículo 2 Bis 34 de la CUB, cuando se utilice el método simple.

- Ser alguno de los señalados en el inciso II del artículo 2 Bis 33 de la CUB y determinar el valor ajustado conforme al artículo 2 bis 37 y 2 bis 38, cuando se utilice el método integral

IX. REQUISITOS QUE DEBEN CUMPLIR LAS GARANTÍAS PERSONALES

Tratándose de garantías personales, para que éstas puedan reducir el requerimiento de capital por riesgo de crédito deben cumplir:

- Con lo establecido en el artículo 2 Bis 39 y en particular con los requisitos Mínimos señalados en el anexo 25 de la CUB.

- El garante debe ser alguno de los incluidos en el Anexo 25 de la CUB.

X. REQUISITOS QUE DEBEN CUMPLIR LAS COBERTURAS CONTRATADAS MEDIANTE DERIVADOS DE CRÉDITO

Para que la compra de protección contratada por la Institución mediante derivados de crédito pueda reducir el requerimiento de capital éstas deben cumplir:

- Con lo establecido en el artículo 2 Bis 39 y en particular con los requisitos Mínimos señalados en el anexo 25 de la CUB; y,

- El vendedor de protección debe ser alguno de los incluidos en el artículo 2 Bis 44 de la CUB.

XI. CLASIFICACIÓN DE LAS GARANTÍAS RECIBIDAS

En esta sección, relativa al requerimiento de crédito de las garantías recibidas que sustituirá al requerimiento de la operación cubierta, las garantías deben clasificarse considerando las características del instrumento que está actuando como garantía real, a las características del garante o del vendedor de protección, según corresponda, sin importar las características de la operación originalmente cubierta.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC13

Conceptos 130005 a 130070:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Simple) referentes al dinero en efectivo; medios de pago con vencimiento menor a 7 días; depósitos y créditos a cargo de Banco de México y valores gubernamentales (Gobierno Federal e IPAB), que estén garantizando operaciones que cumplan lo establecido en la fracción II, inciso a), numeral 1 del anexo 24 de la CUB.

Conceptos 130080 a 130105:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Instrumentos de deuda emitidos por Gobiernos Centrales de países extranjeros o por sus Bancos Centrales que cuenten con una calificación crediticia emitida por una Institución Calificadora reconocida, igual o mejor al grado de riesgo 3 del Anexo 1-B, conforme se señala en la fracción II, inciso a), numeral 5 del anexo 24 de la CUB

Conceptos 130120 a 130157:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Instrumentos de deuda emitidos por personas de las señaladas en el Grupo III o en el Grupo IV, referente a Pasivos de los señalados en la fracción I inciso a, b y d, II y III del Art. 46 de la LIC y Otros pasivos con una calificación crediticia emitida por una Institución Calificadora reconocida, igual o mejor al grado de riesgo 3 del Anexo 1-B, conforme a los puntos 6 y 7 de Anexo 24 de la CUB.

Asimismo, en el concepto 130157 se deben reportar los pasivos No calificados que cumplan con el total de requisitos señalados en el punto 8 del Anexo 24 de la CUB.

Conceptos 130160 a 130200:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Instrumentos de deuda emitidos por personas distintas al grupo III o IV, referente a Instrumentos de Deuda con una calificación crediticia emitida por una Institución Calificadora reconocida, igual o mejor al grado de riesgo 3 del Anexo 1-B, conforme a los puntos 6 y 7 de Anexo 24 de la CUB.

Asimismo, en el concepto 130200 se deben enviar las inversiones en fondos de inversión cuyos activos se limiten a los instrumentos señalados en 1 a 10 del inciso a), fracción II del anexo 24 de la CUB.

Conceptos 130210 a 130220:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referentes al dinero en efectivo; medios de pago con vencimiento menor a 7 días; depósitos y créditos a cargo de Banco de México y valores gubernamentales (Gobierno Federal e IPAB), que estén garantizando operaciones que cumplan lo establecido con la fracción II, inciso a), numeral 1 del Anexo 24 de la CUB.

Estos conceptos son informativos.

Concepto 130225:
En este concepto deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente al importe de los Instrumentos de deuda emitidos por Gobiernos Centrales de países extranjeros o por sus Bancos Centrales cuya calificación sea igual o mejor al grado de riesgo 4 del anexo 1-B.

Este concepto es informativo.

Conceptos 130230 a 130250:

En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente a los instrumentos de deuda emitidos por las casas de bolsa y otras entidades que cuenten con calificación, igual o mejor al grado de riesgo 4 del anexo 1-B; a los instrumentos de corto plazo cuya calificación sea igual o mejor al grado de riesgo 3 del anexo 1-B; a los instrumentos de deuda emitidos por personas distintas a las anteriores que cumplan con el inciso a, fracción II numeral 7 y 8 del Anexo 24 de la CUB , así como los pasivos de los señalados en la fracción I inciso a, b y d, II y III del Art. 46 de la LIC) que no puedan ser retirados con anterioridad a la fecha de vencimiento del activo garantizado.

Estos conceptos son informativos.

Concepto 130255:
En este concepto deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente a los títulos accionarios que formen parte del IPC de la BMV o índices principales de otras Bolsas y obligaciones subordinadas convertibles en tales títulos.

Este concepto es informativo.

Concepto 130260:
En este concepto deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente al importe de las inversiones en fondos de inversión cuyos activos se limiten a los instrumentos señalados en los numerales 1 a 10 del inciso a), fracción II del Anexo 24 de la CUB.

Este concepto es informativo.

Concepto 130265:
En este concepto deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente a los títulos accionarios y obligaciones subordinadas convertibles en acciones listadas y cotizadas en bolsas reconocidas o BMV, no listados en índices de dichas bolsas.

Este concepto es informativo.

Concepto 130270:
En este concepto deben reportar el importe de las Garantías Reales (Método Integral) referente a las inversiones en fondos de inversión cuyos activos incluyan los instrumentos señalados en el numeral 12 , inciso a), fracción II del Anexo 24 de la CUB.

Este concepto es informativo.

Conceptos 131005 a 131025:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Personales (Avales) correspondiente al Importe garantizado (avalado), clasificado respecto de las características de los garantes: Banco de México; Dependencias que conforman la Administración Pública Federal centralizada a la que se refiere el artículo 1 de la Ley Orgánica de la Administración Pública Federal; Instituto para la Protección al Ahorro Bancario; Organismos Internacionales (Banco Internacional de Pagos, Fondo Monetario, Banco Central Europeo, y Unión Europea) y Contragarantías constituidas con pasivos a cargo de la propia Institución que no puedan ser retiradas con anterioridad a la fecha de vencimiento del activo garantizado (grupo I-A), conforme se señala en el Artículo 2 Bis 12 de la CUB.

Conceptos 132005 a 132030:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Personales (Avales) correspondiente al Importe garantizado (avalado), clasificado respecto de las características de los garantes de Gobiernos y Bancos Centrales de países Extranjeros y Bancos Multilaterales de Desarrollo (grupo II), conforme se señala en el Artículo 2 Bis 13 de la CUB.

Conceptos 133005 a 133028:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Personales (Avales) correspondiente al Importe garantizado (avalado), clasificado respecto de las características de los garantes de Instituciones de Banca Múltiple; Entidades financieras filiales de la Institución o integrantes del mismo grupo al que pertenezca la Institución y Contragarantías constituidas con pasivos a cargo de otras instituciones que no puedan ser retiradas antes de la fecha de vencimiento del crédito (grupo III), conforme se señala en el Artículo 2 Bis 14 de la CUB.

Conceptos 133030 a 134020:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Personales (Avales) correspondiente al Importe garantizado (avalado), clasificado respecto de las características de los garantes de Instituciones de Banca de Desarrollo que conforme a sus respectivas leyes orgánicas, el Gobierno Federal responda en todo tiempo por dichas operaciones; Fideicomisos Públicos constituidos por el Gobierno Federal para el fomento económico; Organismos Descentralizados del Gobierno Federal y garantías otorgadas por Programas derivados de una Ley Federal que se establezcan en el Presupuesto de Egresos de la Federación (incluyendo los Programas de Apoyo Directos al Campo) (grupo IV), conforme se señala en el Artículo 2 Bis 15 de la CUB.

Conceptos 137005 a 131040:
En estos conceptos deben reportar el importe de las Garantías Personales (Avales) correspondiente al Importe garantizado (avalado), clasificado respecto de las características de los garantes de Personas Morales con actividad empresarial; concesionarios que cuentan con contratos de prestación de servicios celebrados con dependencias, estados, municipios y sus organismos descentralizados o desconcentrados, así como otras entidades del sector público; créditos que cuenten con garantías irrevocables e incondicionales otorgadas por la banca de desarrollo, por

fideicomisos públicos constituidos por el gobierno federal para el fomento económico, o por el Fondo Nacional de Infraestructura y créditos para proyectos de infraestructura que cuenten con garantías irrevocables e incondicionales a cargo de bancos multilaterales de desarrollo (grupos VII-A y VII-Bis), conforme se señala en los Artículos 2 Bis 18 y 19 de la CUB.

Conceptos 131105 a 131120:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Derivados Y Seguros de Crédito correspondientes al Monto cubierto mediante derivados de crédito, clasificado respecto de las características del Vendedor de protección de Banco de México; Dependencias que conforman la Administración Pública Federal centralizada a la que se refiere el artículo 1 de la Ley Orgánica de la Administración Pública Federal; Instituto para la Protección al Ahorro Bancario y Organismos Internacionales (Banco Internacional de Pagos, Fondo Monetario, Banco Central Europeo, y Unión Europea) (Grupo I-A) conforme al Artículo 2 Bis 12 de la CUB.

Conceptos 132105 a 132130:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Derivados y Seguros de Crédito correspondientes al Monto cubierto mediante derivados de crédito, clasificado respecto de las características del Vendedor de protección de Gobiernos y Bancos Centrales de países Extranjeros y Bancos Multilaterales de Desarrollo (Grupo II), conforme al Artículo 2 Bis 13 de la CUB.

Conceptos 133105 a 133125:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Derivados Y Seguros de Crédito correspondientes al Monto cubierto mediante derivados de crédito, clasificado respecto de las características del Vendedor de protección de Instituciones de Banca Múltiple y Entidades financieras filiales de la Institución o integrantes del mismo grupo al que pertenezca la Institución (Grupo III), conforme al Artículo 2 Bis 14 de la CUB.

Conceptos 133135 a 134115:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Derivados Y Seguros de Crédito correspondientes al Monto cubierto mediante derivados de crédito, clasificado respecto de las características del Vendedor de protección de Instituciones de Banca de Desarrollo que conforme a sus respectivas leyes orgánicas, el Gobierno Federal responda en todo tiempo por dichas operaciones; Fideicomisos Públicos constituidos por el Gobierno Federal para el fomento económico y Organismos Descentralizados del Gobierno Federal (Grupo IV), conforme al Artículo 2 Bis 15 de la CUB.

Conceptos 137105 a 137110:
En estos conceptos deben reportar el importe de los Derivados y Seguros de Crédito correspondientes al Monto cubierto mediante derivados de crédito, clasificado respecto de las características del Vendedor de protección de Personas Morales con actividad empresarial (Grupo VII-A), conforme al Artículo 2 Bis 18 de la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 14

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC14 RELATIVA AL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR OPERACIONES SUJETAS A RIESGO DE CRÉDITO, DETERMINADO MEDIANTE MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC14

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información para determinar el requerimiento de capital por riesgo de crédito que las instituciones obtienen a través de métodos basados en calificaciones internas en su enfoque básico o avanzado.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC14

En esta sección deberán incluirse todas las operaciones sujetas a riesgo de crédito sobre las que la Institución aplique métodos basados en calificaciones internas para determinar sus requerimientos por riesgo de crédito siempre que cuenten con autorización de la CNBV. Las posiciones valuadas mediante dichos modelos deben ser ajustadas considerando como mínimo los costos de cancelación y cierre de posiciones, los riesgos operacionales, los costos de financiamiento de las operaciones, los gastos administrativos futuros, diferenciales crediticios no reconocidos, el riesgo del modelo, incluyendo aquel asociado con el uso de una metodología incorrecta de valuación y con la calibración de parámetros no observables, así como, en su caso, la iliquidez de las posiciones.

Tratándose de aquellas posiciones líquidas, las Instituciones deben establecer y mantener procedimientos para identificarlas así como revisar continuamente que el ajuste correspondiente sigue siendo vigente, para lo cual deben considerar factores tales como el tiempo que se necesitaría para cubrir la posición, la volatilidad de los diferenciales entre los precios de compra y venta, la disponibilidad de cotizaciones de mercado, el promedio y volatilidad de los montos que se comercializan tanto en condiciones normales como en condiciones de estrés, concentraciones de mercado y el tiempo transcurrido desde la concertación de las operaciones

Considerando que para determinar el requerimiento de capital por riesgo de crédito es necesario comparar el requerimiento obtenido mediante el uso del método interno autorizado con el obtenido mediante el método estándar, las operaciones sujetas a riesgo de crédito informadas en esta sección también deben incluirse en las secciones RC06, RC07, RC08 y RC15, según corresponda. Asimismo, en esta sección deben incluirse las operaciones sujetas a riesgo de crédito o segmentos excluidos de alguno de los modelos internos autorizados que pertenezcan al mismo tipo de cartera, utilizando la clave de exclusión señalada en la ayuda específica del campo 7.

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN RC14

La sección RC14 está conformada por los campos 1 a 41 como se muestra en la estructura.

Dependiendo del tipo de enfoque utilizado en el modelo o grupo de riesgo en el que se clasifiquen las operaciones, algunos campos no aplicarán, debiendo informarse en ceros o con valor "NA", según corresponda al campo.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección la deben reportar con cifras al día último del mes de que se trate conforme a lo siguiente: los campos relativos a **Plazos** deben expresarse en años; los relativos a **Montos**, deben reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales; y los relativos a **Porcentajes**, deben informase en por ciento con dos decimales.

IV. REGISTROS A INFORMAR EN LA SECCIÓN RC14

Cada uno de los registros informados en esta sección debe referirse al segmento (conjunto de operaciones) o a una operación sujeta a riesgo de crédito, en correspondencia con una "Clave de la calificación o de la segmentación interna proporcionada por la propia Institución" (campo 7).

Para definir el segmento de operaciones sujetas a riesgo de crédito se considerarán las características particulares de las operaciones de que se trate (créditos al consumo, créditos hipotecarios, créditos comerciales, operaciones de reportos, derivadas, etcétera) y algunas de las variables (por ejemplo: antigüedad del crédito, porcentaje de uso de la línea, sector económico, etcétera) utilizadas en la metodología autorizada. Una vez definida la segmentación (que algunos casos pueden ser de una sola operación sujeta a riesgo de crédito), se asignará una clave a cada segmento y mes con mes los créditos se informarán con la misma segmentación en el campo 7 (IdSegmento).

V. ACLARACIONES DIVERSAS RELATIVAS A LA SECCIÓN RC14

Reconocimiento de las Garantías para los Grupos de Crédito establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12 a 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

El reconocimiento de las garantías reales admisibles en las operaciones sujetas a riesgo de crédito de los grupos mencionados se podrá realizar en metodologías internas bajo dos enfoques:

a) Bajo el Enfoque Básico

En la metodología interna bajo el enfoque Básico, para posiciones preferentes se reconocerá el método integral para garantías reales admisibles y elegibles; así como la mitigación de riesgo por avales y derivados crediticios, siempre y cuando:

1. El instrumento que actúe como garantía real admisible sea alguno de los señalados en el inciso II del Anexo 24 y en el artículo 2 Bis 33
2. La Institución cumpla con las Condiciones Generales establecidas en el artículo 2 Bis 30 de la CUB;
3. La Institución observe los requisitos mínimos establecidos en el artículo 2 Bis 32 de la CUB;
4. La Institución ajuste las posiciones conforme lo establecido en los artículos 2 Bis 36 ,2 Bis 74, 2 Bis 75, 2 Bis 76 y 2 Bis 77 de la CUB;
5. En su caso, los derivados de crédito cumplan con lo establecido en artículo 2 Bis 39 y en particular con los requisitos mínimos señalados en el en el Anexo 25; así como con el inciso I del artículo 2 Bis 78 de la CUB;
6. El garante de protección cumpla con lo establecido en el artículo 2 Bis 39 y en particular con los requisitos mínimos señalados en el Anexo 25; así como en el inciso I del artículo 2 BIS 78 de la CUB y;
7. El vendedor de protección o el garante de protección sea alguno de los incluidos en el artículo 2 Bis 44 de la CUB.

b) Bajo el Enfoque Avanzado

La Institución procederá conforme al inciso II del artículo. 2 BIS 78 de la CUB.

Reconocimiento de las Garantías para el Grupo de Crédito establecido en el artículo 2 Bis 17.

Para las operaciones sujetas a riesgo de crédito calificadas en el grupo referido en el Art. 2 bis 17, solo podrán reconocerse para la reducción del riesgo de crédito las garantías reales admisibles conforme al Art. 2 bis 89 de la CUB.

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC14

Campo 1: Clave de la Institución

En este campo deben reportar la clave de la Institución a quién corresponde la información.

Campo 2: Fecha

En este campo deben reportar la fecha a la que corresponde la información.

Campo 3: Tipo de Operación

En este campo deben reportar la clave del tipo de operaciones sujetas a riesgo de crédito al que corresponde el segmento u operación sujeta a riesgo de crédito, conforme a las claves del catálogo "Tipo de operación.

Clave	Catálogo de tipo de operación

140001	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido el art. 2 bis 12 de la CUB (Grupo I-A)
140002	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 13 de la CUB (Grupo II)
140003	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 14 de la CUB (Grupo III)
140004	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 15 de la CUB (Grupo IV)
140005	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 16 de la CUB (Grupo V)
140006	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 17 de la CUB (Grupo VI)
140007	Operaciones sujetas a riesgo de crédito a personas clasificados en el grupo referido en el art. 2 bis 18 (Grupo VII-A)

Campo 4: Subclase de Operación

En este campo deben reportar la clave de subclasificación de cartera al que pertenece el segmento u operación sujeta a riesgo de crédito, conforme a las claves del catálogo "Subclase de operación.

Clave	Catálogo de subclase de operación
140061	Nómina
140062	Arrendamiento financiero con personas físicas
140063	Automotriz
140064	Adquisición de bienes de consumo duradero
140065	Tarjetas de Crédito
140066	Créditos a personas físicas con actividad empresarial y morales que no excedan el límite establecido en la fracción I del artículo 2 bis 17, cuyo requerimiento se calcula con la metodología del artículo 2 bis 71.
140067	Créditos hipotecarios de vivienda conforme al art. 2 bis 17
140068	Créditos Personales
140069	Otros créditos de consumo
140070	Créditos a personas físicas con actividad empresarial y morales que no excedan el límite establecido en la fracción I del artículo 2 bis 17, cuyo requerimiento se calcula con la metodología del artículo 2 bis 83 (tratamiento tarjetas de crédito
140071	Arrendamiento capitalizable realizado con personas morales o físicas con actividad empresarial y destinada a su giro comercial o financiero.
140072	Créditos a personas físicas con actividad empresarial y morales que no excedan el límite establecido en la fracción I del artículo 2 bis 17, cuyo requerimiento se calcula con la metodología del artículo 2 bis 83 (tratamiento otros créditos consumo)
10101	Depósitos Bancarios
10102	Call Money
10201	Cartera Comercial Vigente o en etapa 1 y 2
10312	Posición de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional, con tasa de rendimiento nominal (en república, agencias y sucursales)
10313	Posición de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional o UDIS con tasa de rendimiento real (en república , agencias y sucursales)
10314	Posición de riesgo en títulos de deuda en moneda extranjera, con tasa de rendimiento nominal (en república, agencias y sucursales)
10315	Operaciones de compra-ventas fecha valor de valores

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

10316	Operaciones de reporto actuando como reportado
10317	Operaciones de reporto actuando como reportador
10318	Operaciones de préstamo actuando como prestamista
10319	Operaciones de préstamo actuando como prestatario
10402	Instrumentos Financieros Derivados (Forwards sobre divisas)
10403	Instrumentos Financieros Derivados (Forwards sobre tasas de interés)
10404	Instrumentos Financieros Derivados (Forwards otros subyacentes)
10405	Instrumentos Financieros Derivados (Swaps)
10406	Instrumentos Financieros Derivados (Opciones)
10419	Derivados de crédito de rendimiento total como comprador de protección.
10420	Derivados de crédito de rendimiento total como vendedor de protección.
10421	Garantías personales o avales otorgados por operaciones distintas a bursatilización
10422	Garantías personales otorgadas por BD que cuenten con un esquema de primeras pérdidas
10501	Otras operaciones

Campo 5: Categoría de la operación

En este campo debe informarse la clave de la categoría de exposición del segmento u operación sujeta al riesgo de crédito. Se anotará **EB** si la exposición está registrada en el balance general de la Institución y es administrada por esta, **EA** si la exposición está registrada en el balance general y es administrada por un tercero, **FB** si la exposición está fuera del balance general de la Institución.

Campo 6: Prelación de Pago

En este campo debe informarse el grado de prelación de pago del segmento u operación sujeta al riesgo de crédito, anotando la clave **P** cuando el conjunto de operaciones tenga una prelación de pago preferente y, utilizando la clave **S** si el conjunto de operaciones tiene una prelación subordinada. Este campo aplica cuando se trate de operaciones sujetas a riesgo de crédito para los que se utilice un método basado en calificaciones internas básico.

Tratándose de operaciones que serán excluidas del método basado en modelos internos, en este campo debe anotarse la clave "NA".

Campo 7: Clave de la Calificación o de la Segmentación Interna

En este campo deben reportar la clave asignada al segmento u operación sujeta a riesgo de crédito, conforme a lo señalado en la ayuda específica IV.

Cuando una Institución dentro de los segmentos que conformó para el mismo tipo tenga casos que no serán gestionadas dentro de los modelos internos y que serán gestionadas con la metodología estándar, en este campo tales créditos deben informarse utilizando la clave de exclusión (140999).

Campo 8: Descripción de la Calificación o de la Segmentación Interna

En este campo deben reportar una descripción de las características del segmento u operación sujeta a riesgo de crédito.

Tratándose del segmento de operaciones del mismo tipo de operación que serán excluidas del método basado en modelos internos (campo 7= 140999), en este campo

debe anotarse la leyenda "Parcialidad del segmento u operaciones excluidos que serán tratados bajo metodología estándar".

Campo 9: Importe de la Operación Sujeta a Riesgo de Crédito

Cuando se trate de cartera de créditos, en este campo deben reportar la suma del importe bruto (sin restar las correspondientes reservas preventivas, ni las correcciones de valor por deterioro de los activos) de los créditos incluidos en el segmento (o en su caso el importe del crédito individual) que estén vigentes a la fecha del cómputo, incluyendo en su caso el principal vigente y los intereses ordinarios devengados no cobrados.

Tratándose de operaciones sujetas a riesgo de crédito de contraparte o de entidad emisora, deben registrar la suma de los importes de posiciones activas (sin considerar mitigadores de riesgo de crédito) que estén vigentes a la fecha del cómputo.

Este importe determinará la exposición al incumplimiento.

Campo 10: Importe de la Operación de cartera vencida o en etapa 3

Tratándose de cartera de crédito, en este campo deben reportar la suma del importe bruto (sin restar reservas) de los créditos incluidos en el segmento (o en su caso el importe del crédito individual) que estén en cartera vencida o en etapa 3 a la fecha del cómputo.

Tratándose de operaciones sujetas a riesgo de crédito de contraparte o entidad emisora, deben registrar la suma de los pagos o entregas incumplidas.

Este importe determinará la exposición al incumplimiento.

Campo 11: Importe de la Línea de Crédito No dispuesta

En este campo deben reportar la suma del importe total no dispuesto de la línea de crédito de las operaciones incluidas en el segmento, y de sus exclusiones sin importar el tipo (por ejemplo: comprometidas, no comprometidas, con y sin cancelación automática).

Campo 12: Metodología de Cálculo

En este campo deben reportar la clave correspondiente a la metodología de cálculo utilizada para el segmento u operación sujeta a riesgo de crédito, anotando la clave **B** cuando se trate de una metodología interna básica, y **A** cuando se trate de una metodología interna avanzada.

Tratándose de operaciones que serán excluidas del método basado en modelos internos, en este campo debe anotarse la clave "NA".

Campo 13: Exposición al Incumplimiento

En este campo deben reportar la suma del importe de la exposición de riesgo estimada por la Institución, para las operaciones incluidas en el segmento (o en su caso el importe de la exposición de la operación individual).

Campo 14: Probabilidad de Incumplimiento del Deudor o Probabilidad de Incumplimiento Promedio del Segmento

En este campo deben reportar el porcentaje de la probabilidad de incumplimiento del deudor o la probabilidad de incumplimiento promedio del segmento estimada por la Institución.

Campo 15: Severidad de la Pérdida en Incumplimiento del Acreditado/Acreditada o Severidad Promedio de la Pérdida en Incumplimiento del Segmento

En este campo deben reportar el porcentaje de severidad de la pérdida de la operación o del segmento: a) en el caso de metodologías internas avanzadas el estimado por la Institución b) en el caso de metodologías internas básicas, utilizando los parámetros regulatorios de operaciones preferentes o subordinadas.

Campo 16: Coeficiente de Correlación entre Acreditados/Acreditadas de la misma Segmentación

En este campo deben reportar el coeficiente de correlación de la operación o del segmento, estimado por la institución.

Campo 17: Plazo Efectivo del Crédito o Plazo Efectivo Ponderado de las operaciones de la misma Segmentación

En este campo deben reportar el plazo efectivo de la operación o el plazo efectivo promedio ponderado de las operaciones incluidas en el segmento. Para a) el caso de metodologías internas avanzadas el estimado por la Institución, b) en el caso de metodologías internas básicas utilizando los parámetros establecidos en la CUB.

Campo 18: Números de Casos por Segmento

En este campo deben reportar el número de operaciones incluidas en cada segmento a la fecha del cómputo. Tratándose de operaciones individuales debe informarse el número uno (1).

Tratándose de operaciones que serán excluidas del método basado en modelos internos, en este campo debe anotarse el número de operaciones excluidas.

Campo 19: Importe de la Exposición Cubierta mediante Garantías Reales Admisibles que cumplan con lo establecido en el inciso a) de la fracción II y el artículo 2 Bis 33 de la CUB

En este campo deben reportar la suma del importe de las garantías reales admisibles utilizadas como cobertura de la exposición al incumplimiento de las operaciones incluidas en el segmento. Estas garantías deben ser de las establecidas en la metodología interna básica aplicable a las posiciones preferentes de los grupos de riesgo establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12, 2 Bis 13 a 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

Campo 20: Importe de la Exposición Cubierta mediante Garantías Reales Elegibles en los términos del sub inciso c) del inciso (ix) del numeral 4 del Anexo 15.

En este campo deben reportar la suma del importe de las garantías reales elegibles utilizadas como cobertura de la exposición al incumplimiento de las operaciones incluidas en el segmento. Estas garantías deben conforme a lo establecido en el enfoque de metodología interna básica aplicable a las posiciones preferentes de los grupos de riesgo establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12, 2 Bis 13, 2 Bis 14, 2 Bis 15, 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

Campo 21: Suma del Importe de la Exposición Cubierta mediante Garantías Reales Admisibles y Elegibles

En este campo deben reportar la suma de los importes informados en los campos 19 y 20.

Campo 22: Exposición al Incumplimiento Ajustada por las Garantías Reales Recibidas

En este campo deben reportar la suma del importe de la exposición al incumplimiento ajustada por la aplicación de las garantías reales admisibles o reales elegibles de las operaciones incluidas en el segmento.

Campo 23: Severidad de la Pérdida en Incumplimiento Efectiva de la Operación o del Segmento

En este campo deben reportar el porcentaje de Severidad de la Perdida ajustada por la aplicación de las garantías reales admisibles o reales elegibles correspondiente a las operaciones o al segmento de las operaciones.

Campo 24: Importe de la Exposición cubierta mediante Garantías Personales

En este campo deben reportar la suma del importe de las garantías personales a que se refiere el artículo 2 bis 44 utilizadas como cobertura de la exposición al incumplimiento de las operaciones incluidas en el segmento. Estas garantías deben ser de las establecidas en la metodología interna básica y bajo la metodología de cobertura de riesgo de crédito aplicable a la calificación de cartera crediticia comercial aplicable a las posiciones de los grupos de riesgo establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12, 2 Bis 13 a 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

Campo 25: Importe de la Exposición cubierta mediante Derivados de Crédito

En este campo deben reportar la suma del importe de la cobertura recibida mediante derivados de crédito a que se refiere el artículo 2 bis 44, contratada para mitigar la exposición al incumplimiento de las operaciones incluidas en el segmento. Los derivados de crédito contratados deben ser de los establecidos en la metodología interna básica y bajo la metodología de cobertura de riesgo de crédito aplicable a la calificación de cartera crediticia comercial aplicable a las posiciones de los grupos de riesgo establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12, 2 Bis 13 a 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

Campo 26: Suma del Importe de la Exposición cubierta mediante Garantías Personales y Derivados de Crédito.

En este campo deben reportar la suma de los importes informados en los campos 24 y 25.

Campo 27: Probabilidad Promedio de Incumplimiento del Garante

En este campo deben reportar el porcentaje de la probabilidad promedio de incumplimiento del garante o proveedor de protección del derivado de crédito.

Campo 28: Severidad Promedio de la Pérdida en incumplimiento del Garante

En este campo deben reportar el porcentaje de la severidad promedio de la pérdida en incumplimiento del garante o proveedor de protección del derivado de crédito.

Campo 29: Exposición Ajustada por las Garantías y Derivados Crédito Recibidos

En este campo deben reportar el porcentaje de exposición al incumplimiento ajustado por la aplicación de garantías personales admisibles o derivados de crédito elegibles calculado conforme a la metodología interna básica para posiciones preferentes, de los grupos de riesgo establecidos en la CUB en los artículos 2 Bis 12, 2 Bis 13, 2 Bis 14, 2 Bis 15, 2 Bis 16 y 2 Bis 18.

Campo 30: Importe de la Exposición cubierta mediante Garantías por el Método Avanzado

En este campo deben reportar la suma del importe de las garantías reales, garantías personales o derivados de crédito establecidos en la metodología interna avanzada, utilizadas como cobertura de la exposición al incumplimiento de las operaciones incluidas en el segmento.

Campo 31: Probabilidad de Incumplimiento del Deudor o Probabilidad de Incumplimiento Promedio del Segmento, Ajustada en Función del Reconocimiento de Garantías Bajo el Método Interno Avanzado

En este campo deben reportar la probabilidad de incumplimiento, ajustada por la aplicación de garantías reales, garantías personales o derivados de crédito establecidos en la metodología interna avanzada.

Campo 32: Severidad Promedio de la Pérdida en Incumplimiento, Ajustada en Función del Reconocimiento de Garantías bajo el Método Interno Avanzado

En este campo deben reportar la severidad de la pérdida, ajustada por la aplicación de garantías reales, garantías personales o derivados de crédito establecidos en la metodología interna avanzada.

Campo 33: Ponderador del Requerimiento por Riesgo de Crédito, en su Caso, Ajustado por el reconocimiento de Garantías Bajo el Método Avanzado

En este campo deben reportar el ponderador del requerimiento de capital de riesgo de crédito aplicable a la operación o segmento, conforme a lo establecido por la CUB y con base en los parámetros aplicables según la metodología interna autorizada. Cuando la Institución reconozca garantías de conformidad con la normatividad aplicable, se informará el ponderador de requerimiento de capital ajustado por la cobertura de las garantías.

Campo 34: Requerimiento de Capital por Riesgo de Crédito del Segmento o Crédito determinado mediante Modelos Internos

En este campo deben reportar el importe del requerimiento de capital por riesgo de crédito de la operación o segmento determinado mediante la aplicación del modelo interno autorizado.

Campo 35: Requerimiento de Capital por Riesgo de Crédito del Segmento o crédito determinado mediante el Método Estándar

En este campo deben reportar el importe del requerimiento de capital por riesgo de crédito de la operación o segmento, determinado mediante el método estándar. Este concepto se informará por un periodo de tres años contado a partir de la fecha de la autorización para utilizar el correspondiente modelo interno al determinar el requerimiento de capital.

Una vez concluido el periodo, este campo se debe reportar en cero.

Tratándose de operaciones que serán excluidas del método basado en modelos internos, en este campo deberá anotarse el requerimiento de capital por riesgo de crédito del segmento de las operaciones excluidas.

Campo 36: Porcentaje de aplicación del Método Estándar

En este campo deben reportar el porcentaje de aplicación del requerimiento de riesgo de crédito del segmento u operación determinado bajo el método estándar. Este porcentaje será de 95 por ciento para el primer año, de 90 por ciento para el segundo y del 80 por ciento para el tercer año, contados a partir de la fecha de la autorización.

Una vez concluido el periodo, este campo se debe reportar en cero.

Campo 37: Perdidas Esperadas Totales

En este campo deben reportar la suma del importe de la pérdida esperada de las operaciones incluidas en el segmento (o en su caso el importe de la pérdida esperada de la operación individual) estimada por la Institución.

Campo 38: Reservas Admisibles Totales

En este campo deben reportarse la totalidad de las reservas crediticias de las operaciones incluidas en el segmento (o en su caso el importe de las reservas de la operación individual),constituidas conforme al Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones relativo a la metodología de calificación de cartera crediticia, ya sea que utilicen o no un modelo de calificación de carteras crediticias basado en pérdida esperada y que no computen como Capital Complementario al mes que se esté realizando el cómputo de capitalización.

Cuando una Institución cuente con la autorización para determinar sus requerimientos de riesgo de crédito, parcialmente a un tipo de posición por metodologías internas y la otra parte la determine bajo método estándar, las reservas se deben de repartir entre los dos métodos según corresponda.

Campo 39: Reservas con Tratamiento Establecido en el artículo 2 Bis 6 inciso K de la CUB.

En este campo deben reportar el importe de la diferencia positiva entre las pérdidas esperadas y las reservas admisibles totales de las operaciones incluidas en el segmento

u operación. Este importe se deducirá del capital contable para determinar el capital básico de la Institución.

Campo 40: Reservas con Tratamiento Establecido en el artículo 2 Bis 7 fracción III de la CUB.

En este campo deben reportar el importe de la diferencia positiva entre las reservas admisibles totales y las perdidas esperadas de las operaciones incluidas en el segmento u operación. Esta diferencia positiva se sumará al capital complementario, hasta por un monto que no exceda de 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento por riesgo de crédito.

Campo 41: Exceso de Reservas para Situaciones de Incumplimiento Respecto de la Pérdida Esperada

En este campo deben reportar el importe de la diferencia positiva entre las reservas admisibles y las perdidas esperadas de las operaciones incluidas en el segmento o de la operación en situación de incumplimiento.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Secciones 15A y 15B

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC15A Y RC15B RELATIVOS AL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA, ENTIDAD EMISORA, CONTRAPARTE Y AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA EN OPERACIONES DERIVADAS POR OPERACIONES REALIZADAS CON PERSONAS RELACIONADAS.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC15

Esta sección tiene como objetivo obtener la información de las operaciones realizadas por la Institución con: i) personas relacionadas, a que se refieren los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley de Instituciones de Crédito (L.I.C.), y ii) "personas relacionadas relevantes", a que se refiere el numeral CVII del Artículo 1 de la Circular Única de Bancos (CUB). Esto para determinar el monto sujeto a requerimiento por riesgo de crédito (entidad emisora, contraparte, acreditado/acreditada y ajuste al valor crediticio de las operaciones derivadas) y/o el importe a deducir del Capital Fundamental.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC15

En esta sección deben incluirse todas las operaciones activas y las pasivas sólo cuando se trate de operaciones de reporto o derivados, realizadas exclusivamente por la institución con todas las personas relacionadas y en las cuales mantenga una exposición a riesgo de crédito por contraparte, entidad emisora o acreditado/acreditada, tales como: operaciones de compra-venta fecha valor de títulos y/o divisas, reportos, préstamos, forwards, opciones adquiridas tanto de compra como de venta, swaps y derivados crediticios (como vendedor de protección, en el caso de que la institución sea compradora se considerarán como mitigador de riesgo); depósitos, créditos, líneas de crédito y demás activos cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la institución; posiciones en títulos de deuda y títulos en garantía con transferencia de propiedad, cedidos y recibidos, vigentes al día último del mes de que se trate e incumplimientos bajo mecanismos de libre entrega.

Deben incluirse también las operaciones realizadas por el "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", en caso que este fondo sea de "beneficios definidos", identificándolas en el campo "Clase de Operación" con la clave correspondiente.

Las "Clases de Operación" registradas con las claves 10104 y 10464 no están sujetas a un requerimiento por riesgo de crédito, por lo que en el campo "Grupo de Riesgo" deben informar el valor igual a cero.

Las operaciones registradas en esta sección no deben incluirse en las otras secciones relativas a riesgo de crédito

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN RC15

La sección RC15 está conformada por dos apartados como se muestra en las estructuras.

En el caso que no aplique registro en alguna de las columnas de los distintos apartados, deben reportarse con el valor que por defecto se defina.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate conforme a lo siguiente: los campos relativos a plazos deben expresarse en años; los relativos a montos, deben reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV) y los relativos a **Porcentajes**, deben informarse en porcentaje con dos decimales.

IV. REGISTROS A INFORMAR EN LA SECCIÓN RC15

Las operaciones que reporte la Institución relativas a sus agencias y sucursales en el exterior, deben clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubieren sido celebradas por una oficina en México.

También deben incluirse las posiciones en títulos de deuda por su inversión en el capital variable de "fondos de inversión"; cuyos portafolios contengan operaciones con personas relacionadas. En este caso el monto a reportar debe determinarse en función de la proporción de tenencia de acciones, del fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma, identificándolas en el campo "Clase de Operación" con la clave correspondiente.

RC15 A

Deben informar **la suma de las operaciones** agrupándolas con base en los siguientes criterios:

1. La contraparte, la moneda de denominación, la clase y la fecha de concertación de cada operación
2. El grupo y el grado de riesgo al que pertenezca el acreditado/acreditada, contraparte o entidad emisora de que se trate
3. Plazo y escala de la calificación cuando aplique conforme al anexo 1-B
4. Ponderador aplicable

La unicidad del registro está definido por los siguientes "campos llave": Institución, Fecha de Corte, Contraparte, Clase, Plazo remanente, Tipo de mercado, Identificador

Interno de la Operación, Identificador Interno del contrato de compensación de operaciones con la misma contraparte, Grado de Riesgo, es decir, en el registro deben agrupar las operaciones que cuenten con las mismas características.

V. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC15 A

En el cálculo del Capital Fundamental las operaciones con "personas relacionadas relevantes" se identificarán a través de la asociación de la clave reportada en el campo 3 (Clave de la persona relacionada) de esta sección y el Catálogo General de Contrapartes, campo 6 (Tipo de relación).

DEFINICIÓN

Se entenderá por:

Persona relacionada relevante: aquellas personas físicas o morales con domicilio en territorio nacional o en el extranjero, que tengan directa o indirectamente, el veinte por ciento o más del capital social de una institución de banca múltiple de manera individual o colectiva. En todo caso, se entenderá como tenencia accionaria colectiva, aquella que mantengan directa o indirectamente, en su conjunto:

a) Los cónyuges o las personas físicas que tengan parentesco por consanguinidad o afinidad hasta el segundo grado o civil, y

b) Los fideicomisos cuando la contraparte o fuente de pago dependa de una de las personas físicas o morales señaladas en el primer párrafo de esta fracción y el inciso anterior.

A efecto de considerar que los supuestos señalados en los incisos a) y b) anteriores, no son Personas Relacionadas Relevantes, las instituciones de banca múltiple deben documentar fehacientemente que en dichos supuestos no se actúa de forma concertada ni se mantienen acuerdos, de cualquier naturaleza, para tomar decisiones en un mismo sentido.

Adicionalmente, se considerarán como Personas Relacionadas Relevantes a todas aquellas personas morales que formen parte de un mismo grupo empresarial o consorcio controlado por las personas físicas o morales señaladas en el primer párrafo de esta definición. No quedarán incluidas en dicho concepto, las entidades financieras que formen parte del grupo financiero al que, en su caso, pertenezca la institución de banca múltiple, o aquellas entidades financieras en las que la institución de banca múltiple tenga una participación accionaria, a menos de que dichas entidades a su vez otorguen cualquier tipo de financiamiento a las personas señaladas en el primer párrafo de la presente definición.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Para efectos de lo establecido en esta definición, se deberá entender por "control", "consorcio" y "grupo empresarial", lo establecido en las fracciones I, II y V del Artículo 22 Bis de la Ley.

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC15 A

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información
En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información
En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave de la persona relacionada
En este campo debe informar la clave de la contraparte de la operación asignada por Banco de México en el Catálogo General de Contrapartes (CGC), sección IV.

Campo 4: Clase de la operación relacionada
En este campo debe reportarse la clasificación que corresponda a las operaciones de que se trate, de acuerdo al catálogo de clases de operaciones que se ubica en el anexo.

Tratándose de cartera al consumo o mipymes con personas relacionadas, nueva o reestructuras, que no satisfacen las condiciones de la reforma al artículo 2 bis 17 y a los cuales se les debe continuar aplicando los ponderadores anteriores, utilizarán las clases de operación 10201, 10204, 10205, 10212,10213,10214, bajo tratamiento 6 o 7 según corresponda.

Esta sección no admite las clases de operación 105000, 105001, 105008 o 105009.

Para mayor ayuda en el llenado de la sección, se agrega la correspondencia de la clase de operación con el tipo de tratamiento (campo 28).

Campo 5: Moneda
En este campo debe reportarse la clave de la moneda que corresponda a las operaciones de que se trate, conforme al catálogo de monedas.

En el caso de operaciones con riesgo de contraparte (por ejemplo: reportos, forwards, opciones) el criterio a seguir será registrar la moneda de la parte activa de la operación si es resulta un importe positivo o la moneda de la parte pasiva si resulta sin importe positivo.

Campo 6: Monto de la parte activa de las operaciones
Se debe anotar el monto total en miles de pesos de la parte activa de las operaciones agrupadas conforme se mencionó en el numeral IV de estas ayudas.

Tratándose de opciones o títulos opcionales deberán registrar el precio de valuación de la operación cuando esta resulte positiva.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Campo 7: Monto de la parte pasiva de las operaciones

Se debe anotar el monto total en miles de pesos de la parte pasiva de las operaciones agrupadas conforme se mencionó en el numeral IV de estas ayudas

Tratándose de opciones o títulos opcionales deberán registrar el precio de valuación de la operación cuando esta resulte negativa

Campo 8: Tipo de operación en balance

En este campo debe reportarse la clave correspondiente al tipo de operación de que se trate, respecto al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	Activa
2	Pasiva
3	Fuera de balance activa
4	Fuera de balance pasiva

En el caso de operaciones con riesgo de contraparte (por ejemplo: reportos, forwards, opciones, etc.) el criterio a seguir será registrarla con clave 1, si la operación resulta con importe positivo, o clave 2 si la operación resulta sin importe positivo.

Campo 9: Concertación de la operación

En este campo debe señalarse si la operación en cuestión se concertó antes o después del 4 de marzo de 2011. Se debe reportar la clave correspondiente respecto al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	Hasta el 4 de marzo 2011
2	Posterior al 4 de marzo 2011

Campo 10: Monto del importe positivo de operaciones a favor de la institución.

- Tratándose de posiciones en **títulos de deuda** debe reportarse la suma de las posiciones netas largas obtenidas conforme a lo siguiente:
  a) Realizando los cálculos operación por operación.

  b) Se determina la posición bruta larga en títulos de deuda.

  c) Se determina la posición bruta corta en títulos de deuda.

  d) Se obtiene la posición larga y corta en el mismo título, esto se refiere al valor mínimo, de operaciones con títulos idénticos, que se tengan tanto en posición larga, como en posición corta, sin importar de qué operación proviene una y otra posición. Se consideran títulos idénticos cuando la posición larga y la posición corta tengan la misma "clave de emisión"; es decir, que los títulos en cuestión

sean idénticos en cuanto a tipo de instrumento, entidad emisora, fecha de vencimiento, tipo de cupón y fecha de revisión del cupón.

e) Se determina la posición neta larga como la diferencia positiva entre la posición bruta larga menos la posición larga y corta en el mismo título.

f) Clasificando las operaciones conforme al grupo de riesgo crédito al que pertenezca la entidad emisora del título de que se trate, considerando al efecto su grado de riesgo.

g) Realizando para cada registro de esta sección la sumatoria de las respectivas operaciones según los cálculos individuales, antes mencionados

- Tratándose de operaciones en las que empleen el método simple para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras, deben reportar la diferencia entre el valor activo y pasivo del registro cuando éste resulte con signo positivo.

  En el caso de los depósitos, préstamos, créditos, otros activos y operaciones contingentes se deben reportar el importe insoluto incluyendo, en su caso: el principal vigente, los intereses ordinarios devengados no cobrados y el refinanciamiento y capitalización de intereses.
  Las cifras de otras partidas distintas a la cartera de créditos, según sea el caso, deben reportarse netas de los correspondientes castigos, depreciaciones y amortizaciones.

- Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras y se trate de operaciones de reportos y préstamos de valores sujetas a un contrato marco que contenga una cláusula que permita extinguir por compensación todas las operaciones, deben registrar la exposición ajustada obtenida como la suma de las exposiciones positivas de todas las operaciones con la contraparte que se trate $(\sum EI)$, más la suma de las posiciones netas en un mismo título utilizado como colateral en alguna de las operaciones que estén sujetas al contrato marco correspondiente considerando el factor de ajuste He $(\sum Es * He)$, más la suma de las posiciones netas al amparo del contrato marco que estén denominadas en una misma moneda distinta a la de la liquidación, ponderada por Hfx $(\sum Efx * Hfx)$.

$$\sum EI + \sum Es * He + \sum Efx * Hfx$$

  Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras distintas a las del párrafo anterior, deben reportar el importe positivo de las operaciones antes del reconocimiento de garantías multiplicada por uno más el factor de ajuste para el importe de la operación de que se trate, conforme al anexo 1-F de la CUB.

  Es decir $\sum_{i=1}^{n} Ei * (1 + He)$

Campo 11: Monto del importe NO positivo de operaciones a cargo de la institución.

Se refiere a la suma de las operaciones sin importe positivo.

- Tratándose de posiciones en **títulos de deuda** debe reportarse la suma de las posiciones netas cortas obtenidas conforme a lo siguiente:

  h) Realizando los cálculos operación por operación.

  i) Se determina la posición bruta larga en títulos de deuda.

  j) Se determina la posición bruta corta en títulos de deuda.

  k) Se obtiene la posición larga y corta en el mismo título, esto se refiere al valor mínimo, de operaciones con títulos idénticos, que se tengan tanto en posición larga, como en posición corta, sin importar de qué operación proviene una y otra posición. Se consideran títulos idénticos cuando la posición larga y la posición corta tengan la misma "clave de emisión"; es decir, que los títulos en cuestión sean idénticos en cuanto a tipo de instrumento, entidad emisora, fecha de vencimiento, tipo de cupón y fecha de revisión del cupón.

  l) Se determina la posición neta corta como la diferencia positiva entre la posición bruta corta menos la posición larga y corta en el mismo título.

  m) Clasificando las operaciones conforme al grupo de riesgo crédito al que pertenezca la entidad emisora del título de que se trate, considerando al efecto su grado de riesgo.

  n) Realizando para cada registro de esta sección la sumatoria de las respectivas operaciones según los cálculos individuales, antes mencionados

- Tratándose de operaciones en las que empleen el método simple para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras, deben reportar el valor absoluto de la diferencia entre el valor activo y pasivo del registro cuando éste resulte con signo negativo

- Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras y se trate de operaciones de reportos y préstamos de valores sujetas a un contrato marco que contenga una cláusula que permita extinguir por compensación todas las operaciones, deben registrar la exposición ajustada obtenida como la suma de las exposiciones negativas de todas las operaciones con la contraparte que se trate $(\sum EI)$, más la suma de las posiciones netas en un mismo título utilizado como colateral en alguna de las operaciones que estén sujetas al contrato marco correspondiente considerando el factor de ajuste He $(\sum Es * He)$, más la suma de las posiciones netas al amparo del contrato marco que estén denominadas en una misma moneda distinta a la de la liquidación, ponderada por Hfx $(\sum Efx * Hfx)$.

$$\sum EI + \sum Es * He + \sum Efx * Hfx$$

Tratándose de operaciones en las que empleen el método integral para reconocer la cobertura del riesgo proveniente del uso de garantías reales financieras distintas a las del párrafo anterior, deben reportar el importe negativo de las operaciones antes del reconocimiento de garantías multiplicada por uno más el factor de ajuste para el importe de la operación de que se trate, conforme al anexo 1-F de la CUB.

Es decir $\sum_{i=1}^{n} Ei * (1 + He)$

Campo 12: Grupo de riesgo

En este campo debe reportarse la clave correspondiente a la combinación grupo, ponderador y conversión de riesgo crédito al que pertenezca el acreditado/acreditada, la entidad emisora o la contraparte de la operación de que se trate, de acuerdo al siguiente catálogo:

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
53	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 10%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	10.00%
54	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 11.5%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	11.50%
55	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20 %	III	20.00%
56	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 23%	III	23.00%
57	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50 %	III	50.00%
58	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 57.50 %	III	57.50%
59	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100 %	III	100.00%
60	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115 %	III	115.00%
61	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120 %	III	120.00%
62	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 138%	III	138.00%
63	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150 %	III	150.00%
64	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 172.5%	III	172.50%
73	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VI	20.00%
74	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VI	50.00%
75	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 75%	VI	75.00%
76	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	VI	100.00%
77	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	VI	120.00%

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
78	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	VI	150.00%
80	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VII_A	20.00%
81	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 23%	VII_A	23.00%
82	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VII_A	50.00%
83	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 57.5%	VII_A	57.50%
84	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	VII_A	100.00%
85	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%	VII_A	115.00%
86	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	VII_A	120.00%
87	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 138%	VII_A	138.00%
88	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	VII_A	150.00%
89	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 172.5%	VII_A	172.50%
92	Operaciones del Grupo 9 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	IX	100.00%
93	Operaciones del Grupo 9 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%	IX	115.00%
111	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VII_B	20.00%
112	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 23%	VII_B	23.00%
113	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VII_B	50.00%
114	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 57.5%	VII_B	57.50%
115	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 100%	VII_B	100.00%
116	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%	VII_B	115.00%
117	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 120%	VII_B	120.00%
118	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 138%	VII_B	138.00%
119	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150%	VII_B	150.00%
120	Operaciones del Grupo 7 BIS cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 172.5%	VII_B	172.50%
130	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 2.88 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	2.88%
131	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 2.50 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	2.50%
132	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 28.75%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	28.75%
133	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 25 %. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	25.00%

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
134	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 7.19% (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	7.19%
135	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 6.25% (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	6.25%
136	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 57.50 %. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	57.50%
137	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50 % . (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	50.00%
138	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 14.38 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	14.38%
139	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 12.5 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	12.50%
140	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115% (cartera vencida o en etapa 3)	III	115.00%
141	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 69%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	69.00%
142	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 60%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	60.00%
143	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 17.25 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	17.25%
144	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 15 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	15.00%
145	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 86.25%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	86.25%
146	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 75%. (Líneas de Crédito de Comercio Exterior)	III	75.00%
147	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 21.56 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	21.56%
148	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 18.75 % (Líneas de Crédito Otorgadas a Casas de Bolsa)	III	18.75%
149	Operaciones del Grupo 3 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150% (cartera vencida o en etapa 3)	III	150.00%
150	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150% o en etapa 3)	VI	150.00%
151	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%(cartera vencida o en etapa 3)	VI	115.00%
152	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150% (cartera vencida o en etapa 3)	VII_A	150.00%
153	Operaciones del Grupo 7 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115%(cartera vencida o en etapa 3)	VII_A	115.00%
154	Operaciones del Grupo 9 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 150% (cartera vencida o en etapa 3)	IX	150.00%
155	Operaciones del Grupo 9 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 115% (cartera vencida o en etapa 3)	IX	115.00%
170	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 75%	VI	75.00%

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

CLAVE DEL GRUPO	DESCRIPCIÓN	GRUPO DE RIESGO	VALOR DEL PONDERADOR FINAL
172	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 20%	VI	20.00%
173	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 25%	VI	25.00%
174	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 30%	VI	30.00%
175	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 40%	VI	40.00%
176	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 50%	VI	50.00%
177	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 70%	VI	70.00%
180	Operaciones del Grupo 6 cuyo ponderador final por riesgo de crédito es de 85%	VI	85.00%

Campo 13: Grado de riesgo

En este campo debe reportarse la clave del grado de riesgo crédito que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de la operación de que se trate (de acuerdo al Anexo 1-B de la CUB); conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	Nombre corto
10	Sin Grado de Riesgo por no ser Calificado o, no aplica	SG
11	Grado de Riesgo 1	R1
12	Grado de Riesgo 2	R2
13	Grado de Riesgo 3	R3
14	Grado de Riesgo 4	R4
15	Grado de Riesgo 5	R5
16	Grado de Riesgo 6	R6

Campo 14: Plazo de la calificación

En este campo debe reportarse la clave del plazo de la calificación que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de que se trate, conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	Nombre corto
10	No aplica plazo de calificación	NPC
20	Largo plazo escala local	LPL
21	Corto plazo escala local	CPL
30	Largo plazo escala global	LPG
31	Corto plazo escala global	CPG

Este campo debe reportarse con valor 10 cuando se trate de un grupo de riesgo cuyo ponderador no esté determinado por el anexo 1-B, por ejemplo: I-A, IV, V, VII-B, IX, X.

Campo 15: Garantías reales

En este campo debe anotarse la suma de los importes de las garantías reales admisibles que la institución haya recibido para cubrir su exposición a riesgo de crédito a través del método simple o integral, siempre y cuando:

- La Institución cumpla con las Condiciones Generales establecidas en el artículo 2 BIS 31 de la CUB;
- La Institución cumpla con los requisitos mínimos establecidos en el artículo 2 BIS 32 de la CUB;
- El instrumento que actúe como garantía real sea alguno de los señalados en el artículo 2 BIS 33 de la CUB;
- El instrumento que actúe como garantía real cumpla con los requerimientos mínimos señalados en el artículo 2 BIS 34 de la CUB; y,
- La Institución cumpla con los Requerimientos del Anexo 24 de la CUB.

El importe de dichas garantías debe informarse en esta sección y en la sección 13 relativa al "Riesgo de crédito por garantías recibidas".

La protección comprada a través de la emisión de títulos con vinculación crediticia debe incluirse en este campo.

En este campo, el importe de las garantías reales debe clasificarse considerando el grupo de riesgo crédito que corresponda al acreditado/acreditada, entidad emisora o contraparte de la operación de que se trate.

Campo 16: Garantías personales y cobertura mediante Derivados de Crédito

En este campo debe reportarse el monto correspondiente a las garantías personales con las que cuente la operación de que se trate, o la cobertura recibida a través de Derivados de Incumplimiento Crediticio.

Campo 17: Reservas crediticias que no computen como Capital Complementario.

En este campo debe informarse el monto de las reservas ya constituidas, que no computen como capital complementario, de conformidad con Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito emitidas por la CNBV.

Campo 18: Importe de la exposición al riesgo de crédito al que se le aplicará el coeficiente de cargo por riesgo del 100%

En este campo debe reportarse la exposición al riesgo de crédito o exposición potencial futura tratándose de operaciones derivadas (neto de garantías reales y personales, derivados de crédito y reservas) correspondientes a aquellas operaciones celebradas con personas relacionadas, cuyo importe en su conjunto no exceda de dos millones de Unidades de Inversión, o del uno por ciento de la parte básica del Capital Neto de la Institución.

Campo 19 Importe de la exposición al riesgo de crédito al que se le aplicará el coeficiente de cargo por riesgo del 115%

En este campo debe reportarse la exposición al riesgo de crédito o exposición potencial futura tratándose de operaciones derivadas (neto de garantías reales y personales, derivados de crédito y reservas) correspondiente a aquellas operaciones:

- Relacionadas no relevantes con importe positivo.
- Relacionadas relevantes que no excedieron el límite establecido en el artículo 2 bis 6 inciso s) de la CUB y cuya operación se realizó después del 4 de marzo de 2011.
- Relacionadas relevantes cuya operación se realizó hasta el 4 de marzo de 2011.
- Créditos otorgados a un fideicomiso, sociedad mercantil u otro tipo de instrumento legal, en los que participe con un interés mayoritario alguna Persona Relacionada Relevante, cuyo único objeto sea el desarrollo de proyectos de inversión con fuente de pago propia, que cumplan tanto con los requisitos establecidos en el anexo 19 de la CUB como con las disposiciones del establecidas en el artículo 2 bis 6 inciso s).

Campo 20: Importe de la exposición al riesgo de crédito que se deduce del capital

En este campo debe reportarse el monto correspondiente a aquellas operaciones relacionadas relevantes cuyo monto agregado rebase el límite el límite establecido en el artículo 2 bis 6 inciso s) de la CUB neto de las correspondientes reservas crediticias constituidas y que no computen como capital complementario.

Campo 21: Tipo de mercado

En este campo debe reportar el tipo de mercado en el que se ha negociado la operación, al efecto deben reportar la clave asociada al mercado que corresponda.
Tratándose de operaciones diferentes a las derivadas, deben reportar el valor "10"

Clave	Descripción
10	No aplica
20	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
30	Derivados negociados a través de personas del grupo I-B cuya cámara de compensación establecida en el exterior, reconocida por Banco de México o estén establecidas en países cuyas autoridades financieras son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
40	Derivados negociados en Bolsa, Sociedades de administración de sistemas autorizadas cuya cámara de compensación no está autorizada por la Secretaría de Hacienda y Crédito Público
50	Derivados negociados en Bolsa Extranjeras e Instituciones del Exterior cuya cámara de compensación está establecida en países cuyas autoridades financieras no son miembros designados para conformar el consejo de la Organización Internacional de Comisiones de Valores.
60	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, sin protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.
70	Derivados negociados a través de un socio liquidador como cliente, con protección ante el incumplimiento del socio liquidador y con mecanismos de segregación de operaciones y garantías.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

80	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo III no comprendidas en la clave 60 y 70
90	Derivados negociados a través de un socio liquidador clasificado como grupo VII_A no comprendidas en la clave 60 y 70
100	Derivados negociados en mercados no reconocidos clasificados como grupo VII_A no comprendidas en las claves 60 y 90

Campo 22: Identificador de la operación

La institución debe generar y reportar un identificador que corresponda a la agrupación de las operaciones con la misma contraparte con base en los "campos llave", considerando el reportar en registros diferentes las agrupaciones de operaciones que resulten con importe positivo, de las que no.

En el caso de créditos y operaciones incumplidas, en este campo deben reportar el valor "1".

Campo 23: Identificador del contrato de compensación

La institución debe reportar una clave interna (diferente a los valores por defecto) que identifique el contrato marco bajo el cual se acordó la compensación de varias operaciones derivadas con la misma contraparte, por lo cual la clave puede repetirse en dos o más registros si cumplen dicho supuesto.

En el caso de que la operación (derivados, operaciones de reporto o préstamos) no cuente con acuerdo de compensación o se trate de créditos, deben reportar el valor "1".

Campo 24: Plazo remanente de la operación

Deben reportar el código que corresponda al plazo remanente de la operación conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
0	No aplica al tipo de operación
1	Menor o igual a un año
2	Mayor a un año y menor o igual a 5 años
3	Más de cinco años

En el caso que no se trate de operación derivada, deben reportar este campo con valor igual a "0"

Campo 25: Monto nocional efectivo

Tratándose de operaciones derivadas deben reportar el monto nocional efectivo no el aparente.

- En operaciones en las que sea posible tener múltiples montos nocionales, según la evolución de las condiciones de mercado, se deben obtener el monto nocional para cada combinación o estado de la naturaleza y utilizar el mayor monto nocional así obtenido.
- Cuando el monto nocional sea una función de variables de mercado, deben utilizarse el monto nocional obtenido con los valores que se tengan de dichas variables al momento de la valuación.

- Para derivados con revisión programada del monto nocional, ya sea por amortizaciones o incrementos del mismo, deben utilizarse el monto nocional promedio sobre el plazo remanente de la operación.

En cualquier caso el monto nocional efectivo, deben producir niveles para la exposición potencial futura que sean acordes con el nivel de riesgo de la operación.

Campo 26: Clave o folio para identificar la garantía

Se deben anotar una clave o folio de identificación para el contrato individual de garantía, independientemente si dicho contrato considera un sólo activo o un conjunto de éstos (portafolio). Asimismo, dicho contrato podría estar asociado a una determinada operación derivada, o a un conjunto de dichas operaciones.

En el caso de operaciones con valores o créditos deben reportar el valor "10".

Campo 27: Valor añadido

Tratándose de operaciones derivadas con contrapartes deben reportar el importe del valor añadido bruto calculado conforme al anexo 1_L de la CUB. En cualquier otro caso el valor por defecto es cero.

Campo 28: Tipo de tratamiento (reforma art 2 bis 17)

En este campo debe reportarse la clave del tipo de tratamiento que se le aplicará a los créditos reportados al determinar la exposición ponderada sujeta a riesgo conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción	
1	Créditos reestructurados considerando los términos del oficio P417/2020, hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	FCC
2	Créditos renovados considerando los términos del oficio P417/2020, hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	
3	Créditos nuevos otorgados con posterioridad al 24 de septiembre 2020 y hasta antes del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	
4	Créditos reestructurados considerando la resolución de la CUB que entró en vigor a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	REFORMA
5	Créditos nuevos otorgados bajo la resolución de la CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	
6	Créditos reestructurados que no cumplen las condiciones de la resolución de la CUB que entró en vigor a partir del 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	RC15A
7	Créditos otorgados a los cuales se les aplican los ponderadores art 2 bis 17 de la CUB vigente antes de la reforma y otras operaciones sin cambio de ponderador.	RC08A y RC15A
8	No aplica. Clase de operación diferente a crédito o constitución de base	RC08A y RC15A

La clave 1,2, 3 son valores no permitidos para esta sección.

Campo 29: Periodo crédito

Se debe anotar el periodo en el que se está otorgando el crédito, la reestructura o renovación. Al efecto deberá anotar únicamente el año seguido del mes en el cual se dio el evento es decir: AAAAMM

La clave 999901 es un valor por defecto en caso de operaciones diferentes a cartera de crédito.

Campo 30: Situación del Crédito

Se debe anotar la clave de la situación del crédito conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
1	Vigente sin pagos vencidos (antes de IFRS9)
2	Vencido (antes de IFRS9)
3	Vigente con pagos vencidos (antes de IFRS9)
4	Vigente en prórroga (antes de IFRS9)
5	Etapa 1
6	Etapa 2
7	Etapa 3
8	No aplica. Clase de operación diferente a crédito.
9	Cartera de crédito valuada a valor razonable

La clave 8 es un valor por defecto en caso de retransmisiones de operaciones diferentes a cartera de crédito.

Campo 31 Bandera para indicar si la cartera está bajo la metodología estándar o interna.

Deben reportar la clave de la situación que le aplique a la cartera reportada conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
0	Cartera exclusiva bajo enfoque estándar
1	Cartera bajo método interno en periodo de cálculo en paralelo (cuando opte por aplicar FCC)
2	Cartera bajo método interno en periodo de cálculo en paralelo
4	No aplica. Clase de operación diferente a crédito, constitución de base

Debe considerarse que aquella cartera reportada bajo la clave 2, no será considerada como parte de los resultados del requerimiento bajo método estándar y por tanto debe ser reportada simultáneamente en la sección RC14.

La clave 1 no es un valor permitido para esta sección.

APARTADO B. RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA DE LAS OPERACIONES CON PERSONAS RELACIONADAS SUJETAS A REQUERIMIENTO

Cada uno de los registros informados en esta sección corresponderán a la agrupación de operaciones derivadas con una misma contraparte, lo reportado en este apartado se validará con lo informado en el APARTADO A de esta sección.

Las operaciones celebradas con el grupo I-B conforme al artículo 2 bis 12 no deben reportarse en este apartado.

INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DEL "APARTADO B" DE LA SECCIÓN RC15

Campo 1: Clave de la institución que reporta la información

En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 2: Fecha de la información

En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información.

Campo 3: Clave de la contraparte

En este campo debe informar la clave de la contraparte de la operación asignada por Banco de México en el Catálogo General de Contrapartes (CGC) sección IV.
Las claves de contraparte se validarán contra lo reportado en el "APARTADO A".

Campo 4: Grado de riesgo de la contraparte

Deben reportar en este campo el grado de riesgo conforme a la calificación de la contraparte de acuerdo con el anexo 1-B de la CUB, al efecto deben reportar la clave asociada al grado que corresponda.
La clave enviada en este campo se utilizará para obtener el ponderador aplicable por ajuste de valuación crediticia en el cómputo de capitalización.

Clave	Descripción	Ponderador por ajuste de valuación crediticia.
10	Sin Grado de Riesgo por no ser Calificado o	2.0%
11	Grado de Riesgo 1	0.7%
12	Grado de Riesgo 2	0.8%
13	Grado de Riesgo 3	1.0%
14	Grado de Riesgo 4	2.0%
15	Grado de Riesgo 5	3.0%
16	Grado de Riesgo 6	10.0%

Campo 5: Ponderador del índice

En este campo deben reportar el ponderador de riesgo de crédito asociado a coberturas mediante derivados de incumplimiento crediticio suscritos sobre índices o canastas de

entidades de referencia, el cual se obtendrá como el promedio ponderado de los ponderadores de cada entidad incluida en el conjunto o índice de referencia (considerando los ponderadores del catálogo anterior). Para el promedio ponderador deben utilizar la representatividad de cada entidad incluida en el conjunto o índice de referencia.

Campo 6: Monto de la exposición al incumplimiento neta de la contraparte

En este campo deben reportar el importe de la exposición al incumplimiento descontada para la contraparte de conformidad con la siguiente expresión.

$$EID_i^{total} = \left(\frac{1-e^{-0.05\times M_i}}{0.05\times M_i}\right) \times EI_i^{total},$$

Donde

EI_i^{total} Corresponde al valor de conversión a riesgo de crédito con la contraparte, según lo establecido en el Anexo 1-L de la CUB. Este dato se validará por Banco de México con base en la información que reporten en el "Apartado A".

Campo 7: Monto nocional de las coberturas individuales

En este campo deben reportar el monto nocional de las coberturas individuales con la contraparte.

Campo 8: Monto nocional de las coberturas mediante derivados de incumplimiento

En este campo deben reportar el monto nocional descontado de las coberturas obtenidas mediante derivados de incumplimiento crediticio, suscrito sobre índices o canastas de entidades de referencia.

$$ND_{indice} = \left(\frac{1-e^{-0.05\times M_{indice}}}{0.05\times M_{indice}}\right) \times N_{indice}$$

Campo 9: Plazo efectivo de las operaciones con la contraparte

En este campo deben reportar el plazo efectivo de las operaciones con la contraparte.
El plazo efectivo corresponde al promedio ponderado del plazo efectivo o de vencimiento de las operaciones con la contraparte, se debe considerar como ponderador el monto nocional de cada operación.
El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

Campo 10: Plazo efectivo de las coberturas individuales

En este campo deben reportar el plazo efectivo de coberturas individuales con la contraparte.
El plazo efectivo de coberturas individuales corresponde al promedio ponderado de los plazos efectivos o de vencimiento de las coberturas de riesgo que la institución tenga contratadas para recudir su riesgo ante el incumplimiento de la contraparte mediante derivados de crédito suscritos sobre una sola entidad de referencia, se debe considerar como ponderador el monto nocional de las coberturas individuales multiplicado por el siguiente factor.

$$\left(\frac{1-e^{-0.05\times M_i^{Cob}}}{0.05\times M_i^{Cob}}\right)$$

El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

Campo 11: Plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento

En este campo deben reportar el plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento de crédito suscritos sobre índices o canastas de entidades de referencia. El plazo efectivo de coberturas mediante derivados de incumplimiento corresponde al plazo efectivo o de vencimiento de la contraparte mediante derivados de incumplimiento crediticio suscritos sobre un conjunto de entidades de referencia, se debe considerar como ponderador el monto nocional de las coberturas grupales multiplicado por el factor siguiente.

$$\left(\frac{1-e^{-0.05\times M_{Indice}}}{0.05\times M_{indice}}\right)$$

El plazo debe ser expresarse en años y calcularse conforme al artículo 2 bis 80 de la CUB sin considerar el límite máximo de cinco años.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

VII. DETERMINACIÓN DEL CAPITAL FUNDAMENTAL Y CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO POR RIESGO DE CREDITO DE LA OPERACIONES RELACIONADAS RELEVANTES

DEDUCCIÓN DEL CAPITAL FUNDAMENTAL

Para efectos de la determinación del capital básico, la suma de lo reportado en el campo 10 y 11 del apartado A cuando se trate de operaciones con personas relacionadas relevantes concertadas con posterioridad al 4 de marzo y que cumplan con lo establecido en el Art. 2 bis 6 y el artículo 238 de la CUB, se validará contra lo reportado en el concepto 93916.

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO POR RIESGO DE CRÉDITO

Para efectos de la determinación del requerimiento por riesgo de crédito se procederá de la siguiente forma:

Los activos sujetos a riesgo de crédito por registro

$$ASRCi = Campo\ 18\ del\ registro\ i$$

$$ASRCi = Campo\ \ 19\ del\ registro\ i$$

$$VALOR\ AÑADIDO = Campo\ \ 27\ del\ registro\ i$$

Los activos sujetos a riesgo de créditos convertidos y ponderados por registro

$$[ASRCPi = (ASRCi + Campo\ 27) * ponderador\ asociado\ al\ campo\ 12\ ]$$

ACTIVOS SUJETOS A RIESGO TOTALES

$$\sum_{I=1}^{N} \boldsymbol{ASRC_I}$$

ACTIVOS SUJETOS A RIESGO TOTALES CONVERTIDOS Y PONDERADOS

$$\boldsymbol{ASRCT} = \sum_{I=1}^{N} \boldsymbol{ASRCP_I}$$

REQUERIMIENTO DE CAPITAL

$$\boldsymbol{REQUERIMIENTO} = \boldsymbol{ASRCT} * \boldsymbol{.08}$$

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 17
Ayudas Específicas

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES (AYUDAS) PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC17 RELATIVA AL RIESGO DE MERCADO POR OPERACIONES CON MERCANCIAS, O CUYO RENDIMIENTO ESTÉ REFERIDO A LA VARIACIÓNEN EL PERCIO DE UNA MERCANCÍA, DE UNA CANASTA DE MERCANCÍAS O DE UN ÍNDICE REFERIDO A ÉSTAS.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC17

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de mercado (direccional y base) de las posiciones en mercancías, canastas de mercancías e índices sobre mercancías- en lo sucesivo "mercancías"-, derivadas de: operaciones - con "mercancías" - de compra, venta, préstamos, futuros, contratos adelantados e intercambio de flujos de dinero (swap); opciones sobre "mercancías"; "mercancías" en garantía con transferencia de propiedad, cedidas y recibidas; así como otros activos y pasivos, con rendimiento referido al de una "mercancía".

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC17

Las cifras que se reporten se referirán exclusivamente a operaciones de la institución. Por ningún motivo deberán reportarse cifras que sean producto de la consolidación de estados financieros.

En esta sección NO deberán incluirse las operaciones con oro.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC17

La sección RC17 está conformada por los conceptos 170000 a 170056, con una columna en donde deben reportarse:

Columna 1: Operaciones de la institución en sus oficinas en México y en sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

IV. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR.

Tratándose de entidades financieras filiales del exterior, en el reporte de cada una de éstas (adicional al de la Institución): sus operaciones, directas, deberán reportarlas en la columna 1. Asimismo, la moneda nacional serán los pesos mexicanos y la moneda

extranjera cualquier moneda distinta de dichos pesos, inclusive la del país donde resida la entidad financiera del exterior de que se trate.

V. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC17

En esta sección se solicita la suma de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo los cálculos deberán realizarse para cada mercancía de manera individual, por lo que las posiciones largas y cortas no podrán compensarse entre mercancías de distinta naturaleza.

La información de esta sección, debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

VI. MONTOS A COMPUTAR EN LA SECCIÓN RC17

Las operaciones computarán ajustándose a lo siguiente:

a) Tratándose de operaciones de contado con plata, estas computarán al valor que se obtenga en la fecha de cómputo

b) Tratándose de operaciones de futuros o contratos adelantados de "mercancías", al valor que se obtenga y resulte de multiplicar el valor en la fecha del cómputo de una unidad de la mercancía, canasta o índice por el número de unidades que ampare el futuro o contrato adelantado en la fecha del cómputo

c) Tratándose de intercambios de flujos de dinero en los que se entregue o reciba un flujo de dinero que dependa del valor de una "mercancía", al valor que se obtenga en la fecha del cómputo y que resulte de multiplicar el número de pagos de la operación por su valor nocional.

d) Tratándose de operaciones de opciones, se considerará el importe que resulte de multiplicar el valor de las "mercancías" (subyacente) por el número de mercancías (instrumento subyacente) que ampare la opción.

VII. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC17

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, deben considerar:

1. Si se trata de una operación sobre una mercancía en lo particular (conceptos 170001 al 170010 y/o 170027 al 170036), canastas de mercancías (conceptos 170011 al 170017 y/o 170037 al 170043) o índices referenciados a mercancías (170018 al 170024 y/o 170044 al 170050).

2. La posición larga y/o corta de la Institución en la "mercancía".

3. El tipo de operación que origina la posición en la "mercancía".

VIII. TIPOS DE OPERACIONES A CONSIDERAR EN ESTA SECCIÓN

Las posiciones en mercancías se registrarán conforme al tipo de operación en los conceptos correspondientes a:

- Compras – Ventas al contado de mercancías, ya concertadas pendientes de liquidar.
- Contratos adelantados (forwards) de compra y/o venta de "mercancías"
- Futuros de compra y/o venta de "mercancías"
- Emisión de opciones de compra y/o venta de "mercancías".
- Tenencia de opciones de compra y/o venta de "mercancías".
- "Mercancías" a recibir y/o entregar por garantías otorgadas y/o recibidas con trasferencia de propiedad

Las operaciones activas y/o pasivas celebradas por la institución, relativas a "mercancías", que no queden comprendidas en algún tipo de operación anterior, deberán ser informadas bajo el tipo *Otras operaciones activas y/o pasivas con rendimiento referido a "mercancías"*. Con independencia de tal reporte, será obligación de la institución enviar un comunicado a la Subgerencia de Requerimientos de Capitalización, Crédito y Estados Financieros, en el que se indiquen las características de la operación de que se trate así como, en su caso, las consideraciones, el procedimiento y/o fórmula para determinar el importe de la "posición en mercancías" derivada de la operación.

IX. POSICIONES NETAS Y BRUTAS EN LAS MISMAS MERCANCÍAS.

La posición neta por cada mercancía, larga o corta, se determina como la suma algebraica de las posiciones activas y pasivas de cada una de dichas mercancías que se obtengan conforme a lo indicado en el numeral VI de estas ayudas.

La posición bruta para cada mercancía debe ser igual a la suma de posiciones activas y pasivas de cada mercancía sin considerar si la posición es larga o corta.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

X. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC17

Concepto 170053: Suma de los montos que se compensan al determinar la posición neta.

Suma de los montos que se compensan por cada mercancía, es decir el mínimo entre la parte activa y pasiva de cada mercancía.

Concepto 170054: Posición bruta activa

Suma de las posiciones activas por cada mercancía conforme al inciso b) fracción II del Art. 2 Bis 109a de la "CUB".

Este concepto debe ser la suma de los conceptos 170001 al 170024.

Concepto 170055: Posición bruta pasiva

Sumatoria de las posiciones pasivas por cada mercancía conforme al inciso b) fracción II del Art. 2 Bis 109a de la "CUB".

Este concepto debe ser la suma de los conceptos 170027 al 170036.

Concepto 170056: Posición neta

Suma de los valores absolutos de las posiciones netas de cada mercancía conforme al inciso a fracción II del artículo 2 bis 109 a. Este concepto se validará con lo reportado en los conceptos 170053, 170054 y 170055.

Ejemplo:

	Conceptos para calcular el requerimiento			**Conceptos de validación**
Mercancía	Posición bruta activa	Posición bruta pasiva	Posición neta	Largas y cortas
A	200	50	150	50
B	50	150	-100	50
C	80	60	20	60
D	60	120	-60	60
Cifras a reportar en la Sección RC17	**390**	**380**	**330**	**220**

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 18

Ayudas Específicas

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES (AYUDAS) PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC18 RELATIVA AL RIESGO GAMMA Y VEGA EN OPERACIONES DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS).

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC18

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo gamma y vega de las opciones y títulos opcionales sobre acciones, tasas, divisas y mercancías entre otras.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC18

Las cifras que se reporten se referirán exclusivamente a operaciones de la institución relativas a opciones y títulos opcionales.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC18

La sección RC18 está conformada por los conceptos 180000 a 187999, con dos columnas en donde deben reportarse:

Columna 1: Operaciones de la Institución sobre opciones y títulos opcionales a las que se les determinará un requerimiento de capital por riesgo gamma.

Columna 2: Operaciones de la Institución sobre opciones y títulos opcionales a las que se les determinará un requerimiento de capital por riesgo vega.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC18

En esta sección se solicita la suma de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo, los cálculos deberán realizarse para cada opción de manera individual, por lo que las partes activas y pasivas podrán compensarse entre mismos subyacentes conforme a la fracción II del artículo 2 bis 109b.

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

Se entenderá por un mismo subyacente:

a) Para las operaciones comprendidas en las fracciones I a VI del Artículo 2 Bis 99 de las CUB, las operaciones comprendidas dentro de la misma clasificación y referidas a una misma banda según su plazo y de acuerdo con la fracción I del Artículo 2 Bis 102.

   En el caso de las posiciones correspondientes a Divisas o Indizadas a tipos de cambio con tasas de interés, se deberá distinguir adicionalmente por la divisa en la que se encuentren denominadas.

b) Para operaciones en divisas y oro, comprendidas en la fracción VII del Artículo 2 Bis 99 de estas disposiciones, a cada pareja de monedas y al oro.

c) Para las operaciones cuyos subyacentes estén comprendidos en la fracción VIII del Artículo 2 Bis 99 de estas disposiciones, las operaciones referidas a acciones, canastas o índices que coticen en un mismo mercado.

d) Para las operaciones con Mercancías como subyacentes, según lo contemplado en la fracción IX del referido Artículo 2 Bis 99, a cada Mercancía individualmente.

   La información de esta sección, debe reportarse con cifras al día último del mes de que se trate, en miles de pesos.

   Todas las cifras deberán reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

VI. MONTOS A COMPUTAR EN LA SECCIÓN RC18

Las instituciones determinarán las posiciones ajustándose a lo siguiente:

Valor unitario del subyacente:

Para las operaciones sobre acciones, se considerará un importe igual al valor de mercado de una sola acción subyacente. Las mismas operaciones sobre canastas de acciones e índices accionarios, computarán formando parte del portafolio accionario, como si se tratara de una acción más, considerando el valor de mercado de la canasta o índice subyacentes.

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés, se considerará el valor de mercado de la tasa de interés subyacente. En el caso de operaciones referidas al nivel del INPC, se considerará el último valor relevante observado.

En el caso de divisas, Mercancías, títulos de deuda, entre otros, se considerará el valor de mercado de una sola unidad del Título o Instrumento Subyacente correspondiente.

Número de unidades por contrato:

Para las operaciones sobre acciones, divisas, Mercancías, títulos de deuda, entre otras, se considerará el número de Títulos o Instrumentos Subyacentes que ampare la opción.

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés, se considerará el valor nocional de la opción.

El importe a reportar en la columna 1, se determinará como la suma del número de unidades por contrato de la opción, por la gamma de la opción, por la variación en el subyacente al cuadrado

$$Importe\ 1 = \sum_{i} \frac{1}{2} * \mathrm{N}_{\mathrm{i}} \times \Gamma_{i}^{(j)} \times \left(\Delta S^{(j)}\right)^2$$

Dónde:

N_i: Número de Unidades por Contrato de la opción "i".
Γ_i^j: "Gamma" de la opción "i" con subyacente "j"
ΔS^j: "Variación en el subyacente" "j"

El importe a reportar en la columna 2, se determinará como el Impacto Vega neto de las opciones con subyacente j conforme a la fracción V del artículo 2 bis 109 b.

$$IVN_j = \sum_{i} N_i \times v_i^{(j)} \times \Delta\sigma_i^{(j)}$$

Donde:

IVN_j: "Impacto vega neto" para el subyacente "j" del portafolio de opciones.
N_i: "Número de unidades por contrato" de la opción "i".
$\boldsymbol{v_i^{(j)}}$: "Variación en volatilidad" de la opción "i" con subyacente "j".

$\Delta\boldsymbol{\sigma_i^{(j)}}$: Volatilidad implícita de la opción "i" con subyacente "j"

VII. ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RC18

Para clasificar el importe de cada uno de los conceptos a los que se refiere esta sección, deben considerar que los grupos de conceptos se separan por:

- Operaciones en moneda nacional, con tasa de interés nominal o con rendimiento referido a ésta.
- Operaciones en UDIS, así como en moneda nacional con tasa de interés real o con rendimiento referido a ésta.
- Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General.
- Operaciones en divisas o indizadas a tipos de cambio, con tasa de interés.
- Operaciones con acciones y sobre acciones, o cuyo rendimiento esté referido a la variación en el precio de una acción, de una canasta de acciones o de un índice accionario.
- Operaciones con Mercancías, o cuyo rendimiento esté referido a la variación en el precio de una mercancía, de una canasta de Mercancías o de un índice referido a estas.
- Compensaciones entre posiciones largas y cortas sobre un mismo subyacente.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 19

Ayudas Específicas

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES (AYUDAS) PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC19 RELATIVA A LOS REQUERIMIENTOS DE CRÉDITO CON EL SECTOR PRIVADO POR JURISDICCIÓN.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC19

Esta sección tiene como objetivo obtener la información de los requerimientos de capital por riesgo de crédito que la institución determina conforme al Capítulo III del Título Primero BIS de la CUB, asociado a las operaciones sujetas a riesgo de crédito que celebra con el sector privado identificándolas por jurisdicción, y contar con una fuente para la validación de lo reportado como suplemento de capital contra-cíclico en la sección RC09.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC19

En esta sección deben incluirse todos los requerimientos de crédito con el sector privado que determine la Institución por su exposición al riesgo de: contraparte, entidad emisora, crédito en depósitos y préstamos otorgados, líneas de crédito y garantías otorgadas, participación o posición en esquemas de bursatilización, garantías recibidas, operaciones incumplidas bajo mecanismos de libre entrega, ajuste de valuación crediticia y exposición al fondo de incumplimiento en cámaras de compensación.

Deben incluirse los requerimientos de crédito obtenidos bajo método estándar y basados en calificaciones internas (básico o avanzado) autorizados por la CNBV.

No deben reportar en esta sección los requerimientos de las operaciones mencionadas en el numeral 2.7 del anexo 1-A.

La información reportada en esta sección se validará contra los resultados de los requerimientos de crédito obtenidos a partir de la información de las secciones RC06 (A, B y C), RC07, RC08, RC08A, RC10, RC13, RC14 y RC15 (A y B).

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN RC19

La sección RC19 está conformada por los campos 1 a 5 como se muestra en la estructura. En el caso que no aplique registro en alguna de las columnas, debe reportarse con el valor que por defecto se defina.

La columna ImporteR debe reportarse con valores mayores a cero.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

IV. REGISTROS A INFORMAR EN LA SECCIÓN RC19

Cada uno de los registros informados representará la agrupación de los requerimientos del mismo tipo y jurisdicción por las operaciones con el sector privado. Asimismo, debe reportar en un registro adicional con el importe total de los requerimientos con el sector privado, utilizando la clave de jurisdicción que se indique.

La institución deberá considerar los criterios siguientes para determinar la jurisdicción a la que corresponde el requerimiento de capital por riesgo de crédito con el sector privado.

a. Tratándose de Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito que no estén cubiertas por alguna de las garantías admisibles señaladas en los anexos 24 y 25 de las presentes disposiciones, se asignarán a la jurisdicción en la que reside su contraparte o entidad emisora.

b. Tratándose de Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito que estén cubiertas por alguna de las garantías admisibles referidas en el inciso anterior, el requerimiento de capital de la proporción cubierta se asignará a la jurisdicción en la cual reside el garante o bien la entidad emisora de la garantía; el requerimiento de capital de la porción no cubierta deberá asignarse sujetándose a lo establecido en inciso anterior.

c. El requerimiento de capital por ajuste de valuación crediticia deberá asignarse proporcionalmente según el monto de la Operación Sujeta a Riesgo de Crédito de la jurisdicción en la que reside cada contraparte.

d. Tratándose de Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito vinculadas a Esquemas de Bursatilización, el requerimiento de capital se asignará a la jurisdicción en la cual se ubican la mayor parte de los activos subyacentes de la bursatilización.

   En caso de que no se pueda determinar la jurisdicción correspondiente a la mayor parte de los activos subyacentes de la bursatilización, el requerimiento de capital se asignará a la jurisdicción en la cual se constituyó la estructura de la bursatilización.

e. En cualquier otro caso distinto a los anteriores, los requerimientos de capital por riesgo de crédito serán asignados a la jurisdicción en la que resida la contraparte que genera la Operación Sujeta a Riesgo de Crédito.

Sin perjuicio de lo señalado por la presente fracción, para efectos del cálculo del ponderador del cargo de capital contracíclico para la j-ésima jurisdicción, la Comisión a petición de la Institución resolverá a qué jurisdicción se deben asignar los requerimientos de capital señalados en la presente fracción, debiendo tomar en consideración para ello en dónde recae el riesgo de crédito final de dichas operaciones.

V. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CAMPO DE LA SECCIÓN RC19

Campo 1: Clave de la Institución

En este campo deben reportar la clave de la Institución a quién corresponde la información.

Campo 2: Fecha

En este campo deben reportar la fecha a la que corresponde la información.

Campo 3: Clave del tipo de requerimiento

En este campo deben reportar la clave del tipo de requerimiento por riesgo crédito al que corresponde la información, conforme a las claves del catálogo "Tipo de requerimiento".
El requerimiento de crédito total con el sector privado se reporta bajo la clave 300.

CLAVE	DESCRIPCIÓN	
111	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA ENTIDAD EMISORA DE LOS TÍTULOS DE DEUDA EN POSICIÓN	PORCIÓN NO GARANTIZADA
112	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA EN CRÉDITOS Y DEPÓSITOS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
113	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA EN CRÉDITOS Y DEPÓSITOS (MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS AUTORIZADOS POR LA CNBV)	PORCIÓN NO GARANTIZADA
115	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR OTORGAR GARANTÍAS PERSONALES, LÍNEAS DE CRÉDITO Y PARTICIPARCIPACIÓN EN BURSATILIZACIONES	PORCIÓN NO GARANTIZADA
116	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR LAS GARANTIAS REALES RECIBIDAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
117	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES (EXCEPTO DERIVADOS) CON PERSONAS RELACIONADAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
118	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE EN OPERACIONES INCUMPLIDAS BAJO MECANISMOS DE LIBRE ENTREGA	PORCIÓN NO GARANTIZADA
119	REQUERIMIENTO POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE NO RELACIONADA, POR OPERACIONES CON VALORES	PORCIÓN NO GARANTIZADA
120	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE (NO RELACIONADA) DE OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
121	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE (RELACIONADA) DE OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA

122	REQUERIMIENTO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA EN OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
123	REQUERIMIENTO POR EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO EN CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	PORCIÓN NO GARANTIZADA
124	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DEL ACREDITADO/ACREDITADA FCC	PORCIÓN NO GARANTIZADA
125	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DEL ACREDITADO/ACREDITADA REFORMA 2 BIS17	PORCIÓN NO GARANTIZADA
126	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DEL ARTÍCULO 2 BIS 17 (REFORMA) CON PERSONAS RELACIONADAS	PORCIÓN NO GARANTIZADA
211	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA ENTIDAD EMISORA DE LOS TÍTULOS DE DEUDA EN POSICIÓN	PORCIÓN GARANTIZADA
212	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA EN CRÉDITOS Y DEPÓSITOS	PORCIÓN GARANTIZADA
213	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DEL ACREDITADO/ACREDITADA EN CRÉDITOS Y DEPÓSITOS (MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS AUTORIZADOS POR LA CNBV)	PORCIÓN GARANTIZADA
215	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR OTORGAR GARANTÍAS PERSONALES, LÍNEAS DE CRÉDITO Y PARTICIPARCIPACIÓN EN BURSATILIZACIONES	PORCIÓN GARANTIZADA
216	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR LAS GARANTIAS REALES RECIBIDAS	PORCIÓN GARANTIZADA
217	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES (EXCEPTO DERIVADOS) CON PERSONAS RELACIONADAS	PORCIÓN GARANTIZADA
218	REQUERIMIENTOS DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE EN OPERACIONES INCUMPLIDAS BAJO MECANISMOS DE LIBRE ENTREGA	PORCIÓN GARANTIZADA
219	REQUERIMIENTO POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE NO RELACIONADA, POR OPERACIONES CON VALORES	PORCIÓN GARANTIZADA
220	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE (NO RELACIONADA) DE OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN GARANTIZADA
221	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO DE LA CONTRAPARTE (RELACIONADA) DE OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN GARANTIZADA
222	REQUERIMIENTO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA EN OPERACIONES DERIVADAS	PORCIÓN GARANTIZADA
223	REQUERIMIENTO POR EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO EN CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	PORCIÓN GARANTIZADA
224	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DEL ACREDITADO/ACREDITADA FCC	PORCIÓN GARANTIZADA
225	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DEL ACREDITADO/ACREDITADA REFORMA 2 BIS17	PORCIÓN GARANTIZADA
226	REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DEL ARTÍCULO 2 BIS 17 (REFORMA) CON PERSONAS RELACIONADAS	PORCIÓN GARANTIZADA
300	REQUERIMIENTO POR RIESGO DE CRÉDITO CONFORME AL CAPÍTULO III DEL TÍTULO PRIMERO BIS , ASOCIADO A LAS OPERACIONES SUJETAS A RIESGO DE CRÉDITO QUE CELEBREN LAS INSTITUCIONES CON EL SECTOR PRIVADO DE TODAS LAS JURISDICCIONES	TOTAL

Campo 4: Jurisdicción

En este campo deben reportar la clave ISO de la jurisdicción en la que tengan operaciones con el sector privado, conforme al listado siguiente:

CLAVE	JURISDICCIÓN
AR	República Argentina
AU	Mancomunidad de Australia
BE	Reino de Bélgica
BR	República Federativa del Brasil
CA	Canadá
CH	Confederación Helvética
CN	República Popular China
DE	República Federal de Alemania
ES	Reino de España
FR	República Francesa
GB	Reino Unido de Gran Bretaña e Irlanda del Norte
HK	Hong Kong
ID	República de Indonesia
IN	República de India
IT	República Italiana
JP	Japón
KR	República de Corea
LU	Gran Ducado de Luxemburgo
MX	Estados Unidos Mexicanos
NL	Reino de los Países Bajos
NO	Noruega
O1	Otras jurisdicciones diferentes a las del listado
RU	Rusia
SA	Reino de Arabia Saudita
SE	Reino de Suecia
SG	República de Singapur
TR	República de Turquía
US	Estados Unidos de América
ZA	República de Sudáfrica
AR	República Argentina

Para cualquier otra jurisdicción diferente a las mostradas en el listado anterior o que no esté incluida en el anexo "1-T" de la CUB deberán utilizar la clave "O1" (Otras jurisdicciones).

Para el registro cuyo tipo de requerimiento sea "300", la clave a anotar en este campo debe ser "O1".

Campo 5: Requerimiento de Capital por Riesgo de Crédito

En este campo deben reportar el importe del requerimiento de capital por riesgo de crédito de las operaciones con el sector privado obtenido conforme al capítulo III del Título Primero BIS de la CUB.

La suma de este campo de los registros con clave de tipo de requerimiento entre "111" y "223" debe ser igual al importe reportado en el registro con tipo de requerimiento "300".

ANEXO

Catálogo de clase de operación

Clave	Descripción	TIPO _TR
10101	Depósitos bancarios	8
10102	Call Money	8
10103	Compra fecha valor de divisas.	8
10105	Venta fecha valor de divisas.	8
10104	Disponibilidades-Otros	8
10201	Cartera comercial vigente (solo para RC15A, no FCC)	7
10204	Otros créditos vigentes (solo para RC15A, no FCC, nuevos o reestructuras que no cumplen reforma al artículo 2 bis 17)	6
10205	Otros créditos vencidos (solo para RC15A, no FCC, nuevos o reestructuras que no cumplen reforma al artículo 2 bis 17)	6
10212	Cartera comercial vencida (solo para RC15A, no FCC)	7
10213	Créditos otorgados a fideicomisos con fuente de pago que depende de personas relacionadas no relevantes (solo RC15A, no FCC)	7
10214	Créditos otorgados a fideicomisos con fuente de pago que depende de personas relacionadas relevantes (solo RC15A, no FCC)	7
10312	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional, con tasa de rendimiento nominal (en república , agencias y sucursales)	8
10313	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional o UDIS con tasa de rendimiento real (en república , agencias y sucursales)	8
10314	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda extranjera , con tasa de rendimiento nominal (en república , agencias y sucursales)	8
10315	Operaciones de compra fecha valor de títulos	8
10316	Operaciones de reporto actuando como reportado que no cuenten con acuerdo de compensación	8
10317	Operaciones de reporto actuando como reportador que no cuenten con acuerdo de compensación	8
10318	Operaciones de préstamo actuando como prestamista que no cuenten con acuerdo de compensación	8
10319	Operaciones de préstamo actuando como prestatario que no cuenten con acuerdo de compensación	8
10320	Operaciones de ventas fecha valor de títulos	8
10402	Futuros y Forwards sobre divisas y oro	8
10403	Futuros y Forwards sobre tasas de interés	8
10407	Monto no dispuesto de líneas de crédito irrevocables para operaciones de comercio exterior	8
10408	Monto no dispuesto de líneas de crédito irrevocables para garantizar operaciones vigentes de derivados	8
10409	Monto no dispuesto de líneas de crédito irrevocables para otras operaciones	8
10410	Monto no dispuesto de líneas de crédito irrevocables utilizadas como garantía de sostenimiento de oferta, garantía de la propuesta, garantía de ejecución y garantía de devolución	8
10419	Derivados de crédito de rendimiento total como comprador de protección.	8
10420	Derivados de crédito de rendimiento total como vendedor de protección.	8
10421	Garantías personales o avales otorgados por operaciones distintas a bursatilización	8

10422	Garantías personales otorgadas por BD que cuenten con un esquema de primeras pérdidas	8
10450	Operaciones de reporto y derivadas realizadas por el fondo de pensiones bajo el esquema de beneficios definidos	8
10451	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda relativos a las inversiones realizadas por el fondo de pensiones bajo el esquema de beneficios definidos (en república, agencias y sucursales)	8
10452	Inversiones del fondo de pensiones bajo el esquema de beneficios definidos, exclusivamente Depósitos y Préstamos constituidos u otorgados.	8
10460	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional, con tasa de rendimiento nominal (a través de fondos de inversión)	8
10461	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda nacional o UDIS con tasa de rendimiento real (a través de fondos de inversión)	8
10462	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda en moneda extranjera , con tasa de rendimiento nominal (a través de fondos de inversión)	8
10463	Posición neta larga o corta de riesgo en títulos de deuda relativos a las inversiones realizadas por el fondo de pensiones bajo el esquema de beneficios definidos (a través de fondos de inversión).	8
10464	Depósitos en efectivo otorgados como colaterales únicamente para disminuir los saldos acreedores por operaciones con derivados	8
10501	Otras operaciones	8
101031	Operaciones incumplidas de compra- venta fecha valor de divisas con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
101032	Operaciones incumplidas de compra- venta fecha valor de divisas con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103151	Operaciones incumplidas de compra- venta fecha valor de títulos con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103152	Operaciones incumplidas de compra- venta fecha valor de títulos con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103161	Operaciones incumplidas de reporto actuando como reportado con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103162	Operaciones incumplidas de reporto actuando como reportado con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103171	Operaciones incumplidas de reporto actuando como reportador con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103172	Operaciones incumplidas de reporto actuando como reportador con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103181	Operaciones incumplidas de préstamo como prestamista con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103182	Operaciones incumplidas de préstamo como prestamista con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103191	Operaciones incumplidas de préstamo como prestatario con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
103192	Operaciones incumplidas de préstamo como prestatario con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104041	Futuros y forwards sobre acciones e índice	8
104042	Futuros y Forwards sobre metales preciosos	8
104043	Futuros y Forwards sobre otros subyacentes	8
104044	Operaciones incumplidas de Futuros y Forwards con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104045	Operaciones incumplidas de Futuros y Forwards con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104051	Swaps sobre tasas de interés	8
104052	Swaps sobre divisas y oro	8
104053	Swaps sobre acciones e índices accionarios	8
104054	Swaps sobre metales preciosos	8
104055	Swaps sobre otros	8

104056	Operaciones incumplidas de Swaps con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104057	Operaciones incumplidas de Swaps con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104061	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de compra	8
104062	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de compra	8
104063	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de compra	8
104064	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de compra	8
104065	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre otros de compra	8
104066	Operaciones incumplidas en tenencia de Opciones y títulos opcionales de compra con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104067	Operaciones incumplidas en tenencia de Opciones y títulos opcionales de compra con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104068	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de venta	8
104069	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de venta	8
104070	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de venta	8
104071	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de venta	8
104072	Tenencia de Opciones y títulos opcionales sobre otros de venta	8
104073	Operaciones incumplidas en tenencia de Opciones y títulos opcionales de venta con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104074	Operaciones incumplidas en tenencia de Opciones y títulos opcionales de venta con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104075	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de compra (bajo acuerdo de compensación)	8
104076	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de compra (bajo acuerdo de compensación)	8
104077	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de compra (bajo acuerdo de compensación)	8
104078	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de compra (bajo acuerdo de compensación)	8
104079	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre otros de compra (bajo acuerdo de compensación)	8
104080	Operaciones incumplidas en Emisiones de Opciones y títulos opcionales de compra con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104081	Operaciones incumplidas en Emisiones de Opciones y títulos opcionales de compra con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104082	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de venta (bajo acuerdo de compensación)	8
104083	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de venta (bajo acuerdo de compensación)	8
104084	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de venta (bajo acuerdo de compensación)	8
104085	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de venta (bajo acuerdo de compensación)	8
104086	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre otros de venta (bajo acuerdo de compensación)	8
104087	Operaciones incumplidas en Emisiones de Opciones y títulos opcionales de venta con 5 o menos días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104088	Operaciones incumplidas en Emisiones de Opciones y títulos opcionales de venta con más de 5 días hábiles de incumplimiento bajo mecanismos de libre entrega	8
104089	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de compra (sin acuerdo de compensación)	8
104090	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de compra (sin acuerdo de compensación)	8

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

104091	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de compra (sin acuerdo de compensación)	8
104092	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de compra (sin acuerdo de compensación)	8
104093	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre otros de compra (sin acuerdo de compensación)	8
104094	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre tasas de interés de venta (sin acuerdo de compensación)	8
104095	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre divisas y oro de venta (sin acuerdo de compensación)	8
104096	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre acciones e índices accionarios de venta (sin acuerdo de compensación)	8
104097	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre metales preciosos de venta (sin acuerdo de compensación)	8
104098	Emisiones de Opciones y títulos opcionales sobre otros de venta (sin acuerdo de compensación)	8
104099	Operaciones de reportos y préstamo de valores con acuerdo de compensación bajo tratamiento del artículo 2 bis 37	8
104100	Operaciones de reportos y préstamo de valores que no cuenten con acuerdo de compensación bajo tratamiento del artículo 2 bis 37	8
10502	Depósitos en efectivo otorgados como colaterales (monto de los activos que no se restaron del capital fundamental)	8
105000	Créditos al consumo (incluyendo microcréditos) que cumplan con los criterios establecidos en los incisos a) a b) de la fracción I del artículo 2 bis 17	{1,2, 3}
115000	Créditos al consumo que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115005	Microcréditos comprendidos que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115010	Créditos a (MiPYMES) que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 , no calificados (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115020	Créditos a (MiPYMES) que satisfacen los criterios a) a c) del artículo 2 bis 17 , calificados (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	7
105002	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea a menor o igual al 50 (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
105003	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 50 y menor o igual al 60% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
105004	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 60 y menor o igual al 80%(aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
105005	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 80 y menor o igual al 90% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
105006	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 90 y menor o igual al 100% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
105007	Créditos hipotecarios que cumplan los requisitos de la fracción II del artículo 2 bis 17 y cuyo porcentaje CCV sea mayor que 100% (aplica a facilidad P418/2021 y CUB a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{1,2, 3,4,5 }
115030	Créditos hipotecarios destinados a la adquisición en propiedad de suelo destinado para la construcción de vivienda, a la adquisición, construcción, autoproducción, remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, al igual que los créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado/acreditada que no cumplen con las condiciones previstas en la fracción II del artículo 2 bis 17 (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
115040	Créditos hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE, con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía cuando el saldo insoluto del crédito sea menor o igual al 50 por ciento de la suma de la subcuenta (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

115050	Créditos hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE, con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía cuando el saldo insoluto del crédito sea mayor que 50 y menos del 85 por ciento de la suma la subcuenta (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
115060	Créditos Hipotecarios destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial, art 43 Bis de la Ley INFONAVIT y del art. 176 de la Ley del ISSSTE, con subcuenta de vivienda y sus aportaciones como garantía pero con restricción legal (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	{4,5}
105001	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial cuyo importe no exceda el equivalente en moneda nacional a 4 millones de UDIS (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2, 3}
115070	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIS y que no cumplen los criterios de la fracción IV inciso b) del artículo 2 bis 17 (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115080	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial y con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIs que cumplan los criterios de la fracción IV inciso b) del artículo 2 bis 17, no calificados (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición)	{4,5}
115090	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial, con importe menor a 4 millones de udis y/o con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIS, con calificación crediticia (a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición).	7
105008	Créditos a cargo de personas morales o físicas con actividad empresarial que individualmente o en su conjunto respecto a su entidad emisora o en su conjunto sean iguales o mayores al equivalente m.n. a 4 millones de UDIS y sus ingresos 14 millones de UDIS art. 2 bis 18 (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2, 3}
105009	Cartera bajo Facilidades Contables COVID Vencida (aplica a facilidad P418/2021)	{1,2, 3}
115100	Créditos al consumo vencidos, cuya fecha de otorgamiento o reestructura a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}
115105	Microcréditos vencidos, cuya fecha de otorgamiento o reestructura a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición	{4,5}
115110	Créditos hipotecarios vencidos cuya fecha de otorgamiento o reestructura a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}
115120	Créditos a cargo de personas morales o personas físicas con actividad empresarial y con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores a 14 millones de UDIs y/o cuyo saldo sea menor o igual a 4 millones de UDIS , cuya fecha de otorgamiento o reestructura a partir de 1 sep 2021 ó la fecha en que implementen de manera anticipada la disposición.	{4,5}

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 21

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN.

I. OBJETIVO.

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información referente a los instrumentos de capital vigentes que las instituciones hayan emitido, los pagos anticipados y/o conversiones en acciones, así como las características de las mismas y el nivel de capital regulatorio en el que computan.

II. COBERTURA.

Se deben registrar a la fecha de corte del formulario todos los instrumentos de capital vigentes emitidos por la institución. En el caso de que una emisión sea amortizada o convertida en acciones, esta deberá reportarse en esta sección al cierre de mes en el cual se llevó a cabo la operación.

III. CAMPOS DE LA SECCIÓN.

La sección está formada por 17 campos, como se muestra en la sección "Estructuras".

El caso de que no aplique registro en alguna columna, se deberá seleccionar alguno de los valores por defecto que se defina.

La información de esta sección debe reportarse con cifras al último día del mes de que se trate conforme a lo siguiente: el campo relativo a plazo efectivo debe expresarse en años; el relativo a importe, debe reportarse en miles de pesos con opción a tres decimales. Al efecto, aquellas operaciones denominadas en unidades diferentes a pesos (UDIS o moneda extranjera), deben valorizarse al "valor en pesos" de la UDI correspondiente al cierre del mes, o al "tipo de cambio peso-dólar" aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

Todas las cifras deben reportarse con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

IV. REGISTROS A INFORMAR.

Se deberá reportar las características de cada emisión a la fecha de corte teniendo en consideración los campos que se definieron como llave para reportar la información.

V. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO LA SECCIÓN.

Campo 1: Fecha de la información
En este campo debe reportarse la fecha a la que corresponda la información

Campo 2: Emisor
En este campo debe reportarse la clave de la institución que informa, de acuerdo al "Catálogo de instituciones (CASFIM)".

Campo 3: Clave del título.
En este campo se deberá de llenar la clave de la emisión del instrumento de capital. Esta clave debe estar contenida y ser vigente en el ***Catálogo de Títulos de Deuda,*** pues se validará su pertenencia. En el caso de emisiones con amortizaciones totales o que fueron convertidas en acciones se validará que ésta se haya realizado en dicho mes.

Campo 4: Monto o importe en circulación de los títulos expresado en la moneda en que fue emitida la emisión.
Se debe registrar el importe en circulación de los títulos en la moneda de emisión a la fecha de corte. En caso de que la moneda de emisión sea moneda nacional, se debe registrar el mismo valor que en el campo 5.

Campo 5: Monto o importe en circulación de los títulos expresado en moneda nacional.
Se debe registrar el importe en circulación de los títulos valorizado en moneda nacional a la fecha de corte. Los importes denominados en moneda extranjera deben valorizarse en pesos utilizando el tipo de cambio aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores. El monto o importe en circulación de los títulos expresados se reportará después de cualquier amortización parcial o total y/o alguna conversión de los títulos (inclusive puede ser cero en caso de amortización total). Toda amortización y/o conversión deberá ser reportada en el campo 17 (Monto de la amortización anticipada y/o conversión) e indicar en el campo 18 (Fecha de amortización anticipada y/o conversión) la fecha del evento.

Campo 6: Valor de la tasa cupón.
Se debe registrar el valor de la tasa cupón en porcentaje [0-100]. No se debe incluir el símbolo de porcentaje (%).

Campo 7: Plazo residual de la emisión.
Se debe de registrar el plazo residual de la emisión, para ello se considerará la fecha de corte del formulario y la fecha de vencimiento de la emisión. Las unidades de tiempo en las que se reportará este valor serán años. Tratándose de instrumentos de capital sin fecha de vencimiento deben reportar el valor por defecto de 999.99

Campo 8: Nivel de capital regulatorio en el cual se reconoce dentro del capital neto.
El campo se llenará conforme al siguiente catálogo:

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

2	Capital básico no fundamental
3	Capital complementario
4	Suplemento de capital neto
5	No computa en el capital neto o suplemento

En caso de que el instrumento de capital compute en diferentes niveles de capital, debido a que supere el limite de computabilidad de alguno, se deberá de reportar en los tramos correspondientes (registros), empleado este campo para identificar el nivel en el que computa. Adicionalmente, se deberán de repetir los datos monto en circulación, valor razonable y activos ajustados en cada registro .

Campo 9: Valor de las obligaciones conforme a los criterios contables
Se debe registrar el valor de los instrumentos de capital a la fecha de corte en moneda nacional, con base en los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

Campo 10: Monto computable en el capital básico no fundamental o complementario.
De ser el caso, se debe registrar el monto en moneda nacional que computa en cualquiera de los dos niveles del capital regulatorio.

En caso de que el instrumento compute en diferentes niveles de capital, debido a que se supere el limite de computabilidad para alguno, se deberá de reportar en dos tramos (registros), empleado este campo para reporar el monto del capital en nivel en el que computa. Por ejemplo.

CAMPO	VALORES (TRAMO CAPITAL BÁSICO NO FUNDAMENTAL)	VALORES (TRAMO CAPITAL COMPLEMENTARIO)
Fecha de corte	AAAA/MM/DD	AAAA/MM/DD
Se refiere a clave CASFIM, o a la asignada por Banco de México, utilizada para identificar a la entidad emisora del instrumento	0XXXXX	0XXXXX
Clave del Título	ABCD2022	ABCD2022
Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda en que fue emitida la emisión	100	100
Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda nacional	100	100
Nivel de capital regulatorio en el cual se reconocen dentro del Capital Neto.	2	3
Valor conforme a criterios contables.	102	102
Monto computable en el capital básico no fundamental o complementario	68	34

Campo 11: Elegibilidad para suplemento al capital neto.
El campo se llenará conforme al siguiente catálogo:

Clave	Descripción
10	Cumplan los requisitos establecidos en los Anexos 1-R y 1-S de la Circular Única, siempre que su plazo de vencimiento remanente sea mayor a un año y solo por el monto que no haya sido considerado para satisfacer el Índice de Capitalización mínimo y el Suplemento de Conservación de Capital.
20	No cumple los requisitos establecidos para ser considerados como suplemento de Capital Neto.

Cuando se trate de una institución distinta a las de Importancia Sistémica Local o el instrumento de capital deje de ser elegible para computar en el suplemento de Capital Neto, este campo debe ser reportado bajo la clave 20 y los siguientes campos 12, 13 y 14 deberán reportarse con valor igual a cero.

Campo 12: Monto del suplemento al capital neto.

Se debe registrar el monto total del suplemento al capital neto a que se refiere el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, aplicable a las Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local, el cual se determinará conforme a lo previsto por el artículo 2 Bis 117 ñ de las disposiciones. Considerando el segundo transitorio de la resolución modificatoria de la CUB publicada el 18 de junio de 2021, así como del 18 de mayo de 2026.

Del 18 de junio 2021 hasta 31 de mayo 2026.

Debiendo calcular el Suplemento al Capital Neto conforme a la fórmula indicada abajo, a más tardar al 31 de diciembre 2025

$$Suplemento\ al\ Capital\ Neto = \max(6.5\% * Activos\ Ponderados\ Sujetos\ a\ Riesgo\ Totales, 3.75\% * Activos\ Ajustados)$$

La gradualidad se aplicará con base en la siguiente tabla:

Fecha	Suplemento al capital neto
31 de diciembre de 2022	0.25 * Suplemento al capital neto
31 de diciembre de 2023	0.50 * Suplemento al capital neto
31 de diciembre de 2024	0.75 * Suplemento al capital neto
31 de diciembre de 2025	Suplemento al capital neto

De 31 de mayo al 31 de agosto de 2026.

Debiendo calcular el Suplemento al Capital Neto conforme a la fórmula indicada abajo, a más tardar al cierre del cuarto mes subsecuente al 19 de mayo de 2026, fecha de la entrada en vigor del nuevo cálculo.

$$Suplemento\ al\ Capital\ Neto = \max(10\% * APSRT\ , 3.75\% * AA) - 3.5\% * APSRT$$

Para todos los registros reportados en la sección, el valor de este campo debe ser el mismo.

Cuando se trate de una institución distinta a las de Importancia Sistémica Local o el instrumento de capital deje de ser elegible para computar en el suplemento de Capital Neto (campo 11=20), este campo debe ser reportado en cero.

Campo 13: Activos ajustados.

En este campo se registran los activos ajustados empleados para el cálculo de la razón de apalancamiento de la fecha correspondiente. El valor reportado en este campo será validado contra la información del reporte R34 A-3401 en la fecha que esté disponible en dicha fuente, en todo caso la institución tiene como límite el quinto día hábil del mes inmediato siguiente a la fecha de entrega de información, de reportar el dato definitivo.
Para todos los registros reportados en la sección, el valor de este campo debe ser el mismo.
Cuando se trate de una institución distinta a las de Importancia Sistémica Local o el instrumento de capital deje de ser elegible para computar en el suplemento de Capital Neto (campo 11=20), este campo debe ser reportado en cero.

Campo 14: Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.

En este campo se registran los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales para el cálculo del Índice de Capital. Este dato se validará con el resultado obtenido de la transmisión de las secciones 1 a 19 para el mismo periodo.
Para todos los registros reportados en la sección, el valor de este campo debe ser el mismo.
Cuando se trate de una institución distinta a las de Importancia Sistémica Local o el instrumento de capital deje de ser elegible para computar en el suplemento de Capital Neto (campo 11=20), este campo debe ser reportado en cero.

Campo 15: Baja de la emisión.

En caso de ser aplicable, se llenará el campo con base en el siguiente catálogo:

Clave	Descripción
10	Amortización Anticipada Opcional
20	Amortización Anticipada Opcional por Razones Fiscales
30	Amortización Anticipada Opcional por Deducibilidad
40	Amortización Anticipada Opcional por Razones de Capitalización
50	Amortización parcial (recompra / liquidación parcial de una emisión a mercado)
90	Conversión a acciones en la fecha acordada
0	No aplica/Emisión vigente.

Campo 16: Fecha de amortización anticipada y/o conversión.

Si durante el periodo, el instrumento de capital tuvo alguna amortización anticipada (parcial o total), o algún tipo de conversión de las emisiones, se debe de registrar la fecha del evento. En caso contrario, se debe reportar como nulo.

Campo 17: Monto de la amortización anticipada y/o conversión.

En caso de que, en el periodo, el instrumento de capital haya tenido alguna amortización anticipada (parcial o total), o algún tipo de conversión de las emisiones, se debe registrar el monto del evento en moneda nacional. Los importes denominados en moneda extranjera deben valorizarse en pesos utilizando el tipo de cambio aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores. En caso de que no se haya efectuado ninguna amortización, se debe reportar en cero.

Por ejemplo:

CAMPO	VALORES MES PREVIO A LA AMORTIZACIÓN PARCIAL	VALORES POSTERIORES A LA AMORTIZACIÓN PARCIAL
Fecha de corte	MES (T-1)	MES T
Se refiere a clave CASFIM, o a la asignada por Banco de México, utilizada para identificar a la entidad emisora del instrumento	0XXXXX	0XXXXX
Clave del Título	ABCD2022	ABCD2022
Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda en que fue emitida la emisión	100	90
Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda nacional	100	90
Valor de la tasa con la que el cupón corta.	0.6	0.6
Plazo residual en años (a la fecha de vencimiento)	4.3	4.3
Nivel de capital regulatorio en el cual se reconocen dentro del Capital Neto.	2	2
Valor conforme a los criterios contables.	101	91
Monto computable en el capital básico no fundamental o complementario	101	91
Fecha de amortización anticipada o conversión		MES T
Monto de la amortización anticipada o conversión en moneda nacional.	0	10

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Contenido

VALIDACIONES DE PROCESO

En el caso de que se genere un diagnóstico grave durante esta validación, el sistema de acopio mostrará el estado de la etapa en la que se encuentra el paquete, mediante un pequeño foco , y el proceso se detendrá hasta que el intermediario corrija y nuevamente cargue los archivos de la sección indicada.

Al dar clic en el estado de la etapa se despliega en pantalla la liga para descargar los diagnósticos. La salida de diagnósticos se muestra de la siguiente manera:

i. Descarga de diagnósticos

ETAPA: VALIDACIONES DE FORMATO Y CONSISTENCIA BÁSICA (TÉCNICAS)

En caso de que se genere un diagnóstico durante la carga del archivo, el detalle se puede visualizar en el directorio seleccionado por el usuario bajo el nombre errores.html:

El diagnóstico se muestra de la siguiente manera:

Reporte de errores de validación			
Nivel de error	**Registro**	**Tipo**	**Descripción**
Error	19	Elemento de catálogo	Error en el campo Tipo de cartera (TipoC), no coincide con el Catálogo Tipo de cartera

ii.

Registro que presenta el diagnóstico

Nombre de la validación

ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DEL REGISTRO

En caso de que se genere un diagnóstico durante la transmisión del archivo, el detalle se puede visualizar en el directorio seleccionado por el usuario bajo el nombre errores.html:

Ejemplo:

INSTITUCION	FECHA	IMPORTE 1	IMPORTE 2	NUMERO DE REGISTRO	MENSAJE	SECCION
940002	00:00.0	0	0	1	Error IdValidación 1. Concepto 10050 con importe 0 en ambos campos de la sección RC01	RC01

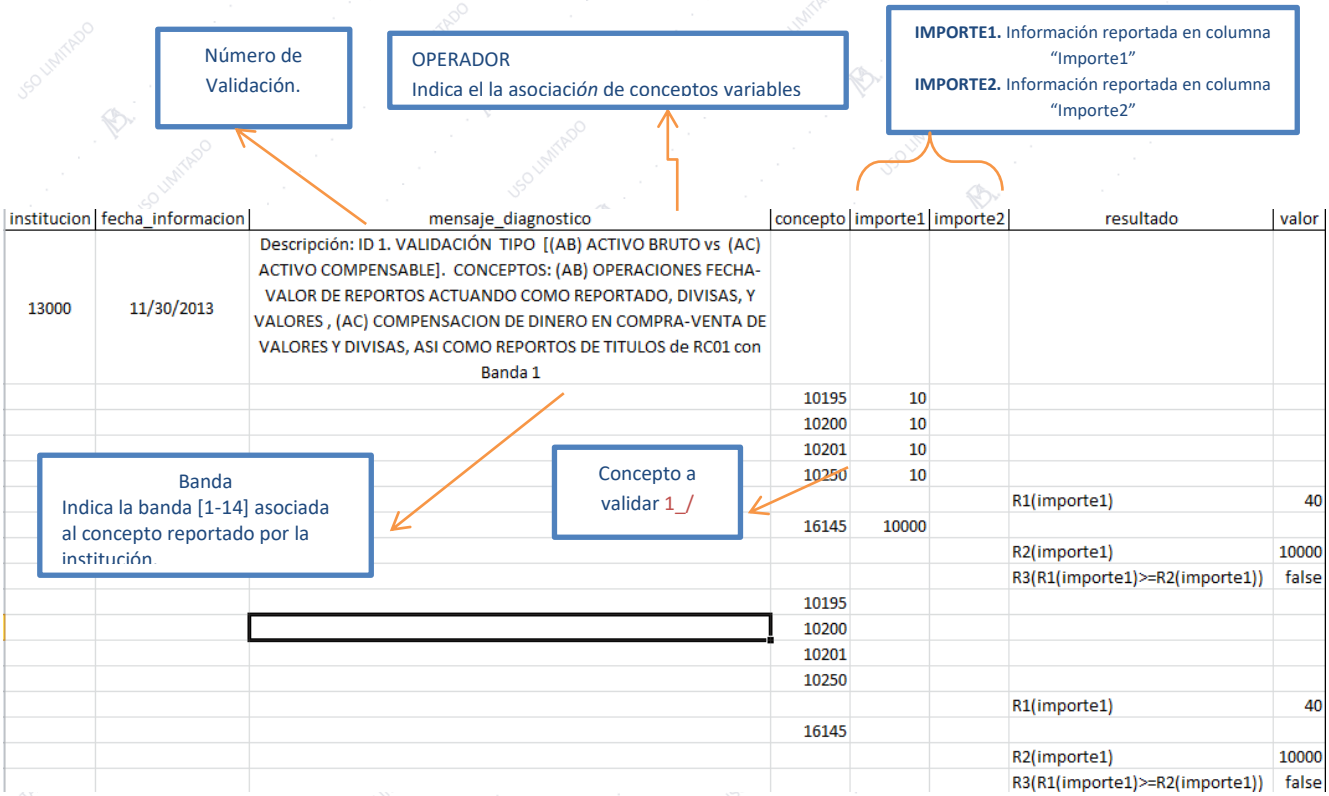
Registro que presenta el diagnóstico

Descripción de la validación

USO LIMITADO

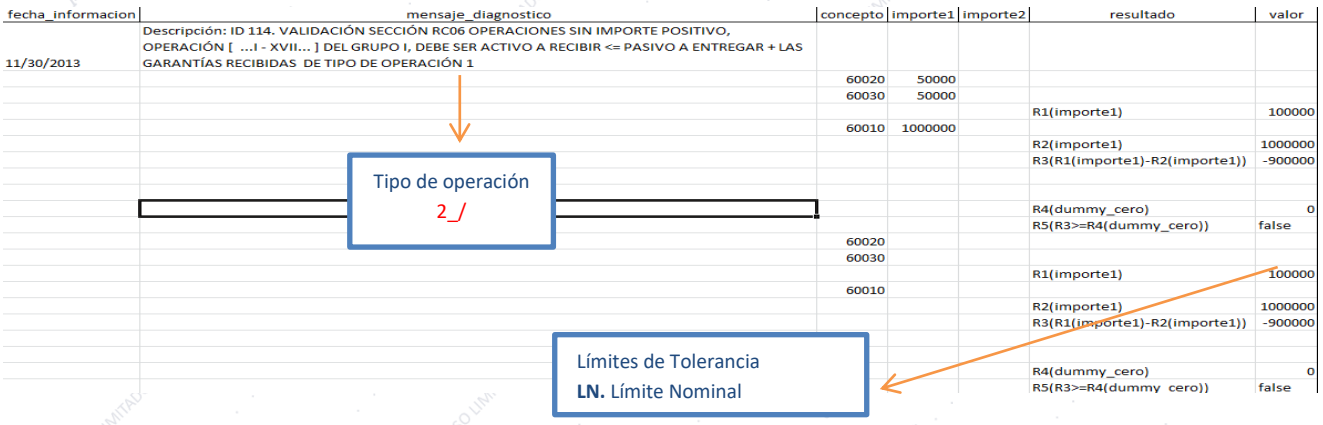
ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DE LA SECCIÓN

Al dar clic en el estado de la etapa "Validación de Consistencia de la sección" se despliega en pantalla la liga para descargar los diagnósticos. La salida de diagnósticos se muestra de la siguiente manera:



institucion	fecha_informacion	mensaje_diagnostico	concepto	importe1	importe2	resultado	valor
13000	11/30/2013	Descripción: ID 1. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPERACIONES FECHA-VALOR DE REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO, DIVISAS, Y VALORES , (AC) COMPENSACION DE DINERO EN COMPRA-VENTA DE VALORES Y DIVISAS, ASI COMO REPORTOS DE TITULOS de RC01 con Banda 1					
			10195	10			
			10200	10			
			10201	10			
			10250	10			
						R1(importe1)	40
			16145	10000			
						R2(importe1)	10000
						R3(R1(importe1)>=R2(importe1))	false
			10195				
			10200				
			10201				
			10250				
						R1(importe1)	40
			16145				
						R2(importe1)	10000
						R3(R1(importe1)>=R2(importe1))	false

La salida de diagnósticos para RC06 se muestra de la siguiente manera:



fecha_informacion	mensaje_diagnostico	concepto	importe1	importe2	resultado	valor
11/30/2013	Descripción: ID 114. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...I - XVII...] DEL GRUPO I, DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS DE TIPO DE OPERACIÓN 1					
		60020	50000			
		60030	50000			
					R1(importe1)	100000
		60010	1000000			
					R2(importe1)	1000000
					R3(R1(importe1)-R2(importe1))	-900000
					R4(dummy_cero)	0
					R5(R3>=R4(dummy_cero))	false
		60020				
		60030				
					R1(importe1)	100000
		60010				
					R2(importe1)	1000000
					R3(R1(importe1)-R2(importe1))	-900000
					R4(dummy_cero)	0
					R5(R3>=R4(dummy_cero))	false

1_/La validación para secciones RC01, RC02, RC03, RC04, RC05, RC011 presenta conceptos agrupadores. Los conceptos agrupadores son de carácter informativo, y representan la operación que se reporta en alguna de las Bandas (campo Banda), no deben ser reportados por la institución.

2_/El detalle de los tipos de operaciones se encuentra dentro de validaciones por sección.

ETAPA: VALIDACIONES ENTRE SECCIONES

Al dar clic en el estado de la etapa "Validación de Consistencia entre secciones", se despliega en pantalla la liga para descargar los diagnósticos. La salida de diagnósticos se muestra de la siguiente manera:

No. de Validación (ID) y Muestra las operaciones y secciones que se están validando

RESULTADO.
R3 (importe1). Diferencia entre los resultados de los conceptos a comparar (R1 Importe1 y R2 Importe1)

INSTITUCION	FECHA DE LA INFORMACION	MENSAJE DEL DIAGNOSTICO	CONDICION BASE	CONCEPTO	IMPORTE 1	RESULTADO	VALOR
04XXXX	08/31/2015	ERROR ID. 74 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA TASAS DE INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS RC06 Y RC15					
				10724	100		
				10726	100		
				10728	100		
				10730	100		
				10732	100		
						R1(importe1)	500
				600140	600		
						R2(importe1)	600
						R3(R1(importe1)-R2(importe1))	100

Conceptos a validar

Etapa: Validaciones de formato y consistencia básica (técnicas)

i. Objetivo de la validación

Verificar que la estructura solicitada (layout) corresponda con la especificada por Banco de México. Incluye validaciones de formato, secuencia de campos, tipos de datos, unicidad de registro, no nulos y catálogos de actualización poco frecuente.

ii. Validaciones de estructura

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada por estructura.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
1	Importación	Validación del Archivo a Importar ***Algoritmo*:** *DE LA SECCIÓN RC01 A RC18, el Archivo de la sección […] debe cumplir con las características para ser importado [.xls,.csv,.txt]*	Grave
103	Coherencia con sistemas	Valida Fecha de datos con Fecha de Transmisión ***Algoritmo*:** *DE SECCIÓN RC01 AL RC18 Fecha (Archivo)=Fecha de datos seleccionada en el sistema*	Grave
104	Coherencia con sistemas	Valida Institución con Institución de Transmisión ***Algoritmo*:** *DE SECCIÓN RC01 AL RC18 Institución (Archivo) =Institución seleccionada en el sistema*	Grave

iii. Validaciones por tipo de dato

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada por tipo de dato.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	Tipo de dato (INS)	Valida que el tipo de dato del campo institución sea Carácter ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01 AL RC18 Institución=Tipo Carácter*	Grave
4	Tipo de dato (FECHA)	Valida que el tipo de dato del campo Fecha sea Fecha ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01 AL RC18 Fecha=Tipo Fecha*	Grave
5	Tipo de dato (CONCEPTO)	Valida que el tipo de dato del campo concepto sea Carácter ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC04, RC05, RC07, RC08, RC08_A, RC10, RC11, RC12, RC13, RC17 y RC18 Concepto=Tipo Carácter*	Grave

6	Tipo de dato (IMPORTE 1)	Valida que el tipo de dato del importe1 sea Numérico ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11, RC13, RC17 y RC18 Importe 1 =Tipo Numérico*	Grave
7	Tipo de dato (IMPORTE2)	Valida que el tipo de dato del campo importe2 sea Numérico ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11, RC13, RC17 y RC18 Importe 2= Tipo Numérico*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
55	Tipo de dato (IMPORTE 1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe1) ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11, , RC13, RC17 y RC18 Importe 1 = Longitud de Importe 1=(15,3)*	Grave
56	Tipo de dato (IMPORTE2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe2) ***Algoritmo*:** *De SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11,RC13, RC17 y RC18 Importe 2=(15,3)*	Grave

iv. Validaciones por catálogos

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada por pertenencia a catálogos.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
111	Validación de Conceptos que pueden ser Reportados	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de Llaves y se encuentre dentro del periodo de vigencia de dicho concepto. ***Algoritmo*:** *DE SECCIÓN RC01, RC02,RC03,RC04,RC05,RC07,RC08, RC09,RC10,RC11,RC12,RC13,RC17 Y RC18, Si Fecha de Alta <=Fecha de Corte>=Fecha de baja y Concepto =Concepto e Id sección=Id Sección CONFORME AL NUEVO CATÁLOGO DE CONCEPTOS*	Grave
196	Validación de Conceptos que no Deben ser Reportados	Valida que el concepto no sea reportado por: Banca Múltiple, Sofoles, Sofomes, Filiales de Bancos (ES DECIR, SOLO PUEDE SER REPORTADO POR Banca de Desarrollo) ***Algoritmo*:** *95251, 92750*	Grave

v. Validaciones no ceros, negativos, nulos, único registro

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada para que no envíen ceros, negativos, nulos, único registro.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
101	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Fecha, Institución y Concepto), no se repita el registro. ***Algoritmo***: *De SECCIÓN RC01 RC02,RC03,RC04,RC05,RC07,RC08,RC08A,RC09,RC10,RC11,RC12,RC13,RC14, RC15A, RC15, RC15B, RC15C, RC17 Y RC18 Fecha, Institución y Concepto iguales*	Grave
105	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Importe1 sea Diferente de Nulo ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11,RC13, RC17 y RC18 Not Null (Importe1)*	Grave
106	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Importe2 sea Diferente de Nulo ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC05, RC07, RC08, RC09,RC10, RC11,RC13, RC17 y RC18 Not Null (Importe2)*	Grave
107	Validación Individual del Campo	Valida que el campo id sección sea Diferente de Nulo ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01 AL RC18 Not Null (Id Sección)*	Grave
108	Validación Individual del Campo	Valida que el campo id sección sea Diferente de cero ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01 AL RC18 Id Sección<>0*	Grave
109	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Importe1 sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC07, RC08,RC10, RC11,RC13, RC17 y RC18 Importe1>=0*	Grave
110	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Importe2 sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: *DE SECCIÓN RC01, RC02, RC03, RC07, RC08,RC10, RC11,RC13, RC17 y RC18 Importe2>=0*	Grave

vi. Validaciones por sección.

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa para cada sección.

RC04 RELATIVO A OPERACIONES EN DIVISAS O INDIZADAS A TIPOS DE CAMBIO CON TASA DE INTERÉS NOMINAL EN MONEDA EXTRANJERA, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
204	Tipo de Dato (Importe1)	Valida que el tipo de dato del campo Importe1 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe1= Tipo Numérico	Grave
205	Tipo de Dato (Importe2)	Valida que el tipo de dato del campo Importe2 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe2= Tipo Numérico	Grave
206	Tipo de Dato (Importe3)	Valida que el tipo de dato del campo Importe3 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe3= Tipo Numérico	Grave
207	Tipo de Dato (Importe4)	Valida que el tipo de dato del campo Importe4 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe4= Tipo Numérico	Grave
294	Tipo de Dato (Importe1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe1) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe1) = (15,3)	Grave
295	Tipo de Dato (Importe2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe2) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe2) = (15,3)	Grave
296	Tipo de Dato (Importe3)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe3) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe3) = (15,3)	Grave
297	Tipo de Dato (Importe4)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe4) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe4) = (15,3)	Grave
393	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe1)	Grave
394	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe2)	Grave
395	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe3) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe3)	Grave
396	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe4) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe4)	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
462	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe1) >=0	Grave
463	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe2) >=0	Grave
464	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe3) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe3) >=0	Grave
465	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe4) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe4) >=0	Grave
543	Valida Conceptos que DEBEN ser reportados por institución	Valida que el concepto debe ser reportado por la institución ***Algoritmo*:** 49288	Grave

RC05 RELATIVO A OPERACIONES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
534	Validación Individual por concepto del Campo	Valida que excepto algunos conceptos en particular del RC05 el campo Importe1 sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** si idsección=RC05 y conceptos <>{55123,55124,55125,55126,55127,55128 } => importe1>=0	Grave

RC06 SECCIÓN A, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR CONTRAPARTE

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
215	Tipo de Dato (Contraparte)	Valida que el tipo de dato del campo Contraparte sea Carácter ***Algoritmo*:** Contraparte=Tipo Carácter	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
216	Tipo de Dato (Tmercado)	Valida que el tipo de dato del campo Tmercado sea Numérico ***Algoritmo*:** Tmercado=Tipo Numérico	Grave
217	Tipo de Dato (IDOperacio)	Valida que el tipo de dato del campo IDOperacio sea Carácter ***Algoritmo*:** IDOperacio=Tipo Carácter	Grave
218	Tipo de Dato (IDCompensa)	Valida que el tipo de dato del campo IDCompensa sea Carácter ***Algoritmo*:** IDCompensa=Tipo Carácter	Grave
219	Tipo de Dato (GRiesgo)	Valida que el tipo de dato del campo GRiesgo sea Numérico ***Algoritmo*:** GRiesgo=Tipo Numérico	Grave
220	Tipo de Dato (PlazoCalif)	Valida que el tipo de dato del campo PlazoCalif sea Numérico ***Algoritmo*:** PlazoCalif=Tipo Numérico	Grave
221	Tipo de Dato (Clase)	Valida que el tipo de dato del campo Clase sea Numérico ***Algoritmo*:** Clase=Tipo Numérico	Grave
222	Tipo de Dato (Plazo remanente)	Valida que el tipo de dato del campo Plazo remanente sea Numérico ***Algoritmo*:** Plazo remanente=Tipo Numérico	Grave
223	Tipo de Dato (CoeficienteSP)	Valida que el tipo de dato del campo CoeficienteSP sea Numérico ***Algoritmo*:** CoeficienteSP=Tipo Numérico	Grave
224	Tipo de Dato (NocionalE)	Valida que el tipo de dato del campo NocionalE sea Numérico ***Algoritmo*:** NocionalE=Tipo Numérico	Grave
225	Tipo de Dato (ImporteA)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteA sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteA=Tipo Numérico	Grave
226	Tipo de Dato (ImporteP)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteP sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteP=Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
227	Tipo de Dato (IdGarantia)	Valida que el tipo de dato del campo IdGarantia sea Carácter ***Algoritmo*:** IdGarantia=Tipo Carácter	Grave
228	Tipo de Dato (GarantíaMS)	Valida que el tipo de dato del campo GarantíaMS sea Numérico ***Algoritmo*:** GarantíaMS=Tipo Numérico	Grave
229	Tipo de Dato (GarantíaMI)	Valida que el tipo de dato del campo GarantíaMI sea Numérico ***Algoritmo*:** GarantíaMI=Tipo Numérico	Grave
230	Tipo de Dato (ImportePO)	Valida que el tipo de dato del campo ImportePO sea Numérico ***Algoritmo*:** ImportePO=Tipo Numérico	Grave
231	Tipo de Dato (ImporteNE)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteNE sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteNE=Tipo Numérico	Grave
232	Tipo de Dato (Valor añadido)	Valida que el tipo de dato del campo Valor añadido sea Numérico ***Algoritmo*:** Valor añadido=Tipo Numérico	Grave
305	Tipo de Dato (IDOperacio)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IDOperacio) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (IDOperacio) = (4)	Grave
306	Tipo de Dato (IDCompensa)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IDCompensa) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (IDCompensa) = (4)	Grave
307	Tipo de Dato (Plazo remanente)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Plazo remanente) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Plazo remanente) = (1,0)	Grave
308	Tipo de Dato (NocionalE)	Valida la Longitud/Precisión del campo (NocionalE) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (NocionalE) = (12,3)	Grave
309	Tipo de Dato (ImporteA)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteA) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (ImporteA) = (12,3)	Grave
310	Tipo de Dato (ImporteP)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteP)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Longitud/Precisión del campo (ImporteP) = (12,3)	
311	Tipo de Dato (IdGarantia)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IdGarantia) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (IdGarantia) = (20)	Grave
312	Tipo de Dato (GarantíaMS)	Valida la Longitud/Precisión del campo (GarantíaMS) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (GarantíaMS) = (12,3)	Grave
313	Tipo de Dato (GarantíaMI)	Valida la Longitud/Precisión del campo (GarantíaMI) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (GarantíaMI) = (12,3)	Grave
314	Tipo de Dato (ImportePO)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImportePO) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ImportePO) = (12,3)	Grave
315	Tipo de Dato (ImporteNE)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteNE) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ImporteNE) = (12,3)	Grave
316	Tipo de Dato (Valor añadido)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Valor añadido) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Valor añadido) = (12,3)	Grave
370	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores. ***Algoritmo***: Campo (Contraparte) Catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores	Grave
371	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A6.Tipo de mercado y su cámara de compensación ***Algoritmo***: Campo (Tmercado) Catálogo A6. Tipo de mercado y su cámara de compensación	Grave
372	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A1. Grupo Riesgo ***Algoritmo***: Campo (GRiesgo) Catálogo A1.Grupo Riesgo	Grave
373	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A5. Plazo Calif ***Algoritmo***: Campo (PlazoCalif) Catálogo A5. Plazo Calif	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
374	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A8. Catálogo de clase de operación ***Algoritmo*:** Campo (Clase) A8. Catálogo de clase de operación	Grave
375	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo Anexo 1_L ***Algoritmo*:** Campo(CoeficienteSP) Catálogo Anexo 1_L	Grave
390	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Institución, Fecha, Contraparte, Tmercado, IDOperacio, IDCompensa, Griesgo, Clase, Plazo remanente), no se repita el registro. ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Institución, Fecha, Contraparte, Tmercado, IDOperacio, IDCompensa, Griesgo, Clase, Plazo remanente], sean iguales dos o más registros	Grave
404	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IDOperacio) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (IDOperacio)	Grave
405	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IDCompensa) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (IDCompensa)	Grave
406	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Plazo remanente) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Plazo remanente)	Grave
407	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NocionalE) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (NocionalE)	Grave
408	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteA) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (ImporteA)	Grave
409	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteP) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (ImporteP)	Grave
410	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IdGarantia) sea diferente de Nulo	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Not Null (IdGarantia)	
411	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GarantíaMS) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (GarantíaMS)	Grave
412	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GarantíaMI) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (GarantíaMI)	Grave
413	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImportePO) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImportePO)	Grave
414	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteNE) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteNE)	Grave
415	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Valor añadido) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Valor añadido)	Grave
473	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Tmercado) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Tmercado) >=0	Grave
474	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GRiesgo) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (GRiesgo) >=0	Grave
475	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (PlazoCalif) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (PlazoCalif) >=0	Grave
476	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Clase) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Clase) >=0	Grave
477	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Plazo remanente) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Plazo remanente) >=0	Grave
478	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (CoeficienteSP) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (CoeficienteSP) >=0	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
479	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NocionalE) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (NocionalE) >=0	Grave
480	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteA) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (ImporteA) >=0	Grave
481	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteP) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (ImporteP) >=0	Grave
482	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GarantíaMS) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (GarantíaMS) >=0	Grave
483	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GarantíaMI) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (GarantíaMI) >=0	Grave
484	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImportePO) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (ImportePO) >=0	Grave
485	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteNE) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (ImporteNE) >=0	Grave
486	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Valor añadido) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Valor añadido) >=0	Grave

RC06 SECCIÓN B, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
233	Tipo de Dato (Contraparte)	Valida que el tipo de dato del campo Contraparte sea Carácter ***Algoritmo***: Contraparte=Tipo Carácter	Grave
234	Tipo de Dato (GradRiesgoCont)	Valida que el tipo de dato del campo GradRiesgoCont sea Numérico ***Algoritmo***: GradRiesgoCont=Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
235	Tipo de Dato (PondInd)	Valida que el tipo de dato del campo PondInd sea Numérico ***Algoritmo***: PondInd=Tipo Numérico	Grave
236	Tipo de Dato (ExposicionC)	Valida que el tipo de dato del campo ExposicionC sea Numérico ***Algoritmo***: ExposicionC=TipoNumérico	Grave
237	Tipo de Dato (Ndcont)	Valida que el tipo de dato del campo Ndcont sea Numérico ***Algoritmo***: Ndcont=Tipo Numérico	Grave
238	Tipo de Dato (Ndind)	Valida que el tipo de dato del campo Ndind sea Numérico ***Algoritmo***: Ndind=Tipo Numérico	Grave
239	Tipo de Dato (Mcont)	Valida que el tipo de dato del campo Mcont sea Numérico ***Algoritmo***: Mcont=Tipo Numérico	Grave
240	Tipo de Dato (Mcob)	Valida que el tipo de dato del campo Mcob sea Numérico ***Algoritmo***: Mcob=Tipo Numérico	Grave
241	Tipo de Dato (Mind)	Valida que el tipo de dato del campo Mind sea Numérico ***Algoritmo***: Mind=Tipo Numérico	Grave
317	Tipo de Dato (PondInd)	Valida la Longitud/Precisión del campo (PondInd) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (PondInd) = (6,3)	Grave
318	Tipo de Dato (ExposicionC)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ExposicionC) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ExposicionC) = (12,3)	Grave
319	Tipo de Dato (Ndcont)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Ndcont) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Ndcont) = (12,3)	Grave
320	Tipo de Dato (Ndind)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Ndind) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Ndind) = (12,3)	Grave
321	Tipo de Dato (Mcont)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mcont) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Mcont) = (5,2)	Grave
322	Tipo de Dato (Mcob)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mcob)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Longitud/Precisión del campo (Mcob) = (5,2)	
323	Tipo de Dato (Mind)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mind) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Mind) = (5,2)	Grave
365	Validación Individual del Campo	Valida que el campo ExposicionC sea Diferente de cero ***Algoritmo***: ExposicionC<>0	Grave
366	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Mcont sea Diferente de cero ***Algoritmo***: Mcont<>0	Grave
376	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores. ***Algoritmo***: Campo(Contraparte) Catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores	Grave
377	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A2. Grado de Riesgo ***Algoritmo***: Campo (GradRiesgoCont) A2. Grado de Riesgo	Grave
391	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Institución, Fecha, Contraparte), no se repita el registro. ***Algoritmo***: Bajo la Llave: [Institución, Fecha, Contraparte], sean iguales dos o más registros	Grave
416	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (PondInd) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (PondInd)	Grave
417	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ExposicionC) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ExposicionC)	Grave
418	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndcont) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Ndcont)	Grave
419	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndind) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Ndind)	Grave
420	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcont) sea diferente de Nulo	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Not Null (Mcont)	
421	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcob) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Mcob)	Grave
422	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mind) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Mind)	Grave
487	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GradRiesgoCont) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (GradRiesgoCont) >=0	Grave
488	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndcont) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Ndcont) >=0	Grave
489	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndind) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Ndind) >=0	Grave
490	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcont) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mcont) >=0	Grave
491	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcob) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mcob) >=0	Grave
492	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mind) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mind) >=0	Grave

RC06 SECCIÓN C, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR LA EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
242	Tipo de Dato (TipoCC)	Valida que el tipo de dato del campo TipoCC sea Numérico ***Algoritmo***:	Grave	Vigente

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
		TipoCC=Tipo Numérico		
243	Tipo de Dato (Metodol)	Valida que el tipo de dato del campo Metodol sea Numérico ***Algoritmo*:** Metodol=Tipo Numérico	Grave	Vigente
244	Tipo de Dato (Aportacion)	Valida que el tipo de dato del campo Aportacion sea Numérico ***Algoritmo*:** Aportacion=Tipo Numérico	Grave	Vigente
245	Tipo de Dato (Conversion)	Valida que el tipo de dato del campo Conversion sea Numérico ***Algoritmo*:** Conversion=Tipo Numérico	Grave	Vigente
246	Tipo de Dato (CapitalT)	Valida que el tipo de dato del campo CapitalT sea Numérico ***Algoritmo*:** CapitalT=Tipo Numérico	Grave	Vigente
247	Tipo de Dato (RecursosTot Fondo)	Valida que el tipo de dato del campo RecursosTot Fondo sea Numérico ***Algoritmo*:** RecursosTot Fondo=Tipo Numérico	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
248	Tipo de Dato (RecursosPropios)	Valida que el tipo de dato del campo RecursosPropios sea Numérico ***Algoritmo*:** RecursosPropios=Tipo Numérico	Grave	Vigente
249	Tipo de Dato (Recursos disponibles)	Valida que el tipo de dato del campo Recursos disponibles sea Numérico ***Algoritmo*:** Recursos disponibles=Tipo Numérico	Grave	Vigente
250	Tipo de Dato (TotalAportac)	Valida que el tipo de dato del campo TotalAportac sea Numérico ***Algoritmo*:** TotalAportac=Tipo Numérico	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
251	Tipo de Dato (NumeroSoc)	Valida que el tipo de dato del campo NumeroSoc sea Numérico ***Algoritmo*:** NumeroSoc=Tipo Numérico	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
252	Tipo de Dato (Beta2)	Valida que el tipo de dato del campo Beta2 sea Numérico ***Algoritmo*:**	Grave	Hasta fecha 31/05/2022

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
		Beta2=Tipo Numérico		
253	Tipo de Dato (Asigna)	Valida que el tipo de dato del campo Asigna sea Numérico ***Algoritmo*:** Asigna=Tipo Numérico	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
254	Tipo de Dato (FraccSocL)	Valida que el tipo de dato del campo FraccSocL sea Numérico ***Algoritmo*:** FraccSocL=Tipo Numérico	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
324	Tipo de Dato (Aportacion)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Aportacion) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Aportacion) = (12,3)	Grave	Vigente
325	Tipo de Dato (Conversion)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Conversion) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Conversion) = (12,3)	Grave	Vigente
326	Tipo de Dato (CapitalT)	Valida la Longitud/Precisión del campo (CapitalT) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (CapitalT) = (12,3)	Grave	Vigente
327	Tipo de Dato (RecursosTot Fondo)	Valida la Longitud/Precisión del campo (RecursosTot Fondo) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (RecursosTot Fondo) = (12,3)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
328	Tipo de Dato (RecursosPropios)	Valida la Longitud/Precisión del campo (RecursosPropios) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (RecursosPropios) = (12,3)	Grave	Vigente
329	Tipo de Dato (Recursos disponibles)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Recursos disponibles) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Recursos disponibles) = (12,3)	Grave	Vigente
330	Tipo de Dato (TotalAportac)	Valida la Longitud/Precisión del campo (TotalAportac) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (TotalAportac) = (12,3)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
331	Tipo de Dato (NumeroSoc)	Valida la Longitud/Precisión del campo (NumeroSoc) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (NumeroSoc) = (12,3)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
332	Tipo de Dato (Beta2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Beta2) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Beta2) = (5,2)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
333	Tipo de Dato (Asigna)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Asigna) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Asigna) = (5,0)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
334	Tipo de Dato (FraccSocL)	Valida la Longitud/Precisión del campo (FraccSocL) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (FraccSocL) = (5,2)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
378	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A6. Tipo de mercado y su cámara de compensación ***Algoritmo***: Campo (TipoCC) A6. Tipo de mercado y su cámara de compensación	Grave	Vigente
379	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A7. Método de cálculo ***Algoritmo***: Campo (Metodol) A7. Método de cálculo	Grave	Vigente
392	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Institución, Fecha, TipoCC, Metodol) no se repita el registro. ***Algoritmo***: Bajo la Llave: [Institución, Fecha, TipoCC, Metodol], sean iguales dos o más registros	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
423	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Aportacion) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Aportacion)	Grave	Vigente

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
424	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Conversion) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Conversion)	Grave	Vigente
425	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (CapitalT) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (CapitalT)	Grave	Vigente
426	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (RecursosTot Fondo) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (RecursosTot Fondo)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
427	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (RecursosPropios) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (RecursosPropios)	Grave	Vigente
428	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (TotalAportac) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (TotalAportac)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
429	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NumeroSoc) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (NumeroSoc)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
430	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Beta2) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Beta2)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
431	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Asigna) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Asigna)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
432	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (FraccSocL) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (FraccSocL)	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
493	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (TipoCC) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (TipoCC) >=0	Grave	Vigente
494	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Metodol) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:**	Grave	Vigente

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
		(Metodol) >=0		
495	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Aportacion) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Aportacion) >=0	Grave	Vigente
496	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Conversion) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Conversion) >=0	Grave	Vigente
497	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (CapitalT) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (CapitalT) >=0	Grave	Vigente
498	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (RecursosTot Fondo) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (RecursosTot Fondo) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
499	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (RecursosPropios) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (RecursosPropios) >=0	Grave	Vigente
500	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (TotalAportac) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (TotalAportac) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
501	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NumeroSoc) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (NumeroSoc) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
502	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Beta2) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Beta2) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
503	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Asigna) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Asigna) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
504	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (FraccSocL) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (FraccSocL) >=0	Grave	Hasta fecha 31/05/2022
532	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Recursos disponibles) sea Mayor o igual a cero	Grave	Vigente

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel	Vigencia
		Algoritmo: (Recursos disponibles) >=0		
533	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Recursos disponibles) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Recursos disponibles)	Grave	Vigente
706	Validación Individual del Campo	Valida que los campos que integran la llave sean diferentes de Nulo ***Algoritmo:*** Not Null (Institución Fecha TipoCC Contraparte Metodol)	Grave	Desde fecha 30/06/2022
712	Tipo de Dato (Contraparte)	Valida que el tipo de dato del campo Contraparte sea Carácter ***Algoritmo:*** Contraparte=Tipo Carácter	Grave	Desde fecha 30/06/2022
713	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores. ***Algoritmo:*** Campo(Contraparte) ..Catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores	Grave	Desde fecha 30/06/2022
714	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Institución, Fecha,TipoCC, Contraparte, Metodol) no se repita el registro. ***Algoritmo:*** Bajo la Llave: [Institución, Fecha,TipoCC, Contraparte, Metodol], sean diferentes registros	Grave	Desde fecha 30/06/2022

RC08 RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR DEPÓSITOS Y PRÉSTAMOS

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
115	Valida Conceptos que DEBEN ser reportados por institución	Valida que el concepto debe ser reportado por la institución ***Algoritmo***: 89900	Grave

RC08_A RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO DE CARTERA DE CONSUMO, VIVIENDA Y A MIPYMES (NUEVOS, REESTRUCTURADOS O RENOVADOS AL AMPARO DEL OFICIO P418/2020 Y SU ALCANCE P430/2020 Y DE LA RESOLUCIÓN QUE MODIFICA EL ARTICULO 2 BIS 17 DE LA CUB A PARTIR DE LO PUBLICADO EN EL DOF EL 20 DE JULIO DE 2021)

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
565	Unicidad de registro	Valida la unicidad del registro ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Inst Fecha Tiporel Clase Tipo_Trat Periodo_cred Situacion GRiesgo Grado Plazo_remanente Etiq_Periodo_Paralelo], no existan dos o más registros iguales.	Grave
566	Tipo de Dato (Tiporel)	Valida que el tipo de dato del campo Tiporel sea Numérico ***Algoritmo*:** Tiporel= Tipo Numérico	Grave
567	Tipo de Dato (Clase)	Valida que el tipo de dato del campo Clase sea Numérico ***Algoritmo*:** Clase= Tipo Numérico	Grave
568	Tipo de Dato (TipoTrat)	Valida que el tipo de dato del campo TipoTrat sea Numérico ***Algoritmo*:** TipoFCC= Tipo Numérico	Grave
569	Tipo de Dato (Periodo_cred)	Valida que el tipo de dato del campo Periodo_cred sea Numérico ***Algoritmo*:** Periodo_cred= Tipo Numérico	Grave
570	Tipo de Dato (Situacion)	Valida que el tipo de dato del campo Situacion sea Numérico ***Algoritmo*:** Situacion= Tipo Numérico	Grave
571	Tipo de Dato (GRiesgo)	Valida que el tipo de dato del campo GRiesgo sea Numérico ***Algoritmo*:** GRiesgo= Tipo Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
572	Tipo de Dato (Grado)	Valida que el tipo de dato del campo Grado sea Numérico ***Algoritmo*:** Grado= Tipo Numérico	Grave
573	Tipo de Dato (PlazoCalif)	Valida que el tipo de dato del campo PlazoCalif sea Numérico ***Algoritmo*:** PlazoCalif= Tipo Numérico	Grave
574	Tipo de Dato (Plazo remanente)	Valida que el tipo de dato del campo Plazo remanente sea Numérico ***Algoritmo*:** Plazo remanente= Tipo Numérico	Grave
575	Tipo de Dato (Importe)	Valida que el tipo de dato del campo Importe sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe = Tipo Numérico	Grave
576	Tipo de Dato (Garantia_ME)	Valida que el tipo de dato del campo Garantia_ME sea Numérico ***Algoritmo*:** Garantia_ME = Tipo Numérico	Grave
577	Tipo de Dato (Garantia_MI)	Valida que el tipo de dato del campo Garantia_MI sea Numérico ***Algoritmo*:** Garantia_MI = Tipo Numérico	Grave
578	Tipo de Dato (Aval)	Valida que el tipo de dato del campo Aval sea Numérico ***Algoritmo*:** Aval = Tipo Numérico	Grave
579	Tipo de Dato (Der_Cred)	Valida que el tipo de dato del campo Der_Cred sea Numérico ***Algoritmo*:** Der_Cred = Tipo Numérico	Grave
580	Tipo de Dato (Reservas)	Valida que el tipo de dato del campo Reservas sea Numérico ***Algoritmo*:** Reservas = Tipo Numérico	Grave
581	Tipo de Dato (Tiporel)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Tiporel) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Tiporel) = (2)	Grave
582	Tipo de Dato (Periodo_cred)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Periodo_cred) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Periodo_cred) = (6,0)	Grave
583	Tipo de Dato (Importe)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/Precisión del campo (Importe) = (12,3)	
584	Tipo de Dato (Garantia_ME)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Garantia_ME) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Garantia_ME) = (12,3)	Grave
585	Tipo de Dato (Garantia_MI)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Garantia_MI) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Garantia_MI) = (12,3)	Grave
586	Tipo de Dato (Aval)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Aval) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Aval) = (12,3)	Grave
587	Tipo de Dato (Reservas)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Reservas) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Reservas) = (12,3)	Grave
588	Tipo de Dato (Der_Cred)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Der_Cred) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Der_Cred) = (12,3)	Grave
589	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 25 RANGO PLAZO REMANENTE ***Algoritmo*:** Campo (Plazo remanente) Catálogo de ANEXO 25 RANGO PLAZO REMANENTE	Grave
590	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 8. Clase de operación ***Algoritmo*:** Campo (Clase) Catálogo de ANEXO 8. Clase de operación	Grave
591	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 23. TIPO DE TRATAMIENTO ***Algoritmo*:** Campo (TipoTrat) Catálogo de ANEXO 23. TIPO DE TRATAMIENTO	Grave
592	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 24 SITUACIÓN DEL CRÉDITO ***Algoritmo*:** Campo (Situacion) Catálogo de ANEXO 24 SITUACIÓN DEL CRÉDITO	Grave
593	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 3. Grupo de Riesgo	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Campo (GRiesgo) Catálogo de ANEXO 3. Grupo de Riesgo	
594	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 4. Grado de Riesgo ***Algoritmo***: Campo (Grado) Catálogo de ANEXO 4. Grado de Riesgo	Grave
595	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 5. Plazo de la Calificación ***Algoritmo***: Campo (PlazoCalif) Catálogo de ANEXO 5. Plazo de la Calificación	Grave
596	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del ANEXO 22. Tipo Rel ***Algoritmo***: Campo (Tiporel) Catálogo de ANEXO 22. Tipo Rel	Grave
597	Validación Individual del Campo	Valida que los campos que integran la llave (Inst, Fecha, Tiporel, Clase, TipoTrat, Periodo_cred, Situacion, GRiesgo, Grado, Plazo_remanente) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Inst, Fecha, Tiporel, Clase, TipoFCC, Periodo_cred, Situacion, GRiesgo, Grado, Plazo_remanente, Etiq_Periodo_Paralelo)	Grave
598	Validación Individual del Campo	Valida que los campos que integran la llave (PlazoCalif, Importe, Garantia_ME, Garantia_MI, Aval, Der_Cred, Reservas) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (PlazoCalif, Importe, Garantia_ME, Garantia_MI, Aval, Der_Cred, Reservas, Req_Ant)	Grave
599	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe) >=0	Grave
600	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Garantia_ME) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Garantia_ME) >=0	Grave
601	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Garantia_MI) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Garantia_MI) >=0	Grave
602	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Aval) sea Mayor o igual a cero	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: (Aval) >=0	
603	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Der_Cred) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Der_Cred) >=0	Grave
604	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Reservas) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Reservas) >=0	Grave
606	Tipo de Dato (Req_Ant)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Aval) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Aval) = (12,3)	Grave
608	Tipo de Dato (Req_Ant)	Valida que el tipo de dato del campo Req_Ant sea Numérico ***Algoritmo***: Res_Ant= Tipo Numérico	Grave
609	Tipo de dato (CCV_promedio)	Valida el tipo de dato ***Algoritmo***: CCV_promedio=Tipo Numérico	Grave
610	Tipo de dato (Valor_vivienda)	Valida el tipo de dato ***Algoritmo***: Valor_vivienda=Tipo Numérico	Grave
611	Tipo de dato (Valor_subcuenta)	Valida el tipo de dato ***Algoritmo***: Valor_subcuenta=Tipo Numérico	Grave
612	Tipo de dato (CCV_promedio)	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo CCV_promedio = 3,2	Grave
613	Tipo de dato (Valor_vivienda)	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo Valor_vivienda = 12,3	Grave
614	Tipo de dato (Valor_subcuenta)	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo Valor_subcuenta = 12,3	Grave
615	Validación Individual del Campo	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: (Req_Anterior) >0	Grave
616	Validación Individual del Campo	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: (CCV_promedio) >=0	Grave
617	Validación Individual del Campo	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: (Valor_vivienda) >=0	Grave
618	Validación Individual del Campo	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: (Valor_subcuenta) >=0	Grave
619	Tipo de dato (Etiq_Periodo_Paralelo)	Valida la precisión del campo ***Algoritmo***: Etiq_Periodo_Paralelo=Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
620	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que la clave enviada por la institución en el Campo(Etiq_Periodo_Paralelo) pertenezca al ANEXO 26 Bandera que indica si la cartera se encuentra bajo metodologías internas dentro de un en periodo en paralelo de cálculo.	Grave

RC09 RELATIVO A LA DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
114	Valida Conceptos que DEBEN ser reportados por institución	Valida que el concepto debe ser reportado por la institución ***Algoritmo*:** CONCEPTO OBLIGATORIO: RC09: 95005, 95661, 95055, 95669, 95670,95671,95674,95675,95677 95689 desde marzo 2026 90075 y 90080 hasta diciembre 2021	Grave
197	Validación Individual por concepto del Campo	Valida que excepto algunos conceptos en particular del RC09 el campo Importe1 sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** si idsección=RC09 y conceptos <>{90075, 90080, 95050, 95055, 95060, 95065,95066,95398, 95669, 95670, 95671, 95650, 95655, 95661,95674, 95675 } => importe1>=0	Grave

RC10 A RIESGO CRÉDITO POR BURSATILZACIÓN

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
661	Unicidad de registro	Valida la unicidad del registro ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Inst Fecha Clave_emisión Esquema Tipo_activo subyacente Forma_part Transferencia Clase_bursatilización	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Calificación_GradoRgo Tipo_tramo Plazo_efectivo Tipo_plazo Punto_A Punto_D], no existan dos o más registros iguales	
662	Tipo de dato: Esquema	Valida que el tipo de dato del campo Esquema sea Numérico ***Algoritmo*:** Esquema=Tipo Numérico	Grave
663	Tipo de dato: Tipo_activo subyacente	Valida que el tipo de dato del campo Tipo_activo subyacente sea Numérico ***Algoritmo*:** Tipo_activo subyacente=Tipo Numérico	Grave
664	Tipo de dato: Forma_part	Valida que el tipo de dato del campo Forma_part sea Numérico ***Algoritmo*:** Forma_part=Tipo Numérico	Grave
665	Tipo de dato: Transferencia	Valida que el tipo de dato del campo Transferencia sea Numérico ***Algoritmo*:** Transferencia=Tipo Numérico	Grave
666	Tipo de dato: Clase_bursatilización	Valida que el tipo de dato del campo Clase_bursatilización sea Numérico ***Algoritmo*:** Clase_bursatilización=Tipo Numérico	Grave
667	Tipo de dato: Calificación	Valida que el tipo de dato del campo Calificacion_GradoRgo sea Numérico ***Algoritmo*:** Calificacion_GradoRgo=Tipo Numérico	Grave
668	Tipo de dato: Tipo de tramo	Valida que el tipo de dato del campo Tipo_tramo sea Numérico ***Algoritmo*:** Tipo_tramo=Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
669	Tipo de dato: Plazo_efectivo	Valida que el tipo de dato del campo Plazo_efectivo sea Numérico ***Algoritmo*:** Plazo_efectivo=Tipo Numérico	Grave
670	Tipo de dato: Ponderación Final	Valida que el tipo de dato del campo Pond_ Final sea Numérico ***Algoritmo*:** Pond_ Final=Tipo Numérico	Grave
671	Tipo de dato: Punto A	Valida que el tipo de dato del campo Punto_A sea Numérico ***Algoritmo*:** Punto_A=Tipo Numérico	Grave
672	Tipo de dato: Punto D	Valida que el tipo de dato del campo Punto_D sea Numérico ***Algoritmo*:** Punto_D=Tipo Numérico	Grave
673	Tipo de dato: Importe	Valida que el tipo de dato del campo Importe sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe=Tipo Numérico	Grave
674	Tipo de dato: Req_ posición bajo tratamiento específico	Valida que el tipo de dato del campo Req_ posicion sea Numérico ***Algoritmo*:** Req_ posicion=Tipo Numérico	Grave
675	Tipo de dato: Req_ act_ suby, como si no se hubieran bursatilizado	Valida que el tipo de dato del campo Req_ act_ suby sea Numérico ***Algoritmo*:** Req_ act_ suby=Tipo Numérico	Grave
676	Longitud Esquema	Valida la Longitud/Precisión del campo (Esquema) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/precisión del campo (Esquema) = (2,0)	
677	Longitud Tipo_activo subyacente	Valida la Longitud/Precisión del campo (Tipo_activo subyacente) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Tipo_activo subyacente) = (2,0)	Grave
678	Longitud Forma_part	Valida la Longitud/Precisión del campo (Forma_part) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Forma_part) = (2,0)	Grave
679	Longitud Transferencia	Valida la Longitud/Precisión del campo (Transferencia) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Transferencia)= (2,0)	Grave
680	Longitud Clase_bursatilización	Valida la Longitud/Precisión del campo (Clase_bursatilización) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Clase_bursatilización) = (2,0)	Grave
681	Longitud Calificacion_GradoRgo	Valida la Longitud/Precisión del campo (Calificacion_GradoRgo) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Calificacion_GradoRgo) = (5,0)	Grave
682	Longitud Tipo_tramo	Valida la Longitud/Precisión del campo (Tipo_tramo) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Tipo_tramo) = (2,0)	Grave
683	Longitud Plazo_efectivo	Valida la Longitud/Precisión del campo (Plazo_efectivo) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Plazo_efectivo) = (3,2)	Grave
684	Longitud Pond_ Final	Valida la Longitud/Precisión del campo (Pond_ Final) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/precisión del campo (Pond_ Final) =(4,2)	
685	Longitud Punto_A	Valida la Longitud/Precisión del campo (Punto_A) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Punto_A) = (3,2)	Grave
686	Longitud Punto_D	Valida la Longitud/Precisión del campo (Punto_D) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Punto_D) = (3,2)	Grave
687	Longitud Importe	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Importe)= (12,3)	Grave
688	Longitud Req_ posicion	Valida la Longitud/Precisión del campo (Req_ posicion) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Req_ posicion) = (12,3)	Grave
689	Longitud Req_ act_ suby	Valida la Longitud/Precisión del campo (Req_ act_ suby) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo (Req_ act_ suby) = (12,3)	Grave
690	Validación Individual del Campo	Valida que los campos que integran la llave (sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null Bajo, la llave: Inst Fecha Clave_emisión Esquema Tipo_activo subyacente Forma_part Transferencia Clase_bursatilización Calificación_GradoRgo Tipo_tramo Plazo_efectivo Tipo_plazo Punto_A Punto_D	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
691	Validación de pertenencia a catálogo: (Esquema)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Esquema) …Anexo 32. Esquema ***Algoritmo*:** Campo (Esquema) …Anexo 32. Esquema	Grave
692	Validación de pertenencia a catálogo: (Tipo_activo subyacente)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Tipo_activo subyacente) …Anexo 33. Tipo de Subyacente ***Algoritmo*:** Campo (Tipo_activo subyacente) …Anexo 33. Tipo de Subyacente	Grave
693	Validación de pertenencia a catálogo: (Forma_part)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Forma_part) …Anexo 34. Forma de Participación ***Algoritmo*:** Campo (Forma_part) …Anexo 34. Forma de Participación	Grave
694	Validación de pertenencia a catálogo: (Transferencia)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Transferencia) …Anexo35. Transferencia ***Algoritmo*:** Campo (Transferencia) …Anexo35. Transferencia	Grave
695	Validación de pertenencia a catálogo: (Clase_bursatilización)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Clase_bursatilización) …Anexo 36. Clase Bursatilización ***Algoritmo*:** Campo (Clase_bursatilización) …Anexo 36. Clase Bursatilización	Grave
696	Validación de pertenencia a catálogo: (Calificación)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Calificacion_GradoRgo) …Anexo 31. Calificaciones ***Algoritmo*:** Campo (Calificacion_GradoRgo) …Anexo 31. Calificaciones	Grave
697	Validación de pertenencia a catálogo: (Tipo de tramo)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Tipo_tramo) …Anexo 30. Tipo de tramo ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Campo (Tipo_tramo) …Anexo 30. Tipo de tramo	
698	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Pond_ Final) esté en RV= [0.00, 1250.00] ***Algoritmo*:** Campo (Pond_ Final) esté en RV= [0.00, 1250.00]	Grave
699	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Plazoefectivo) esté en RV= [0.01, 999.99] ***Algoritmo*:** (Plazoefectivo) esté en RV= [0.01, 999.99]	Grave
700	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Punto A) esté en RV= [0.00, 100.00] ***Algoritmo*:** (Punto A) esté en RV= [0.00, 100.00]	Grave
701	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Punto D) esté en RV= [0.00, 100.00] ***Algoritmo*:** (Punto D) esté en RV= [0.00, 100.00]	Grave
702	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe) sea mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe) >=0	Grave
703	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Req_ posición bajo tratamiento específico) sea mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Req_ posición bajo tratamiento específico) >=0	Grave
704	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Req_ act_ suby, como si no se hubieran bursatilizado) sea mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Req_ act_ suby, como si no se hubieran bursatilizado) >=0	Grave
707	Tipo de dato: Clave_emisión	Valida que el tipo de dato del campo Clave_emisión sea Alfanumérico ***Algoritmo*:** Clave_emisión=Tipo Alfanumérico	Grave
708	Tipo de dato: Tipo_plazo	Valida que el tipo de dato del campo Tipo_plazo sea Numérico ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Tipo_plazo=Tipo Numérico	
709	Longitud Clave_emisión	Valida la Longitud/Precisión del campo (Clave_emisión) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo Clave_emisión: 18	Grave
710	Longitud Tipo_plazo	Valida la Longitud/Precisión del campo (Tipo_plazo) ***Algoritmo*:** Longitud/precisión del campo Tipo_plazo: 1,0	Grave
711	Validación de pertenencia a catálogo: (Tipo Plazo)	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo del Campo (Tipo_plazo) …Anexo 37. Tipo plazo ***Algoritmo*:** Campo (Tipo_plazo) …Anexo 37. Tipo plazo	Grave

RC12 RIESGO OPERACIONAL

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
208	Tipo de Dato (Importe1)	Valida que el tipo de dato del campo Importe1 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe1= Tipo Numérico	Grave
209	Tipo de Dato (Importe2)	Valida que el tipo de dato del campo Importe2 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe2= Tipo Numérico	Grave
210	Tipo de Dato (Importe3)	Valida que el tipo de dato del campo Importe3 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe3= Tipo Numérico	Grave
211	Tipo de Dato (Importe4)	Valida que el tipo de dato del campo Importe4 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe4= Tipo Numérico	Grave
212	Tipo de Dato (Importe5)	Valida que el tipo de dato del campo Importe5 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe5= Tipo Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
213	Tipo de Dato (Importe6)	Valida que el tipo de dato del campo Importe6 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe6= Tipo Numérico	Grave
214	Tipo de Dato (Importe7)	Valida que el tipo de dato del campo Importe7 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe7= Tipo Numérico	Grave
298	Tipo de Dato (Importe1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe1) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe1) = (15,3)	Grave
299	Tipo de Dato (Importe2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe2) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe2) = (15,3)	Grave
300	Tipo de Dato (Importe3)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe3) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe3) = (15,3)	Grave
301	Tipo de Dato (Importe4)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe4) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe4) = (15,3)	Grave
302	Tipo de Dato (Importe5)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe5) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe5) = (15,3)	Grave
303	Tipo de Dato (Importe6)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe6) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe6) = (15,3)	Grave
304	Tipo de Dato (Importe7)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe7) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe7) = (15,3)	Grave
364	Valida Conceptos que DEBEN ser reportados por institución	Valida que el concepto debe ser reportado por la institución ***Algoritmo***: 121600	Grave
397	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe1)	Grave
398	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe2)	Grave
399	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe3) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe3)	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
400	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe4) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe4)	Grave
401	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe5) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe5)	Grave
402	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe6) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe6)	Grave
403	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe7) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe7)	Grave
466	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe1) >=0	Grave
467	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe2) >=0	Grave
468	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe3) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe3) >=0	Grave
469	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe4) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe4) >=0	Grave
470	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe5) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe5) >=0	Grave
471	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe6) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe6) >=0	Grave
472	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe7) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe7) >=0	Grave
535	Tipo de Dato (Importe8)	Valida que el tipo de dato del campo Importe8 sea Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Importe8= Tipo Numérico	
536	Tipo de Dato (Importe9)	Valida que el tipo de dato del campo Importe9 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe9= Tipo Numérico	Grave
537	Tipo de Dato (Importe8)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe8) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe8) = (15,3)	Grave
538	Tipo de Dato (Importe9)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe9) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe9) = (15,3)	Grave
539	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe8) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe8)	Grave
540	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe9) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe9)	Grave
541	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe8) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe8) >=0	Grave
542	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe9) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe9) >=0	Grave
544	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 el valor sea reportado en la columna Importe1 ***Algoritmo***: Si concepto= 121910 entonces Importe1 <>" "	Grave
545	Validación individual por Concepto	Valida que los únicos datos de entrada permitidos sean 1000 o 2000 ***Algoritmo***: Si Concepto= 121910 entonces Importe1= 1000 o Importe1= 2000	Grave
546	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe2) sea nulo o cero ***Algoritmo***: Si concepto= 121910 entonces (Importe2) = null or 0	Grave
547	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe3) sea nulo o cero ***Algoritmo***:	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Si concepto= 121910 entonces (Importe3) = null or 0	
548	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe4) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe4) = null or 0	Grave
549	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe5) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe5) = null or 0	Grave
550	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe6) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe6) = null or 0	Grave
551	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe7) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe7) = null or 0	Grave
552	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe8) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe8) = null or 0	Grave
553	Validación individual por Concepto	Valida que para el concepto 121910 Campo (Importe9) sea nulo o cero ***Algoritmo*:** Si concepto= 121910 entonces (Importe9) = null or 0	Grave

USO LIMITADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
555	Tipo de Dato (Importe1)	Valida que el tipo de dato del campo Importe1 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe1= Tipo Numérico	Grave
556	Tipo de Dato (Importe2)	Valida que el tipo de dato del campo Importe2 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe2= Tipo Numérico	Grave
557	Tipo de Dato (Importe1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe1) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe1) = (15,3)	Grave
558	Tipo de Dato (Importe2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe2) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe2) = (15,3)	Grave
559	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe1)	Grave
560	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Importe2)	Grave
561	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe1) sea no Negativo, con excepción para los conceptos (123020,123030,123040,123050,123060,123070,125020, 125030, 125040, 125050, 125060, 125070, 122370, 122330, 124370, 124330, 122010, 122110, 122150, 122250, 124010, 124100, 124150, 124230). Adicionalmente, para la fecha 31 de enero 2022, esto por el cambio de conceptos que se aplica en dicha fecha, se tiene la excepción para los conceptos: (124650,124365,124400,124000, 124020, 124025, 124030,124040, 124045, 124050, 124060, 124070, 124080, 124090, 124120, 124130, 124140, 124160, 124170, 124180, 124190, 124200, 124210, 124220, 124250, 124260, 124300, 124310, 124320, 124340, 124350, 124355, 124360, 124385, 124380, 124390, 124410, 124420, 124430, 124440, 124450, 124460, 124470, 124480, 124490, 124500, 124510, 124520, 124530, 124540, 124550, 124560, 124570, 124580, 124590, 124600, 124610, 124620, 124630, 124660, 124670, 124680, 124690, 124730, 124800, 124820, 124830, 124840, 124850,	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		124860, 124870, 124900, 124910, 124920, 125010), cabe mencionar que para los conceptos 124370, 124330 por aclaración de CNBV, no aplicarán como excepción a partir de 28 de febrero 2022. Los conceptos 122370 y 122330 aplican como excepción hasta 31 de diciembre 2022. ***Algoritmo*:** (Importe1) >=0	
562	Valida conceptos que deben ser reportados por institución	Valida que el concepto sea reportado por la institución ***Algoritmo*:** 123090 y 123120	Grave
563	Validación Individual por Concepto	Valida que la clave enviada por la institución pertenezca al ANEXO 20 METODOS RIESGO OPERACIONAL POR INSTITUCIÓN ***Algoritmo*:** Si concepto= 123090 entonces Importe1 = valores indicados en el Inventario de Catálogos	Grave
564	Validación Individual por Concepto	Valida que la clave enviada por la institución pertenezca al ANEXO 21 MÉTODOS Y GRADUALIDADES ***Algoritmo*:** Si Concepto= 123120 entonces Importe1= valores indicados en el Inventario de Catálogo	Grave
605	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Inst, Fecha, Concepto), no se repita el registro. ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Institución, Fecha, Concepto], sean iguales dos o más registros	Grave
607	Validación individual del Campo	Valida que en el Campo (Concepto) reporten las claves adecuadas ***Algoritmo*:** Claves del campo Concepto a que corresponde la información sea conforme al “Catálogo de Conceptos" vigentes a la fecha de envío	Grave
753	Validación de conceptos que no deben ser reportados	Valida que el concepto no sea reportado por: Banca Múltiple, Sofoles, Sofomers, Filiales de Bancos (es decir, solo puede ser reportado por Banca de Desarrollo). ***Algoritmo:*** 122985 y 124985	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
754	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe2) sea igual a cero. ***Algoritmo***: (Importe2) =0	Grave

RC13 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO GARANTÍAS REALES, PERSONALES RECIBIDAS Y DERIVADOS DE CRÉDITO COMO COMPRADOR DE PROTECCIÓN

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
555	**Validación de Conceptos que pueden ser Reportados**	**Valida que los conceptos 132032 y 132033 enviados por la institución se encuentren dentro del periodo de vigencia de dichos conceptos.** ***Algoritmo***: ***De sección RC13, NO se permiten los conceptos 132032, 132033 antes de 31/10/2018***	**Grave**

RC14 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO BAJO EL ENFOQUE DE MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
13	Tipo de Dato (TipoC)	Valida que el tipo de dato del campo TipoC sea Carácter ***Algoritmo***: TipoC= Tipo Carácter	Grave
14	Tipo de Dato (Subclase)	Valida que el tipo de dato del campo Subclase sea Carácter ***Algoritmo***: Subclase= Tipo Carácter	Grave
15	Tipo de Dato (Etiq1)	Valida que el tipo de dato del campo Etiq1 sea Carácter ***Algoritmo***: Etiq1= Tipo Carácter	Grave
16	Tipo de Dato (GPrelacion)	Valida que el tipo de dato del campo GPrelacion sea Carácter ***Algoritmo***: GPrelacion = Tipo Carácter	Grave
17	Tipo de Dato (IdSegmento)	Valida que el tipo de dato del campo IdSegmento sea Carácter	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: IdSegmento= Tipo Carácter	
18	Tipo de Dato (Nsegmento)	Valida que el tipo de dato del campo Nsegmento sea Carácter ***Algoritmo***: Nsegmento= Tipo Carácter	Grave
19	Tipo de Dato (Importe1)	Valida que el tipo de dato del campo Importe1 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe1= Tipo Numérico	Grave
20	Tipo de Dato (Importe2)	Valida que el tipo de dato del campo Importe2 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe2= Tipo Numérico	Grave
21	Tipo de Dato (Importe3)	Valida que el tipo de dato del campo Importe3 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe3= Tipo Numérico	Grave
22	Tipo de Dato (Etiq2)	Valida que el tipo de dato del campo Etiq2 sea Carácter ***Algoritmo***: Etiq2= Tipo Carácter	Grave
23	Tipo de Dato (Importe4)	Valida que el tipo de dato del campo Importe4 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe4= Tipo Numérico	Grave
24	Tipo de Dato (xCien1)	Valida que el tipo de dato del campo xCien1 sea Numérico ***Algoritmo***: xCien1= Tipo Numérico	Grave
25	Tipo de Dato (xCien2)	Valida que el tipo de dato del campo xCien2 sea Numérico ***Algoritmo***: xCien2= Tipo Numérico	Grave
26	Tipo de Dato (Factor)	Valida que el tipo de dato del campo Factor sea Numérico ***Algoritmo***: Factor= Tipo Numérico	Grave
27	Tipo de Dato (Plazo)	Valida que el tipo de dato del campo Plazo sea Numérico ***Algoritmo***: Plazo= Tipo Numérico	Grave
28	Tipo de Dato (NumOpe)	Valida que el tipo de dato del campo NumOpe sea Numérico ***Algoritmo***: NumOpe= Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
29	Tipo de Dato (Importe5)	Valida que el tipo de dato del campo Importe5 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe5= Tipo Numérico	Grave
30	Tipo de Dato (Importe6)	Valida que el tipo de dato del campo Importe6 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe6= Tipo Numérico	Grave
31	Tipo de Dato (Importe7)	Valida que el tipo de dato del campo Importe7 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe7= Tipo Numérico	Grave
32	Tipo de Dato (Importe8)	Valida que el tipo de dato del campo Importe8 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe8= Tipo Numérico	Grave
33	Tipo de Dato (xCien3)	Valida que el tipo de dato del campo xCien3 sea Numérico ***Algoritmo*:** xCien3= Tipo Numérico	Grave
34	Tipo de Dato (Importe9)	Valida que el tipo de dato del campo Importe9 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe9= Tipo Numérico	Grave
35	Tipo de Dato (Importe10)	Valida que el tipo de dato del campo Importe10 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe10= Tipo Numérico	Grave
36	Tipo de Dato (Importe11)	Valida que el tipo de dato del campo Importe11 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe11= Tipo Numérico	Grave
37	Tipo de Dato (xCien4)	Valida que el tipo de dato del campo xCien4 sea Numérico ***Algoritmo*:** xCien4= Tipo Numérico	Grave
38	Tipo de Dato (xCien5)	Valida que el tipo de dato del campo xCien5 sea Numérico ***Algoritmo*:** xCien5= Tipo Numérico	Grave
39	Tipo de Dato (Importe12)	Valida que el tipo de dato del campo Importe12 sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe12= Tipo Numérico	Grave
40	Tipo de Dato (Importe13)	Valida que el tipo de dato del campo Importe13 sea Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Importe13= Tipo Numérico	
41	Tipo de Dato (xCien6)	Valida que el tipo de dato del campo xCien6 sea Numérico ***Algoritmo***: xCien6= Tipo Numérico	Grave
42	Tipo de Dato (xCien7)	Valida que el tipo de dato del campo xCien7 sea Numérico ***Algoritmo***: xCien7= Tipo Numérico	Grave
43	Tipo de Dato (XCien8)	Valida que el tipo de dato del campo XCien8 sea Numérico ***Algoritmo***: XCien8= Tipo Numérico	Grave
44	Tipo de Dato (Importe14)	Valida que el tipo de dato del campo Importe14 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe14= Tipo Numérico	Grave
45	Tipo de Dato (Importe15)	Valida que el tipo de dato del campo Importe15 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe15= Tipo Numérico	Grave
46	Tipo de Dato (xCien9)	Valida que el tipo de dato del campo xCien9 sea Numérico ***Algoritmo***: xCien9= Tipo Numérico	Grave
47	Tipo de Dato (Importe16)	Valida que el tipo de dato del campo Importe16 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe16= Tipo Numérico	Grave
48	Tipo de Dato (Importe17)	Valida que el tipo de dato del campo Importe17 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe17= Tipo Numérico	Grave
49	Tipo de Dato (Importe18)	Valida que el tipo de dato del campo Importe18 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe18= Tipo Numérico	Grave
50	Tipo de Dato (Importe19)	Valida que el tipo de dato del campo Importe19 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe19= Tipo Numérico	Grave
51	Tipo de Dato (Importe20)	Valida que el tipo de dato del campo Importe20 sea Numérico ***Algoritmo***: Importe20= Tipo Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
59	Tipo de Dato (TipoC)	Valida la Longitud/Precisión del campo (TipoC) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (TipoC) = (6)	Grave
60	Tipo de Dato (Subclase)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Subclase) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (Subclase) = (6)	Grave
61	Tipo de Dato (Etiq1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Etiq1) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (Etiq1) = (2)	Grave
62	Tipo de Dato (GPrelacion)	Valida la Longitud/Precisión del campo (GPrelacion) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (GPrelacion) = (2)	Grave
63	Tipo de Dato (IdSegmento)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IdSegmento) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (IdSegmento) = (20)	Grave
64	Tipo de Dato (Nsegmento)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Nsegmento) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (NSegmento) = (250)	Grave
65	Tipo de Dato (Importe1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe1) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe1) = (15,3)	Grave
66	Tipo de Dato (Importe2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe2) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe2) = (15,3)	Grave
67	Tipo de Dato (Importe3)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe3) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe3) = (15,3)	Grave
68	Tipo de Dato (Etiq2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Etiq2) ***Algoritmo*:** Longitud del campo (Etiq2) = (2)	Grave
69	Tipo de Dato (Importe4)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe4) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe4) = (15,3)	Grave
70	Tipo de Dato (xCien1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien1) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (xCien1) = (5,2)	Grave
71	Tipo de Dato (xCien2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien2) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (xCien2) = (5,2)	Grave
72	Tipo de Dato (Factor)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Factor) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Factor) = (5,2)	Grave
73	Tipo de Dato (Plazo)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Plazo) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/Precisión del campo (Plazo) = (5,2)	
74	Tipo de Dato (NumOpe)	Valida la Longitud/Precisión del campo (NumOpe) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (NumOpe) = (15,3)	Grave
75	Tipo de Dato (Importe5)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe5) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe5) = (15,3)	Grave
76	Tipo de Dato (Importe6)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe6) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe6) = (15,3)	Grave
77	Tipo de Dato (Importe7)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe7) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe7) = (15,3)	Grave
78	Tipo de Dato (Importe8)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe8) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe8) = (15,3)	Grave
79	Tipo de Dato (xCien3)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien3) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (xCien3) = (5,2)	Grave
80	Tipo de Dato (Importe9)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe9) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe9) = (15,3)	Grave
81	Tipo de Dato (Importe10)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe10) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe10) = (15,3)	Grave
82	Tipo de Dato (Importe11)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe11) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe11) = (15,3)	Grave
83	Tipo de Dato (xCien4)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien4) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (xCien4) = (5,2)	Grave
84	Tipo de Dato (xCien5)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien5) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (xCien5) = (5,2)	Grave
85	Tipo de Dato (Importe12)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe12) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe12) = (15,3)	Grave
86	Tipo de Dato (Importe13)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe13) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe13) = (15,3)	Grave
87	Tipo de Dato (xCien6)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien6) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (xCien6) = (5,2)	Grave
88	Tipo de Dato (xCien7)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien7) ***Algoritmo***:	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/Precisión del campo (xCien7) = (5,2)	
89	Tipo de Dato (XCien8)	Valida la Longitud/Precisión del campo (XCien8) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (XCien8) = (5,2)	Grave
90	Tipo de Dato (Importe14)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe14) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe14) = (15,3)	Grave
91	Tipo de Dato (Importe15)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe15) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe15) = (15,3)	Grave
92	Tipo de Dato (xCien9)	Valida la Longitud/Precisión del campo (xCien9) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (xCien9) = (5,2)	Grave
93	Tipo de Dato (Importe16)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe16) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe16) = (15,3)	Grave
94	Tipo de Dato (Importe17)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe17) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe17) = (15,3)	Grave
95	Tipo de Dato (Importe18)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe18) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe18) = (15,3)	Grave
96	Tipo de Dato (Importe19)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe19) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe19) = (15,3)	Grave
97	Tipo de Dato (Importe20)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe20) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Importe20) = (15,3)	Grave
102	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Fecha, Institución, Tipo C, Subclase, Etiq1, GPrelación, IdSegmento y Etiq2), no se repita el registro. ***Algoritmo***: Fecha, Institución, Tipo C, Subclase, Etiq1, GPrelación , IdSegmento y Etiq2	Grave
116	Valida que la Sección No sea reportada por la institución	Valida que la sección RC14 solo sea reportada por Instituciones que cuenten con autorización de la CNBV. ***Algoritmo***: RC14=clave de instituciones con autorización por CNBV	Grave
117	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Etiq1 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Etiq1)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
118	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Etiq2 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Etiq2)	Grave
119	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Fecha sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Fecha)	Grave
120	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Plazo sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Plazo)	Grave
121	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo TipoC sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (TipoC)	Grave
122	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Factor sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Factor)	Grave
123	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo NumOpe sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (NumOpe)	Grave
124	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien1 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (XCien1)	Grave
125	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien2 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (XCien2)	Grave
126	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien3 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (XCien3)	Grave
127	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien4 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (XCien4)	Grave
128	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien5 sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (XCien5)	Grave
129	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien6 sea diferente de Nulo	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Not Null (XCien6)	
130	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien7 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (XCien7)	Grave
131	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien8 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (XCien8)	Grave
132	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo XCien9 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (XCien9)	Grave
133	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe1 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe1)	Grave
134	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe2 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe2)	Grave
135	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe3 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe3)	Grave
136	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe4 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe4)	Grave
137	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe5 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe5)	Grave
138	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe6 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe6)	Grave
139	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe7 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe7)	Grave
140	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe8 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe8)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
141	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe9 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe9)	Grave
142	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Subclase sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Subclase)	Grave
144	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe10 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe10)	Grave
145	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe11 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe11)	Grave
146	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe12 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe12)	Grave
147	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe13 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe13)	Grave
148	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe14 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe14)	Grave
149	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe15 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe15)	Grave
150	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe16 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe16)	Grave
151	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe17 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe17)	Grave
152	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe18 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe18)	Grave
153	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe19 sea diferente de Nulo	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: Not Null (Importe19)	
154	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo Importe20 sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe20)	Grave
158	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo NSegmento sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (NSegmento)	Grave
159	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo GPrelacion sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (GPrelacion)	Grave
160	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo IdSegmento sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (IdSegmento)	Grave
161	Validación Individual del Campo	Valida que el campo NumOpe sea Diferente de cero ***Algoritmo***: NumOpe<>0	Grave
162	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Plazo) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Plazo) >=0	Grave
163	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Factor) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Factor) >=0	Grave
164	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (NumOpe) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (NumOpe) >=0	Grave
165	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien1) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien1) >=0	Grave
166	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien2) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien2) >=0	Grave
167	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien3) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien3) >=0	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
168	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien4) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien4) >=0	Grave
169	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien5) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien5) >=0	Grave
170	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien6) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien6) >=0	Grave
171	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien7) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien7) >=0	Grave
172	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien8) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien8) >=0	Grave
173	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (XCien9) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (XCien9) >=0	Grave
174	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe5) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe5) >=0	Grave
175	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe6) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe6) >=0	Grave
176	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe7) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe7) >=0	Grave
177	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe8) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe8) >=0	Grave
178	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe9) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe9) >=0	Grave
180	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe10) sea Mayor o igual a cero	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: (Importe10) >=0	
181	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe11) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe11) >=0	Grave
182	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe12) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe12) >=0	Grave
183	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe13) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe13) >=0	Grave
184	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe14) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe14) >=0	Grave
185	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe15) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe15) >=0	Grave
186	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe16) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe16) >=0	Grave
187	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe17) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe17) >=0	Grave
188	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe18) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe18) >=0	Grave
189	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe19) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe19) >=0	Grave
190	Validación Individual del Campo	Valida que el campo (Importe20) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Importe20) >=0	Grave
194	Validación de Conceptos que pueden ser Reportados	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de tipo de cartera ***Algoritmo***:	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Campo (TipoC) Catálogo Tipo de Cartera	
195	Validación de Conceptos que pueden ser Reportados	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de tipo de cartera ***Algoritmo*:** Campo(Subclase) Catálogo de subclase de cartera	Grave

RC15_SECCIÓN A, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR ACREDITADO/ACREDITADA, CONTRAPARTE Y ENTIDAD EMISORA DE PERSONAS RELACIONADAS (RELEVANTES Y NO RELEVANTES)

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
198	Unicidad de registro	Valida que bajo la unicidad del registro. ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Institución, Fecha, CPersonaRel, Clase, Moneda, TipoOpB, FechaC , Grado, Grupo de Riesgo Tmercado,IDOperacio,IDCompensa,Plazo remanente, TipoTrat,Periodo_cred,Situacion,Etiq_Periodo_Paralelo], no sean iguales dos o más registros	Grave
255	Tipo de Dato (CPersonaRel)	Valida que el tipo de dato del campo CPersonaRel sea Alfanumérico ***Algoritmo*:** CPersonaRel=Tipo Alfanumérico	Grave
256	Tipo de Dato (Clase)	Valida que el tipo de dato del campo Clase sea Numérico ***Algoritmo*:** Clase=Tipo Numérico	Grave
257	Tipo de Dato (Moneda)	Valida que el tipo de dato del campo Moneda sea Numérico ***Algoritmo*:** Moneda=Tipo Numérico	Grave
258	Tipo de Dato (Importe)	Valida que el tipo de dato del campo Importe sea Numérico ***Algoritmo*:** Importe=Tipo Numérico	Grave
259	Tipo de Dato (ImportePO)	Valida que el tipo de dato del campo ImportePO sea Numérico ***Algoritmo*:** ImportePO=Tipo Numérico	Grave
260	Tipo de Dato (TipoOpB)	Valida que el tipo de dato del campo TipoOpB sea Numérico ***Algoritmo*:** TipoOpB=Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
261	Tipo de Dato (FechaC)	Valida que el tipo de dato del campo FechaC sea Numérico ***Algoritmo*:** FechaC=Tipo Numérico	Grave
262	Tipo de Dato (ImporteP)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteP sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteP=Tipo Numérico	Grave
263	Tipo de Dato (ImporteN)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteN sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteN=Tipo Numérico	Grave
264	Tipo de Dato (GRiesgo)	Valida que el tipo de dato del campo GRiesgo sea Numérico ***Algoritmo*:** GRiesgo=Tipo Numérico	Grave
265	Tipo de Dato (Grado)	Valida que el tipo de dato del campo Grado sea Numérico ***Algoritmo*:** Grado=Tipo Numérico	Grave
266	Tipo de Dato (PlazoCalif)	Valida que el tipo de dato del campo PlazoCalif sea Numérico ***Algoritmo*:** PlazoCalif=Tipo Numérico	Grave
267	Tipo de Dato (Garantia)	Valida que el tipo de dato del campo Garantia sea Numérico ***Algoritmo*:** Garantia=Tipo Numérico	Grave
268	Tipo de Dato (Aval)	Valida que el tipo de dato del campo Aval sea Numérico ***Algoritmo*:** Aval=Tipo Numérico	Grave
269	Tipo de Dato (Reserva)	Valida que el tipo de dato del campo Reserva sea Numérico ***Algoritmo*:** Reserva=Tipo Numérico	Grave
270	Tipo de Dato (ImporteRC1)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteRC1sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteRC1=Tipo Numérico	Grave
271	Tipo de Dato (ImporteRC2)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteRC2 sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteRC2=Tipo Numérico	Grave
272	Tipo de Dato (ImporteRC3)	Valida que el tipo de dato del campo ImporteRC3 sea Numérico ***Algoritmo*:** ImporteRC3=Tipo Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
273	Tipo de Dato (Tmercado)	Valida que el tipo de dato del campo Tmercado sea Numérico ***Algoritmo*:** Tmercado=Tipo Numérico	Grave
274	Tipo de Dato (IDOperacio)	Valida que el tipo de dato del campo IDOperacio sea Carácter ***Algoritmo*:** IDOperacio=Tipo Carácter	Grave
275	Tipo de Dato (IDCompensa)	Valida que el tipo de dato del campo IDCompensa sea Carácter ***Algoritmo*:** IDCompensa=Tipo Carácter	Grave
276	Tipo de Dato (Plazo remanente)	Valida que el tipo de dato del campo Plazo remanente sea Numérico ***Algoritmo*:** Plazo remanente=Tipo Numérico	Grave
277	Tipo de Dato (NocionalE)	Valida que el tipo de dato del campo NocionalE sea Numérico ***Algoritmo*:** NocionalE=Tipo Numérico	Grave
278	Tipo de Dato (IdGarantia)	Valida que el tipo de dato del campo IdGarantia sea Carácter ***Algoritmo*:** IdGarantia=Tipo Carácter	Grave
279	Tipo de Dato (Valor añadido)	Valida que el tipo de dato del campo Valor añadido sea Numérico ***Algoritmo*:** Valor añadido=Tipo Numérico	Grave
335	Tipo de Dato (CPersonaRel)	Valida la Longitud/Precisión del campo (CPersonaRel) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (CPersonaRel) = (18)	Grave
336	Tipo de Dato (Importe)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Importe) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (Importe) = (13/3)	Grave
337	Tipo de Dato (ImportePO)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImportePO) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (ImportePO) = (13/3)	Grave
338	Tipo de Dato (ImporteP)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteP) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (ImporteP) = (12,3)	Grave
339	Tipo de Dato (ImporteN)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteN) ***Algoritmo*:** Longitud/Precisión del campo (ImporteN) = (12,3)	Grave
340	Tipo de Dato (Garantia)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Garantia) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Longitud/Precisión del campo (Garantia) = (12,3)	
341	Tipo de Dato (Aval)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Aval) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Aval) = (12,3)	Grave
342	Tipo de Dato (Reserva)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Reserva) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Reserva) = (12,3)	Grave
343	Tipo de Dato (ImporteRC1)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteRC1) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ImporteRC1) = (12,3)	Grave
344	Tipo de Dato (ImporteRC2)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteRC2) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ImporteRC2) = (12,3)	Grave
345	Tipo de Dato (ImporteRC3)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ImporteRC3) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ImporteRC3) = (12,3)	Grave
346	Tipo de Dato (IDOperacio)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IDOperacio) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (IDOperacio) = (4)	Grave
347	Tipo de Dato (IDCompensa)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IDCompensa) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (IDCompensa) = (4)	Grave
348	Tipo de Dato (Plazo remanente)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Plazo remanente) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Plazo remanente) = (1)	Grave
349	Tipo de Dato (NocionalE)	Valida la Longitud/Precisión del campo (NocionalE) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (NocionalE) = (12,3)	Grave
350	Tipo de Dato (IdGarantia)	Valida la Longitud/Precisión del campo (IdGarantia) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (IdGarantia) = (20)	Grave
351	Tipo de Dato (Valor añadido)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Valor añadido) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Valor añadido) = (12,3)	Grave
380	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A8. Clase de operación ***Algoritmo***: Campo (Clase) A8. Clase de operación	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
381	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A9. Catálogo de Moneda ***Algoritmo***: Campo (Moneda)...A9. Catálogo de Moneda	Grave
382	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A1.Catálogo Tipo Operación en Balance ***Algoritmo***: Campo (TipoOpB) A1. Catálogo Tipo Operación en Balance	Grave
383	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A7 Indicador de Fecha de concertación ***Algoritmo***: Campo(FechaC) A7 Catálogo Indicador de Fecha de concertación	Grave
384	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A3. Grupo de Riesgo ***Algoritmo***: Campo (GRiesgo)...A3. Grupo de Riesgo	Grave
385	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A4. Grado de Riesgo ***Algoritmo***: Campo (Grado)... A4. Grado de Riesgo	Grave
386	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A5. Plazo de la Calificación ***Algoritmo***: Campo (PlazoCalif)...A5. Plazo de la Calificación	Grave
387	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A6. Tipo de mercado y su cámara de compensación ***Algoritmo***: Campo (Tmercado)... A6. Tipo de mercado y su cámara de compensación	Grave
433	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (CPersonaRel) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (CPersonaRel)	Grave
434	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Importe)	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
435	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImportePO) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImportePO)	Grave
436	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteP) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteP)	Grave
437	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteN) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteN)	Grave
438	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Garantia) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Garantia)	Grave
439	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Aval) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Aval)	Grave
440	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Reserva) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (Reserva)	Grave
441	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC1) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteRC1)	Grave
442	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC2) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteRC2)	Grave
443	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC3) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (ImporteRC3)	Grave
444	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IDOperacio) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (IDOperacio)	Grave
445	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IDCompensa) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***: Not Null (IDCompensa)	Grave
446	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Plazo remanente) sea diferente de Nulo ***Algoritmo***:	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Not Null (Plazo remanente)	
447	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NocionalE) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (NocionalE)	Grave
448	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (IdGarantia) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (IdGarantia)	Grave
449	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Valor añadido) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Valor añadido)	Grave
505	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Clase) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Clase) >=0	Grave
506	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Moneda) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Moneda) >=0	Grave
507	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Importe) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Importe) >=0	Grave
508	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImportePO) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImportePO) >=0	Grave
509	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (TipoOpB) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (TipoOpB) >=0	Grave
510	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (FechaC) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (FechaC) >=0	Grave
511	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteP) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImporteP) >=0	Grave
512	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteN) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImporteN) >=0	Grave
513	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GRiesgo) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		(GRiesgo) >=0	
514	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Grado) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Grado) >=0	Grave
515	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (PlazoCalif) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (PlazoCalif) >=0	Grave
516	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Garantia) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Garantia) >=0	Grave
517	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Aval) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Aval) >=0	Grave
518	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Reserva) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Reserva) >=0	Grave
519	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC1) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImporteRC1) >=0	Grave
520	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC2) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImporteRC2) >=0	Grave
521	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ImporteRC3) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (ImporteRC3) >=0	Grave
522	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Tmercado) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Tmercado) >=0	Grave
523	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Plazo remanente) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (Plazo remanente) >=0	Grave
524	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (NocionalE) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** (NocionalE) >=0	Grave
525	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Valor añadido) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		(Valor añadido) >=0	
621	Tipo de Dato (TipoTrat)	Valida el tipo de dato del campo ***Algoritmo***: TipoTrat=Tipo Numérico	Grave
622	Tipo de Dato (Periodo_cred)	Valida el tipo de dato del campo ***Algoritmo***: Periodo_cred=Tipo Numérico	Grave
623	Tipo de Dato (Situacion)	Valida el tipo de dato del campo ***Algoritmo***: Situación=Tipo Numérico	Grave
624	Longitud (Periodo_cred)	Valida la longitud y precisión del campo ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Periodo_cred) = (6/0)	Grave
625	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que la clave enviada por la institución en el Campo(TipoFCC) .ANEXO 23 TIPO DE TRATAMIENTO	Grave
626	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que la clave enviada por la institución en el Campo(Situacion) .ANEXO 24 SITUACIÓN DEL CRÉDITO	Grave
627	Tipo de dato (Etiq_Periodo_Paralelo)	***Algoritmo***: Etiq_Periodo_Paralelo=Tipo Numérico	Grave
628	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que la clave enviada por la institución en el Campo(Etiq_Periodo_Paralelo) pertenezca al .ANEXO 26 Bandera que indica si la cartera se encuentra bajo metodologías internas dentro de un en periodo en paralelo de cálculo.	Grave

RC15 SECCIÓN B, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA DE OPERACIONES RELACIONADAS

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
280	Tipo de Dato (Contraparte)	Valida que el tipo de dato del campo Contraparte sea Carácter ***Algoritmo***: Contraparte=Tipo Carácter	Grave
281	Tipo de Dato (GradRiesgoCont)	Valida que el tipo de dato del campo GradRiesgoCont sea Numérico ***Algoritmo***: GradRiesgoCont=Tipo Numérico	Grave
282	Tipo de Dato (PondInd)	Valida que el tipo de dato del campo PondInd sea Numérico ***Algoritmo***: PondInd=Tipo Numérico	Grave
283	Tipo de Dato (ExposicionC)	Valida que el tipo de dato del campo ExposicionC sea Numérico ***Algoritmo***: ExposicionC=Tipo Numérico	Grave
284	Tipo de Dato (Ndcont)	Valida que el tipo de dato del campo Ndcont sea Numérico ***Algoritmo***: Ndcont=Tipo Numérico	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
285	Tipo de Dato (Ndind)	Valida que el tipo de dato del campo Ndind sea Numérico ***Algoritmo***: Ndind=Tipo Numérico	Grave
286	Tipo de Dato (Mcont)	Valida que el tipo de dato del campo Mcont sea Numérico ***Algoritmo***: Mcont=Tipo Numérico	Grave
287	Tipo de Dato (Mcob)	Valida que el tipo de dato del campo Mcob sea Numérico ***Algoritmo***: Mcob=Tipo Numérico	Grave
288	Tipo de Dato (Mind)	Valida que el tipo de dato del campo Mind sea Numérico ***Algoritmo***: Mind=Tipo Numérico	Grave
352	Tipo de Dato (PondInd)	Valida la Longitud/Precisión del campo (PondInd) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (PondInd) = (6/3)	Grave
	Tipo de Dato (ExposicionC)	Valida la Longitud/Precisión del campo (ExposicionC) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (ExposicionC) = (12,3)	Grave
354	Tipo de Dato (Ndcont)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Ndcont) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Ndcont) = (12,3)	Grave
355	Tipo de Dato (Ndind)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Ndind) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Ndind) = (12,3)	Grave
356	Tipo de Dato (Mcont)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mcont) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Mcont) = (5/2)	Grave
357	Tipo de Dato (Mcob)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mcob) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Mcob) = (5/2)	Grave
358	Tipo de Dato (Mind)	Valida la Longitud/Precisión del campo (Mind) ***Algoritmo***: Longitud/Precisión del campo (Mind) = (5/2)	Grave
367	Validación Individual del Campo	Valida que el campo ExposicionC sea Diferente de cero ***Algoritmo***: ExposicionC<>0	Grave
368	Validación Individual del Campo	Valida que el campo Mcont sea Diferente de cero ***Algoritmo***: Mcont<>0	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
369	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (Institución, Fecha, Contraparte), no se repita el registro. ***Algoritmo*:** Bajo la Llave: [Institución, Fecha, Contraparte], sean iguales dos o más registros	Grave
388	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores. ***Algoritmo*:** Campo(Contraparte) pertenezca Catálogo de la contraparte del formulario de Derivados y de Valores	Grave
389	Validación de pertenencia a catálogo	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo A4. Grado de Riesgo ***Algoritmo*:** Campo (GradRiesgoCont) pertenezca al catálogo A4. Grado de Riesgo	Grave
450	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (PondInd) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (PondInd)	Grave
451	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (ExposicionC) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (ExposicionC)	Grave
452	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndcont) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Ndcont)	Grave
453	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndind) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Ndind)	Grave
454	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcont) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Mcont)	Grave
455	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcob) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Mcob)	Grave
456	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mind) sea diferente de Nulo ***Algoritmo*:** Not Null (Mind)	Grave
526	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (GradRiesgoCont) sea Mayor o igual a cero	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Algoritmo: (GradRiesgoCont) >=0	
527	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndcont) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Ndcont) >=0	Grave
528	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Ndind) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Ndind) >=0	Grave
529	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcont) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mcont) >=0	Grave
530	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mcob) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mcob) >=0	Grave
531	Validación Individual del Campo	Valida que el Campo (Mind) sea Mayor o igual a cero ***Algoritmo***: (Mind) >=0	Grave

RC21 RELATIVA A LOS INSTRUMENTOS DE CAPITAL ELEGIBLES PARA COMPUTAR EL CAPITAL NETO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
715	Tipo de dato (Fecha_corte)	Fecha_corte= Tipo Fecha	Grave
716	Tipo de dato (Fecha_amortizacion)	Fecha_amortizacion= Tipo Fecha	Grave
717	Tipo de dato (ClaveTit)	ClaveTit= Tipo Alfanumérico	Grave
718	Tipo de dato (Emisor)	Emisor= Tipo Caractér	Grave
719	Tipo de dato (MontCircNom)	MontCircNom= Tipo Numérico	Grave
720	Tipo de dato (MontCircPes)	MontCircPes= Tipo Numérico	Grave
721	Tipo de dato (Tasa Cupón)	Tasa Cupón= Tipo Numérico	Grave
722	Tipo de dato (Pzo_residual)	Pzo_residual= Tipo Numérico	Grave
723	Tipo de dato (Nivel_capital)	Nivel_capital= Tipo Numérico	Grave
724	Tipo de dato (Valor_contable)	Valor_contable= Tipo Numérico	Grave
725	Tipo de dato (Monto_capital)	Monto_capital= Tipo Numérico	Grave
726	Tipo de dato (Cve_suplemento)	Cve_suplemento= Tipo Numérico	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
727	Tipo de dato (Monto_suplemento)	Monto_suplemento= Tipo Numérico	Grave
728	Tipo de dato (Activos_ajustados)	Activos_ajustados= Tipo Numérico	Grave
729	Tipo de dato (Activos_ponderados)	Activos_ponderados= Tipo Numérico	Grave
730	Tipo de dato (Cve_baja)	Cve_baja= Tipo Numérico	Grave
731	Tipo de dato (Monto_amortizacion)	Monto_amortizacion= Tipo Numérico	Grave
732	IMPORTACIÓN	DE LA SECCIÓN RC21, el Archivo de la sección […] debe cumplir con las caracterísiticas para ser importado [.xls,.csv,.txt]	Grave
733	Unicidad de registro	Bajo la Llave: (Fecha_corte, Emisor, Clavetit, Nivel_capital), sean diferentes registros	Grave
734	Validación Individual del Campo	Not Null (Fecha_corte)	Grave
735	Validación Individual del Campo	Not Null (Emisor)	Grave
736	Validación Individual del Campo	Not Null (ClaveTit)	Grave
737	Validación Individual del Campo	Not Null (MontCircNom)	Grave
738	Validación Individual del Campo	Not Null (MontCircPes)	Grave
739	Validación Individual del Campo	Not Null (Tasa Cupón)	Grave
740	Validación Individual del Campo	Not Null (Pzo_residual)	Grave
741	Validación Individual del Campo	Not Null (Nivel_capital)	Grave
742	Validación Individual del Campo	Not Null (Valor_razonable)	Grave
743	Validación Individual del Campo	Not Null (Monto_capital)	Grave
744	Validación Individual del Campo	Not Null (Cve_suplemento)	Grave
745	Validación Individual del Campo	Not Null (Monto_suplemento)	Grave
746	Validación Individual del Campo	Not Null (Activos_ajustados)	Grave
747	Validación Individual del Campo	Not Null (Activos_ponderados)	Grave
748	Validación Individual del Campo	Not Null (Cve_baja)	Grave
749	Validación Individual del Campo	Not Null (Monto_amortizacion)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
750	Validación de claves que pueden ser Reportados	Campo (Nivel_capital) ..Catálogo de Nivel de Capital	Grave
751	Validación de claves que pueden ser Reportados	Campo (Cve_suplemento) ..Catálogo de elegibilidad	Grave
752	Validación de claves que pueden ser Reportados	Campo(cve_baja) ..Catálogo de Razón de baja	Grave

USO LIMITADO

Etapa: Validaciones históricas

i. Objetivo de la validación

Verificar que la información enviada por los intermediarios financieros en las distintas secciones de RC en forma agregada sea distinta a la reportada en el mes inmediato anterior.

ii. Validaciones por sección

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC01

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
1	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
1	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC02

No. Validación	Nombre	Descripción/Algoritmo	Nivel
2	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
2	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC03

No. Validación	Nombre	Descripción/Algoritmo	Nivel
3	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. *Algoritmo*: *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
3	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información*	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior	

RC04

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
4	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
4	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
4	Validación columna: Importe 3.	Compara que la información reportada en la columna: Importe3 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe3 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe3(t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
4	Validación columna: Importe 4.	Compara que la información reportada en la columna: Importe4 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe4 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe4 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC05

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
5	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
5	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

6	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada para cada concepto de la columna: Importe 1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Concepto del Importe1 (t-1) – Concepto del Importe1 (t) ≠0. Se aplica a todos los conceptos distintos de 53050, 53100, 53150, 53200, 53250, 53300, 54050 y 54100 (Vigencia de conceptos hasta octubre 2015* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC07

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
8	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
8	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC08

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
9	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. *Algoritmo*: *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0*	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		En donde: *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	

RC09

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
10	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
17	Validación columna Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe 2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	No Grave
18	Validación Suma Conceptos Capital Contribuido menos la sumatoria de Capital Ganado	Compara que la sumatoria de conceptos de Capital Contribuido menos la sumatoria de Capital Ganado en la columna Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos 95005, 95010, 95015, 95020, 95025, 95030, 95035 – Suma de todos los conceptos de 95045,95050,95055,95060,95065,95066,95068 de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de 95005, 95010, 95015, 95020, 95025, 95030, 95035 – Suma de todos los conceptos de 95045,95050,95055,95060,95065,95066,95068 de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información*	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior	

RC10

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
12	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC11

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
13	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
13	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:**	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0 *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	

RC12

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
14	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 3.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe3 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe3 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 4.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior.	Grave

		***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe4 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe4 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	
14	Validación columna: Importe 5.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe5 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe5 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 6.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe6 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe6 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 7.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe7 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe7 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
14	Validación columna: Importe 8.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe8 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe8 (t) ≠0* *En donde:*	Grave

		t = Fecha de corte de la información *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	
14	Validación columna: Importe 9.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe9 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe9 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC12_IN

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
22	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de Importe1.conceptos (122010, 122150,122300) (t-1) – Suma de Importe 1. conceptos (122010, 122150,122300) (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
23	Validación columna: Importe 1	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de Importe1 Suma de conceptos (122380, 122560,122630,122820) (t-1) – Importe1 Suma de conceptos (122380, 122560,122630,122820) (t)) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

24	Validación columna: Importe 1	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de Importe1 del concepto 122330 (t-1)– Suma de Importe1 del concepto 122330 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
25	Validación columna: Importe 1	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de Importe1 del concepto 123020 (t-1)) – Suma de Importe1 del concepto 123020 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave
26	Validación columna: Importe 1	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0* *En donde:* *t = Fecha de corte de la información* *t-1= Fecha de corte de la información del mes inmediato anterior*	Grave

RC13

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
15	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0*	Grave
15	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:**	Grave

		Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0	

RC17

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
19	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 del RC17 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0*	Grave

RC18

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
20	Validación columna: Importe 1.	Compara que la información reportada en la columna: Importe1 del RC18 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe1 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe1 (t) ≠0*	
20	Validación columna: Importe 2.	Compara que la información reportada en la columna: Importe2 del RC18 a la fecha de corte no sea igual a la reportada en el mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *Suma de todos los conceptos de Importe2 (t-1) – Suma de todos los conceptos de Importe2 (t) ≠0*	Grave

Etapa: Validaciones de gradualidad RC14

i. Objetivo de la validación

Verificar el cumplimiento de restricciones normativas establecidas en la Circular Única de Bancos (CUB) de importancia para el cálculo de los Requerimientos de Capital e Índice de Capitalización.

ii. Validaciones por sección

A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC14

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
1	Porcentaje de aplicación del Método Estándar	Campo 36: Porcentaje de aplicación del Método Estándar Valida que en este campo se reporte el porcentaje de aplicación del requerimiento de riesgo de crédito del segmento o crédito determinado bajo el método estándar. Este porcentaje será de 95 por ciento para el primer año, de 90 por ciento para el segundo y del 80 por ciento para el tercer año, contados a partir de la fecha de la autorización. ***Algoritmo***: *Primer año de autorización => Campo Porcentaje de aplicación del Método Estándar 95* *Segundo año de autorización => Campo Porcentaje de aplicación del Método Estándar=90* *Tercer año de autorización => Campo Porcentaje de aplicación del Método Estándar=80*	Grave

Etapa: Validaciones al interior del Registro

i. Objetivo de la validación

Verificar la consistencia de la información al interior de cada sección del formulario cuando exista una relación directa entre los campos que la conforman.

ii. Validaciones por sección

A continuación, se listan las validaciones con su respectiva descripción para cada sección del formulario. En la siguiente sección pueden consultar las expresiones condicionales para cada validación.

RC01 RELATIVO A OPERACIONES EN MONEDA NACIONAL CON TASA DE INTERÉS NOMINAL, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Error Id Validación 1. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC01	INT_REG_1	Grave

RC02 RELATIVO A OPERACIONES CON TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL Y SOBRETASA, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
2	Error Id Validación 2. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC02	INT_REG_2	Grave

RC03 RELATIVO A OPERACIONES EN UDIS, UMA Y TASA DE INTERÉS REAL EN MONEDA NACIONAL, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
3	Error Id Validación 3. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC03	INT_REG_3	Grave

RC04 RELATIVO A OPERACIONES EN DIVISAS O INDIZADAS A TIPOS DE CAMBIO CON TASA DE INTERÉS NOMINAL EN MONEDA EXTRANJERA, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
4	Error Id Validación 4. Concepto con importe 0 en todos los campos de la sección RC04	INT_REG_4	Grave
160	Error Id Validación 160. Concepto con importe distinto de 1000 o 2000 o 3000 en el campo “Importe1” de la sección RC04	3350	Grave

RC05 RELATIVO A OPERACIONES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
5	Error Id Validación 5. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC05	INT_REG_5	Grave
158	Error Id Validación 158. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC05	3348	Grave

RC06_SECCIÓN A, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR CONTRAPARTE

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
52	Error Id Validación 52. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Tmercado no es válida.	3242	Grave
53	Error Id validación 53. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Tmercado no es válida.	3243	Grave
54	Error Id validación 54. La combinación entre el Campo Clase y el Campo (IDOperacio) no es válida.	3244	Grave
55	Error Id validación 55. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IDCompensa no es válida.	3245	Grave
56	Error Id validación 56. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IDCompensa no es válida.	3246	Grave
57	Error Id validación 57. La combinación entre el Campo Clase y el Campo PlazoCalif no es válida.	3247	Grave
58	Error Id validación 58. La combinación entre el Campo Clase y el Campo PlazoCalif no es válida.	3248	No Grave
59	Error Id validación 59. La combinación de Grupo de Riesgo IA y Plazo de Calificación no es válida	3249	Grave
60	Error Id validación 60. La combinación de Grupo de Riesgo IB y Plazo de Calificación no es válida	3250	Grave
61	Error Id validación 61. La combinación de Grupo de Riesgo II y Plazo de Calificación no es válida	3251	Grave
62	Error Id validación 62. La combinación de Grupo de Riesgo II y Plazo de Calificación no es válida	3252	Grave
63	Error Id validación 63. La combinación de Grupo de Riesgo II y Plazo de Calificación no es válida	3253	Grave
64	Error Id validación 64. La combinación de Grupo de Riesgo III y Plazo de Calificación no es válida	3254	Grave
65	Error Id validación 65. La combinación de Grupo de Riesgo III y Plazo de Calificación no es válida	3255	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
66	Error Id validación 66. La combinación de Grupo de Riesgo III y Plazo de Calificación no es válida	3256	Grave
67	Error Id validación 67. La combinación de Grupo de Riesgo IV y Plazo de Calificación no es válida	3257	Grave
68	Error Id validación 68. La combinación de Grupo de Riesgo V y Plazo de Calificación no es válida	3258	Grave
69	Error Id validación 69. La combinación de Grupo de Riesgo VI y Plazo de Calificación no es válida	3259	Grave
70	Error Id validación 70. La combinación de Grupo de Riesgo VII_A y Plazo de Calificación no es válida	3260	Grave
71	Error Id validación 71. La combinación de Grupo de Riesgo VII_A y Plazo de Calificación no es válida	3261	Grave
72	Error Id validación 72. La combinación de Grupo de Riesgo VII_A y Plazo de Calificación no es válida	3262	Grave
73	Error Id validación 73. La combinación de Grupo de Riesgo VII_By Plazo de Calificación no es válida	3263	Grave
74	Error Id validación 74. La combinación de Grupo de Riesgo VII_B y Plazo de Calificación no es válida	3264	Grave
75	Error Id validación 75. La combinación de Grupo de Riesgo VII_By Plazo de Calificación no es válida	3265	Grave
76	Error Id validación 76. La combinación de Grupo de Riesgo IX y Plazo de Calificación no es válida	3266	Grave
77	Error Id validación 77. La combinación de Grupo de Riesgo X y Plazo de Calificación no es válida	3267	Grave
78	Error Id validación 78. La combinación de Grupo de Riesgo II Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3268	Grave
79	Error Id validación 79. La combinación de Grupo de Riesgo III Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3269	Grave
80	Error Id validación 80. La combinación de Grupo de Riesgo IV Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3270	Grave
81	Error Id validación 81. La combinación de Grupo de Riesgo V Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3271	Grave
82	Error Id validación 82. La combinación de Grupo de Riesgo VI Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3272	Grave
83	Error Id validación 83. La combinación de Grupo de Riesgo VII A Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3273	Grave
84	Error Id validación 84. La combinación de Grupo de Riesgo VII B Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3274	Grave
85	Error Id validación 85. La combinación de Grupo de Riesgo IX Vencido y Plazo de Calificación no es válida	3275	Grave
86	Error Id validación 86. La combinación de Grupo de Riesgo VIII y Plazo de Calificación no es válida	3276	Grave
87	Error Id validación 87. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Plazoremanente no es válida.	3277	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
88	Error Id validación 88. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Plazoremanente no es válida.	3278	Grave
89	Error Id validación 89. La combinación entre el Campo Clase y el Campo CoeficienteSP no es válida.	3279	Grave
90	Error Id validación 90. La combinación entre el Campo Clase y el Campo CoeficienteSP no es válida.	3280	Grave
91	Error Id validación 91. La combinación entre el Campo Clase y el Campo NocionalE no es válida.	3281	Grave
92	Error Id validación 92. La combinación entre el Campo Clase y el Campo NocionalE no es válida.	3282	Grave
93	Error Id validación 93. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Valor añadido no es válida.	3283	Grave
94	Error Id validación 94. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Valor añadido no es válida.	3284	Grave
95	Error Id validación 95. Campo ImportePO debe ser igual a (ImporteA) menos (ImporteP)	3285	Grave
96	Error Id validación 96. Campo ImporteNE debe ser igual a (ImporteP) menos (ImporteA)	3286	Grave
142	Error Id validación 142. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IdGarantia no es válida.	3332	No Grave
143	Error Id Validación 143.La combinación entre el Campo Clase y el Campo IdGarantia no es válida.	3333	Grave
153	Error Id validación 153. La combinación de Grupo de Riesgo V y Plazo de Calificación no es válida	3343	Grave
154	Error Id validación 154. La combinación entre el Campo Clase, Plazo remanente y el Campo CoeficienteSP no es válida.	3344	Grave
155	Error Id validación 155. La combinación entre el Campo Clase, Plazo remanente y el Campo Valor añadido no es válida.	3345	Grave
159	Error Idvalidación 159. La combinación entre el Campo IDOperacio y el Campo Griesgo no es válida.	3349	Grave
163	Error Id Validación 163. La combinación entre el Campo (Clase = Derivados, Plazo remanente<> 1) y el Campo Valor añadido no es válida.	3365	Grave
164	Error Id Validación164. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo I no es válida.	3366	Grave
165	Error Id Validación165. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo II al 0% no es válida.	3367	Grave
166	Error Id Validación166. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo II no es válida.	3368	Grave
167	Error Id Validación167. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo III no es válida.	3369	No Grave
168	Error Id Validación168. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo IV al 0% no es válida.	3370	Grave
169	Error Id Validación169. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo IV no es válida.	3371	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
170	Error Id Validación170. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo V no es válida.	3372	Grave
171	Error Id Validación171. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo VII no es válida.	3373	No Grave
172	Error Id Validación172. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo X no es válida.	3374	Grave
548	Error Id Validación 548 El Campo Grupo de Riesgo "no es válido para esta fecha de envío	3384	Grave
550	Error Id Validación 550. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo I B no es válida.	3393	Grave
551	Error Id Validación 551. La combinación entre el Campo Contraparte y el Campo Griesgo grupo VII no es válida.	3394	Grave
552	Error Id Validación 552. El valor del campo Garantía MS y el Campo Garantía MI, es igual, posible duplicidad en el registro de la garantía	3395	Grave
553	Error Id Validación 553.(Aplica para garantía bajo MI) Si cuenta con Garantía MI el Campo ImportePO debe ser igual a (ImporteA) menos (ImporteP)	3396	Grave

RC06_SECCIÓN B, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
97	Error Id Validación 97. no hay consistencia entre el campo (Ndcont) y el campo (Mcob)	3287	Grave
98	Error Id Validación 98. no hay consistencia entre el campo (Ndcont) y el campo (Mcob)	3288	Grave
99	Error Id Validación 99. no hay consistencia entre el campo (Ndind) y el campo (Mind)	3289	Grave
100	Error Id Validación 100. no hay consistencia entre el campo (Ndind) y el campo (Mind)	3290	Grave
544	Error Id Validación 544. El Campo(GradRiesgoCont) = 17 no es válido para esta fecha de envío	3380	Grave
546	Error Id Validación 546. El Campo(GradRiesgoCont) = 17 no coincide con la contraparte Banco de México	3382	Grave
547	Error Id Validación 547. El Campo Contraparte Banco de México no coincide con el (GradRiesgoCont) = 17	3383	Grave

RC06 SECCIÓN C, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR LA EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO

Validaciones al interior del registro aplicable hasta la fecha 31/05/2022

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
101	Error Id Validación 101. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Aportacion no es válida	3291	Grave
102	Error Id Validación 102. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Aportacion no es válida	3292	Grave
103	Error Id Validación 103. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Conversion no es válida	3293	Grave
104	Error Id Validación 104. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Conversion no es válida	3294	Grave
105	Error Id Validación 105. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo CapitalT no es valida	3295	Grave
107	Error Id Validación 107. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo RecursosTot Fondo no es válida	3297	Grave
108	Error Id Validación 108. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo RecursosTot Fondo no es válida	3298	Grave
109	Error Id Validación 109. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo RecursosPropios no es válida	3299	Grave
110	Error Id Validación 110. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo RecursosPropios no es válida	3300	Grave
111	Error Id Validación 111. . La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Recursos disponibles no es válida	3301	Grave
112	Error Id Validación 112. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Recursos disponibles no es válida	3302	Grave
113	Error Id Validación 113. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo TotalAportac no es válida	3303	Grave
114	Error Id Validación 114. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo TotalAportac no es válida	3304	Grave
115	Error Id Validación 115. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo NumeroSoc no es válida	3305	Grave
116	Error Id Validación 116. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo NumeroSoc no es válida	3306	Grave
117	Error Id Validación 117. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Beta2 no es válida.	3307	Grave
118	Error Id Validación 118. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Beta2 no es válida.	3308	Grave
119	Error Id Validación 119. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Asigna no es válida.	3309	Grave
120	Error Id Validación 120. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Asigna no es válida.	3310	Grave
121	Error Id Validación 121. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo FraccSocL no es válida.	3311	Grave
122	Error Id Validación 122. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo FraccSocL no es válida.	3312	Grave

Validaciones al interior del registro aplicable desde la fecha 30/06/2022

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Error IdValidación 1. La combinación entre el campo Metodol y campo TipoCC no es válida.	3504	Grave
2	Error IdValidación 2. La combinación entre el campo Metodol y campo TipoCC no es válida.	3505	Grave
3	Error IdValidación 3. La combinación entre el campo Metodol y campo CapitalT no es válida.	3506	Grave
4	Error IdValidación 4. La combinación entre el campo Metodol y campo Recursos propios no es válida.	3507	Grave
5	Error IdValidación 5. La combinación entre el campo Metodol y campo Recursos disponibles no es válida.	3508	Grave
6	Error IdValidación 6. Concepto con importe igual a 0 en el campo “aportacion".	3509	Grave
7	Error IdValidación 7. Concepto con valor distinto de 10 o 30 en el campo “Metodol".	3510	Grave
8	Error IdValidación 8. Valores no permitidos en campo RecursosPropios o campo Recursos disponibles no es válida.	3511	Grave
9	Error IdValidación 9. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Conversion no es valida	3512	Grave
10	Error IdValidación 10. La combinación entre el Campo Metodol y el Campo Conversion no es valida	3513	Grave

RC07 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO DE LA ENTIDAD EMISORA

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
9	Error Id Validación 9. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC07	INT_REG_9	Grave

RC08 RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR DEPÓSITOS Y PRÉSTAMOS

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
10	Error Id Validación 10. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC08	3172	Grave Aplicable hasta dic 21
11	Error Id Validación 11. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe1” de la sección RC08	3173	Grave Aplicable hasta dic 21

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

12	Error Id Validación 12. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC08	INT_REG_12	Grave
22	Error Id Validación 22. Concepto con importe distinto de 1000 o 2000 0 en el campo “Importe1” de la sección RC08	3179	Grave
23	Error IdValidación 3480. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe1” de la sección RC08 cuando se trata de cartera en etapa 3	3480	Grave
24	Error IdValidación 3481. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC08 cuando se trata de conceptos distintos a cartera en etapa 3	3481	Grave

RC08_A RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO DE CARTERA DE CONSUMO, VIVIENDA Y A MIPYMES (NUEVOS, REESTRUCTURADOS O RENOVADOS AL AMPARO DEL OFICIO P418/2020 Y SU ALCANCE P430/2020 Y DE LA RESOLUCIÓN QUE MODIFICA EL ARTICULO 2 BIS 17 DE LA CUB A PARTIR DE LO PUBLICADO EN EL DOF EL 20 DE JULIO DE 2021)

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
3401	Error ID Valid3401 en el campo Griesgo<>170 si Clase=105000 sección RC08_A	3401	Grave
3402	Error ID Valid3402 en el campo Griesgo<>171 si Clase=105001 sección RC08_A	3402	Grave
3403	Error ID Valid3403 en el campo Griesgo<>172 si Clase in {105002,115040} sección RC08_A	3403	Grave
3404	Error ID Valid3404 en el campo Griesgo<>173 si Clase=105003 sección RC08_A	3404	Grave
3405	Error ID Valid3405 en el campo Griesgo<>174 si Clase in {105004,115050} sección RC08_A	3405	Grave
3406	Error ID Valid3406 en el campo Griesgo<>175 si Clase=105005 sección RC08_A	3406	Grave
3407	Error ID Valid3407 en el campo Griesgo<>176 si Clase=105006 sección RC08_A	3407	Grave
3408	Error ID Valid3408 en el campo Griesgo<>177 si Clase in {105007, 115030, 115060} sección RC08_A	3408	Grave
3409	Error ID Valid3409 en el campo Griesgo<>178 si Clase=105008 sección RC08_A	3409	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

3410	Error ID Valid3410 en el campo Griesgo<>179 si Clase=105009 sección RC08_A	3410	Grave
3412	Error ID Valid3412 en el campo Clase not in {105000, 105001, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 105008, 105009, 115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115090,115100,115105,115110,115120}	3412	Grave
3414	Error ID Valid3414 en el campo Griesgo not in { 158, 159, 170 a 180] si clase not in {115020,115090] sección RC08_A	3414	Grave
3415	Error ID Valid3415 en el campo Grado not in {10, 13, 14, 15, 16} si Griesgo=178 sección RC08_A	3415	Grave
3416	Error ID Valid3416 en el campo Grado <> 10 si Griesgo<> 178 sección RC08_A	3416	No Grave
3417	Error ID Valid3417 en el campo PlazoCalif <> 10 si Griesgo<> 178 sección RC08_A	3417	No Grave
3418	Error ID Valid3418 en el campo Importe < (Garantia_ME + Garantia_MI + Aval+ Der_Cred+ Reservas) cuando registran (Garantia_ME + Garantia_MI + Aval+ Der_Cred+ Reservas) >0 sección RC08_A	3418	Grave
3419	Confirme al revisor de su información que esta operación tiene como acreditado/acreditada a una persona relacionada.	3419	No Grave
3422	Error ID Valid3422 en el campo Griesgo<>170 si Clase in {115000, 115005, 115010, 115080} sección RC08_A	3422	Grave
3423	Error ID Valid3423 en el campo Griesgo in [170 a 179] si Clase in {115020, 115090} sección RC08_A	3423	Grave
3424	Error ID Valid3424 en el campo Griesgo<>180 si Clase=115070 sección RC08_A	3424	Grave
3425	Error ID Valid3425 en el campo Griesgo<>[158,159] si Clase in {115100, 115105, 115110, 115120} sección RC08_A	3425	Grave
3426	Error ID Valid3426 en el campo TipoTrat<>{1,2,3} si Clase=105000, 105001, 105008, 105009 sección RC08_A	3426	Grave
3427	Error ID Valid3427 en el campo TipoTrat=6,7,8 si Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007} sección RC08_A	3427	Grave

3428	Error ID Valid3428 en el campo TipoTrat<>{4,5} si Clase {115000, 115005,115010,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115100,115105,115110,115120} sección RC08_A	3428	Grave
3429	Error ID Valid3429 en el campo TipoTrat<>7 si Clase in {115020, 115090} sección RC08_A	3429	Grave
3430	Error ID Valid3430 en el campo Grado in {10, 17} si Clase=115020 sección RC08_A	3430	Grave
3431	Error ID Valid3431 en el campo CCV_promedio=0 si Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007, 115030} sección RC08_A	3431	Grave
3432	Error ID Valid3432 en el campo CCV_promedio>50 si 105002 sección RC08_A	3432	Grave
3433	Error ID Valid3433 en el campo CCV_promedio<=50 o CCv_promedio >60 si 105003 sección RC08_A	3433	Grave
3434	Error ID Valid3434 en el campo CCV_promedio<=60 o CCv_promedio >80 si 105004 sección RC08_A	3434	Grave
3435	Error ID Valid3435 en el campo CCV_promedio<=80 o CCv_promedio >90 si 105005 sección RC08_A	3435	Grave
3436	Error ID Valid3436 en el campo CCV_promedio<=90 o CCv_promedio >100 si 105006 sección RC08_A	3436	Grave
3437	Error ID Valid3437 en el campo CCV_promedio<=100 si 105007 sección RC08_A	3437	Grave
3438	Error ID Valid3438 en el campo CCV_promedio<>0 si Clase not in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007,115030} sección RC08_A	3438	Grave
3439	Error ID Valid3439 en el campo Valor_subcuenta=0 si Clase in {115040,115050,115060} sección RC08_A	3439	Grave
3440	Error ID Valid3440 en el campo Valor_vivienda=0 si Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007,115030} sección RC08_A	3440	Grave
3464	Error Id Validación 3464 en el campo Griesgo <> {172,177} si 0< CCV_promedio <= 50 sección RC08_A	3464	Grave
3465	Error Id Validación 3465 en el campo Griesgo <> {173,177} si 50 < CCV_promedio <= 60 sección RC08_A	3465	Grave

3466	Error Id Validación 3466 en el campo Griesgo <> {174,177} si 60 < CCV_promedio <= 80 sección RC08_A	3466	Grave
3467	Error Id Validación 3467 en el campo Griesgo <> {175,177} si 80 < CCV_promedio <= 90 sección RC08_A	3467	Grave
3468	Error Id Validación 3468 en el campo Griesgo <> {176,177} si 90 < CCV_promedio <= 100 sección RC08_A	3468	Grave
3469	Error Id Validación 3469 en el campo Griesgo <> 177 si CCV_promedio > 100 sección RC08_A	3469	Grave
3470	Error Id Validación 3470 en el campo Griesgo <> {172,177} si 0<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=50 sección RC08_A	3470	Grave
3471	Error Id Validación 3471 en el campo Griesgo <> {173,177} si 50<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=60 sección RC08_A	3471	Grave
3472	Error Id Validación 3472 en el campo Griesgo <> {174,177} si 60<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=80 sección RC08_A	3472	Grave
3473	Error Id Validación 3473 en el campo Griesgo <> {175,177} si 80<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=90 sección RC08_A	3473	Grave
3474	Error Id Validación 3474 en el campo Griesgo <> {176,177} si 90<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=100 sección RC08_A	3474	Grave
3475	Error Id Validación 3475 en el campo Griesgo <> 177 si (Importe/ Valor_vivienda)* 100>100 sección RC08_A	3475	Grave
3482	Error IdValidación 3482. La clave de situación de crédito no aplica para la fecha de información. A partir de la información de enero de 2022 debe reportarse conforme al criterio IFRS9.	3482	Grave

USO LIMITADO

RC09 RELATIVO A LA DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
13	Error Id Validación 13. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC09	3174	Grave
14	Error Id Validación 14. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC09	INT_REG_14	Grave
50	Error Id Validación 50. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe1” de la sección RC09.	3207	Grave
51	Error Id Validación 51. Concepto con importe distinto de 1000 o 2000 0 en el campo “Importe1” de la sección RC09	3208	Grave
52	Error IdValidacion 52 RC09: Cuando el valor del concepto 95685 es igual a 1 la institución debe contar con un coeficiente de capital fundamental mayor o igual al 10 por ciento.	3388	Grave
53	Error IdValidacion 53 RC09: Cuando el valor del concepto 95685 es diferente a 1 la institución debe contar con un coeficiente de capital fundamental menor que el 10 por ciento.	3389	Grave
54	Error IdValidacion 54 RC09: Cuando el valor del concepto 95675 sea mayor o igual a 10.00 la institución debe contar con obligaciones subordinadas y reporte el supuesto para su computabilidad.	3390	Grave
55	Error IdValidacion 55 RC09: Cuando el valor del concepto 95675 sea menor a 10.00 la institución debe contar con obligaciones subordinadas e indicar el supuesto para su computabilidad.	3391	Grave
52	Error IdValidación 3483. La clave de situación de crédito no aplica para la fecha de información. A partir de la información de enero de 2022 debe reportarse conforme al criterio IFRS9.	3483	Grave

RC10 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO DE COBERTURAS OTORGADAS A TRAVÉS DE GARANTÍAS PERSONALES, DERIVADOS DE CRÉDITO Y BURSATILIZACIONES

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
15	Error Id Validación 15. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC10 A partir de marzo 2026. Excepto para los conceptos 100430, 100431,100432, 100433, 100434, 100634, 100636, 100637, 100638, 100639	3175	Grave
16	Error Id Validación 16. Concepto con importe 0 en el campo “Importe1” de la sección RC10 A partir de marzo 2026.	3176	Grave

	Excepto para los conceptos 100430, 100431,100432, 100433, 100434, 100634, 100636, 100637, 100638, 100639		
17	Error Id Validación 17. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC10	INT_REG_17	Grave

RC10 A RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR BURSATILIZACIONES

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Error Id Validación 3484. La combinación entre el Campo (Esquema) = 10 y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Clase_bursatilización) no es valida., RC10_A_BM	3484	Grave
2	Error Id Validación 3485. La combinación entre el Campo (Esquema) = 20 y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Clase_bursatilización) no es valida., RC10_A_BM	3485	Grave
3	Error Id Validación 3486. La combinación entre el Campo (Esquema) = 30 y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Clase_bursatilización) no es valida., RC10_A_BM	3486	Grave
4	Error Id Validación 3487. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) {70,71,72} y el Campo (Tipo_activo subyacente) no es valida., RC10_A_BM	3487	Grave
5	Error Id Validación 3488. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (73 ,74) y el Campo (Tipo_activo subyacente) no es valida., RC10_A_BM	3488	Grave
6	Error Id Validación 3489. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (75,76,77) y el Campo (Tipo_activo subyacente) no es valida., RC10_A_BM	3489	Grave
7	Error Id Validación 3490. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (81) y el Campo (Tipo_activo subyacente) no es valida., RC10_A_BM	3490	Grave
8	Error Id Validación 3491. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (78) y el Campo (Tipo_activo subyacente) no es valida., RC10_A_BM	3491	Grave
9	Error Id Validación 3492. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) {70} y el Campo (Forma_part) no es valida., RC10_A_BM	3492	Grave
10	Error Id Validación 3493. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (73 ,74,75,76) y el Campo (Forma_part) no es valida., RC10_A_BM	3493	Grave
11	Error Id Validación 3494. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (71,72) y el Campo (Forma_part) no es valida., RC10_A_BM	3494	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

12	Error Id Validación 3495. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (77) y el Campo (Forma_part) no es valida., RC10_A_BM	3495	Grave
13	Error Id Validación 3496. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (78) y el Campo (Forma_part) no es valida., RC10_A_BM	3496	Grave
14	Error Id Validación 3497. El Campo (Ponderación Final) y el Campo (Ponderador Calculado) no coinciden., RC10_A_BM	3497	Grave
16	Error Id Validación 3499. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (70, 71, 73,75) y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Plazo_ efectivo) no es valida., RC10_A_BM	3499	Grave
17	Error Id Validación 3500. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (70, 71, 73,75) y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Pond_ Final) no es valida., RC10_A_BM	3500	Grave
18	Error Id Validación 3501. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (70, 71, 73,75) y Tipo_tramo= 20 con el Campo (Punto A) no es valida., RC10_A_BM	3501	Grave
19	Error Id Validación 3502. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (70, 71, 73,75) y Tipo_tramo=20 con el Campo (Punto D) no es valida., RC10_A_BM	3502	Grave
20	Error Id Validación 3503. La combinación entre el Campo (Clase_bursatilización) (70, 71, 73,75) y Tipo_tramo<> 30 con el Campo (Importe) no es valida., RC10_A_BM	3503	Grave
21	Error Id Validación 3514. Tratándose del Campo (Clase _bursatilización)= {70,78} y Tipo_tramo<> 30 con el campo Clave_emisión no pertenece al Catálogo de Títulos de operaciones con valores.	3514	Grave
22	Error Id Validación 3515. La combinación entre el Campo Tipo_tramo con el campo Punto A no es valida.	3515	Grave
23	Error Id Validación 3516. La combinación entre el Campo Tipo_tramo con el campo Punto D no es valida.	3516	Grave
24	Error Id Validación 3517. La combinación con el Campo Transferencia = 63 debe cumplir con tratamientos especiales.	3517	Grave
25	Error Id Validación 3518. La combinación entre el Campo Tipo_tramo con el campo Transferencia no es valida.	3518	Grave
26	Error Id Validación 3519. La combinación entre los Campos Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización= {70,77} y Campo Forma_Part, debe cumplir con tratamientos especiales.	3519	Grave
27	Error Id Validación 3520. La combinación entre los Campos Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización= {71} y Campo Forma_Part, debe cumplir con tratamientos especiales.	3520	Grave

28	Error Id Validación 3521. La combinación entre los Campos Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización= {74,76} y Campos Esquema y Forma_Part, debe cumplir con tratamientos especiales.	3521	Grave
29	Error Id Validación 3522. La combinación entre los Campos Tipo_tramo=30, and Transferencia= {63}, and Clase_bursatilización= {80} y Campos Esquema y Forma_Part, debe cumplir con tratamientos especiales.	3522	Grave
30	Error Id Validación 3523. La combinación entre los Campos Transferencia=60 y Campo Tipo_ tramo, no es valida.	3523	Grave

RC11 RELATIVO A OPERACIONES EN MONEDA NACIONAL CON TASA DE RENDIMIENTO REFERIDA AL SMG, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
18	Error Id Validación 18. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC11	INT_REG_18	Grave

RC12 RIESGO OPERACIONAL

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
2	Error Id Validación 2 RC12: La estructura que está reportando no corresponde con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 1= MIB	3354	Grave
3	Error Id Validación 3 RC12: El total de los ingresos o gastos (conceptos 120010 a 120560) deben ser reportados con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 1= MIB	3355	Grave
4	Error Id Validación 4 RC12: La estructura que está reportando no corresponde con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 2= MEE	3356	Grave
5	Error Id Validación 5 RC12: La estructura que está reportando no corresponde con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 3= MESA	3357	Grave
6	Error Id Validación 6 RC12: La estructura que está reportando no corresponde con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 3= MESA	3358	Grave
7	Error Id Validación 7 RC12: Debe reportar el concepto Préstamos y anticipos mensuales para Banca Minorista o Banca Comercial bajo el Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 3= MESA	3359	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
8	Error Id Validación 8 RC12: Debe reportar el concepto Préstamos y anticipos mensuales para Banca Minorista o Banca Comercial bajo el Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 3= MESA	3360	Grave
9	Error Id Validación 9 RC12: Debe reportar el concepto Requerimiento por riesgo operacional bajo Método Avanzado 4=MAV	3361	Grave
10	Error Id Validación 10 RC12: La estructura que está reportando no corresponde con él Método de cálculo del requerimiento por riesgo operacional 4= MAV	3362	Grave
19	Error Id Validación 19 RC12. Concepto con importe 0 en todos los campos	3177	Grave
20	Error IdValidacion 20 RC12: Cuando el valor del concepto 121910= 1000 la institución podrá apegarse al tratamiento transitorio en riesgo operacional.	3386	Grave
21	Error IdValidacion 21 RC12: Cuando el valor del concepto 121900=2000 la institución no puede apegarse a algún transitorio para el cálculo de riesgo operacional.	3387	Grave
22	Error IdValidacion 22 RC12: Cuando la institución pueda apegarse a algún transitorio para el cálculo de riesgo operacional debe registrar el concepto 121900 con el valor correcto	3392	Grave

RC12 RIESGO OPERACIONAL INDICADOR DEL NEGOCIO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Valida que la Suma del campo Importe1 sea diferente de 0 (RC12_IN)	3397	Grave
2	Valida que el campo de Importe2 sea igual a 0. RC12_IN)	3398	Grave
3	Valida que el concepto pertenezca a los valores predeterminados.	3399	Grave
4	Valida que el concepto pertenezca a los valores predeterminados.	3400	Grave
5	Valida que la consistencia entre el campo 123090 y el concepto 123110	3420	Grave
6	Valida que la consistencia entre el campo 123090 y el concepto 123110	3421	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
7	Valida que la consistencia entre el campo 123090 y el concepto 123080	3537	Grave
8	Valida que la consistencia entre el campo 123090 y el concepto 123080	3538	Grave
9	Valida que la consistencia entre el campo 123120 en función del número de años en operación del banco.	3539	Grave

RC13 RELATIVO A GARANTÍAS REALES, PERSONALES RECIBIDO Y DERIVADOS DE CRÉDITO COMO COMPRADOR DE PROTECCIÓN

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
21	Error Id Validación 21. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC13	INT_REG_21	Grave
49	Error Id Validación 49. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe1” de la sección RC13.	3206	Grave

RC14 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO BAJO EL ENFOQUE DE MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
23	Error Consistencia Id Validación 23. El Importe Insoluto del Crédito (campo Importe1) debe ser menor o igual a la Exposición al incumplimiento (campo Importe4)	3180	Grave
24	Error Consistencia Id Validación 24. El Coeficiente de Correlación para subclase de cartera igual a Tarjetas de Crédito (Campo4 Subclase=140065) debe ser 4 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3181	Grave
27	Error Consistencia Id Validación 27. El Coeficiente de Correlación (campo 16) para subclase de cartera igual a Créditos a personas físicas y morales con actividad empresarial (Campo4 Subclase=140066) debe ser entre 23 y 36 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3184	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
28	Error Consistencia Id Validación 28. El Coeficiente de Correlación (Campo 16) para subclase de cartera igual a Créditos Hipotecarios de Vivienda (Campo4 Subclase=140067) debe ser 15 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3185	Grave
29	Error Consistencia Id Validación 29. El Coeficiente de Correlación (Campo 16) para Tipo de cartera diferente a Consumo (Campo3 TipoC<>140006) debe ser ente 27 y 6 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3186	Grave
30	Error Consistencia Id Validación 30. La Severidad de la pérdida (campo15 xCien2) debe ser 45 cuando la metodología a aplicar sea Básica (campo12 Etiq2="B") y se trate de posiciones Preferentes (Campo6 Gprelacion="P")	3187	Grave
31	Error Consistencia Id Validación 31. La Severidad de la pérdida (campo15 xCien2) debe ser 75 cuando la metodología a aplicar sea Básica (campo12 Etiq2="B") y se trate de posiciones Subordinada (Campo6 Gprelacion="S").	3188	Grave
32	Error Consistencia Id Validación 32. l requerimiento de capital por Modelo Estándar (Campo35 Importe15) NO debe ser reportado en requerimiento por metodología Interna (Campo34 Importe14) cuando se trate del segmento a ser tratado por metodología Estándar (campo7 IdSegmento=140999).	3189	Grave
33	Error Consistencia Id Validación 33. Los requerimiento por Modelos Internos (campo 34 Importe14) y Modelo Estándar (Campo 35 Importe15) deben ser diferente de 0 cuando se trate del segmento a ser tratado por metodología Estándar (campo7 IdSegmento=140999), el requerimiento debe ser reportado en Modelo Estándar (Campo 35 Importe15).	3190	Grave
34	Error Consistencia Id Validación 34. Una parte del requerimiento por Método Estándar NO sea reportado en Requerimiento por Modelos Interno (campo 34 Importe14) cuando se trate del segmento a ser tratado por metodología Estándar (campo7 IdSegmento=140999), el importe total debe ser reportado en requerimiento por Método Estándar (Campo35 Importe15)	3191	Grave
35	Error Consistencia Id Validación 35. Los requerimiento por Modelos Internos (campo 34 Importe14) y Modelo Estándar (Campo 35 Importe15) deben ser diferente de 0 como cuando se trate del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999), el importe se debe reporta en requerimiento por Modelos Internos (campo 34 Importe14).	3192	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
36	Error Consistencia Id Validación 36. El requerimiento por Modelos Internos NO debe reportado en Requerimiento por Modelo Estándar (campo35 Importe15) cuando se trate del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999), se debe reportar en requerimiento por Modelo Interno (campo34 Importe14) después de cumplir un periodo de 3 años.	3193	No Grave
37	Error Consistencia Id Validación 37. El porcentaje de aplicación del método estándar (campo39 xCien9) debe ser 98,92 o 85 cuando el ponderador de requerimiento por Modelo Interno (campo33 xCien8) sea diferente de 0	3194	No Grave
38	Error Consistencia Id Validación 38. Se debe reportar las reservas que se restan del capital (campo39 Importe18) cuando las reservas esperadas(Campo38 Importe17)son menores a las pérdidas esperadas (Campo37 Importe16)	3195	Grave
39	Error Consistencia Id Validación 39. Se debe reportar las reservas que se suman al capital complementario (campo40 Importe19) cuando las reservas esperadas(Campo38 Importe17) son mayores a las pérdidas esperadas (Campo37 Importe16)l	3196	Grave
40	Error Consistencia Id Validación 40. NO se debe reportar reservas que se restan del capital (campo39 Importe18) cuando las reservas admisibles (Campo38 Importe17) son mayores a las pérdidas esperadas (Campo37 Importe16)	3197	Grave
41	Error Consistencia Id Validación 41. NO se debe reportar reservas que se suman al capital complementario (campo40 Importe19) cuando las reservas admisibles (Campo38 Importe17) son menores a las pérdidas esperadas (Campo37 Importe16)	3198	Grave
42	Error Consistencia Id Validación 42. El Ponderador del requerimiento por riesgo de crédito (Campo33 XCien8) debe ser reportado cuando exista importe en requerimiento de capital por Modelos Internos (Campo 34 Importe14) cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3199	Grave
43	Error Consistencia Id Validación 43. La institución reporta valores diferentes a "EB","EA" Y "FB" en Categoría del segmento o crédito (campo5 Etiq1)	3200	Grave
44	Error Consistencia Id Validación 44. La institución reporta valores diferentes a "S","P" Y "NA" en Grado de Prelación (campo6 Gprelación)	3201	Grave
45	Error Consistencia Id Validación 45. La institución reporta valores diferentes a "B","A" Y "NA" en Metodología del Cálculo (campo12 Etiq2)	3202	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
46	Error Consistencia Id Validación 46. NO se debe reportar reservas que se suman al capital complementario (campo40 Importe19) ni se debe reportar reservas a restarse del Capital Básico (campo39 "Importe18") cuando las reservas esperadas (Campo38 Importe17) son iguales a las pérdidas esperadas (Campo37 Importe16)	3203	Grave
47	Error Consistencia Id Validación 47. El porcentaje de aplicación del método estándar (campo39 xCien9) el correspondiente conforme al catálogo de instituciones que cuentan con autorización para uso de MI, cuando el ponderador de requerimiento por Modelo Interno (campo33 xCien8) sea diferente de 0	3204	No Grave
48	Error Consistencia Id Validación 48. El porcentaje de aplicación del método estándar (campo39 xCien9) debe ser 0 después de cumplir 3 años de aplicación de modelos internos.	3205	No Grave
49	Error Consistencia IdValidación 3377. El Coeficiente de Correlación para subclase de cartera igual a Tarjetas de Crédito (Campo4 Subclase=140070) debe ser 4 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3377	Grave
50	Error Consistencia IdValidación 3378. El Coeficiente de Correlación (Campo 16) para subclase de cartera diferente de Tarjetas de Crédito (Campo4 Subclase<>{140065, 140070}) debe ser diferente de 4.	3378	Grave
51	Error Consistencia IdValidación 3379. El Coeficiente de Correlación (Campo 16) para subclase de cartera igual a Nómina, Arrendamiento Finanaciero,Automotriz y ABCD (Campo4 Subclase=140061,140062,140063,140064, 140068, 140069 y 140072) debe ser entre 3 y 16 cuando se trata del segmento a ser tratado por metodología Interna (campo7 IdSegmento<>140999)	3379	Grave

RC15 SECCIÓN A, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR ACREDITADO/ACREDITADA, CONTRAPARTE Y ENTIDAD EMISORA DE PERSONAS RELACIONADAS (RELEVANTES Y NO RELEVANTES)

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
2	Error Id Validación 2. El tipo de operación reportado no admite operaciones con importe negativo	3210	Grave
3	Error Id Validación3. No puede reportarse importe que se deduce del capital con el tipo de relación proporcionado	3211	Grave
4	Error Id Validación 4. De acuerdo a la clase de operación reportada, el importe debe ser igual al importe positivo y el negativo debe ser cero	3212	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
5	Error Id Validación 5. Las operaciones que se deducen de capital deben haber sido concertadas después del 4 de marzo	3213	Grave
6	Error Id Validación 6. No se puede reportar importe con conversión del 100%con el grupo de riesgo seleccionado	3214	Grave
6	Error Id Validación 6. No se puede reportar grupo de riesgo seleccionado con importe con conversión del 100%	3215	Grave
7	Error Id Validación 7. Cuando exista importe positivo luego de reservas, avales y garantías deberá registrarse en alguno de los Importes sujetos a requerimiento o a Deducción de capital	3216	Grave
8	Error Id Validación 8. Cuando se trate de operaciones derivadas y de reportos, si existe importe positivo este debe ser igual al importe activo menos importe pasivo menos garantías	3217	Grave
9	Error Id Validación 9. Cuando se trate de operaciones derivadas y de reportos y no exista importe positivo, el campo Importe activo debe ser menor que el Importe pasivo	3218	Grave
10	Error Id Validación 10. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 55 o 56 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 1	3219	Grave
11	Error Id Validación 11. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 55 o 56 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 1,2,3,4,5 o 6	3220	Grave
12	Error Id Validación 12. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 57 o 58 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 2	3221	Grave
13	Error Id Validación 13. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 57 o 58 y se trate de una operación sin calificación, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3222	Grave
14	Error Id Validación 14. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 59 o 60 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 3.	3223	Grave
15	Error Id Validación 15. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 61 o 62 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 4	3224	Grave
16	Error Id Validación 16. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 63 o 64 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 5	3225	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
17	Error Id Validación 17. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 80 o 81 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 1 o 2	3226	Grave
18	Error Id Validación 18. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 80 o 81 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 1	3227	Grave
19	Error Id Validación 19. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 82 o 83 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 2 o 3	3228	Grave
20	Error Id Validación 20. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 82 o 83 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 2	3229	Grave
21	Error Id Validación 21. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 84 o 85 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 3 ,4 o 5	3230	Grave
22	Error Id Validación 22. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 84 o 85 y se trate de una operación no calificada, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3231	Grave
23	Error Id Validación 23. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 84 o 85 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 3	3232	Grave
24	Error Id Validación 24. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 86 o 87 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 4	3233	Grave
25	Error Id Validación 25. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 88 o 89 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 6	3234	Grave
26	Error Id Validación 26. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 88 o 89 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser igual a 5	3235	Grave
27	Error Id Validación 27. No se puede reportar importe con conversión del 115% con el grupo de riesgo seleccionado	3236	Grave
27	Error Id Validación 27. No se puede reportar grupo de riesgo seleccionado con importe con conversión del 115%	3237	Grave
29	Error Id Validación 29. El registro debe contener información sobre los montos expuestos a riesgo de crédito	3239	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
30	Error Id Validación 30. No existe importe sujeto a riesgo de crédito sobre el cual se puedan deducir los mitigador de riesgo o reservas	3240	Grave
31	Error Id Validación 31. Se está registrando importe sujeto a requerimiento por riesgo de crédito en las columnas correspondientes a la conversión de riesgo del 100% y 115% simultáneamente.	3241	Grave
127	Error Id Validación 127. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Reserva no es válida, tratándose de operaciones con Derivados o Valores	3317	Grave
128	Error Id Validación 128. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Reserva no es válida, tratándose de operaciones con Créditos.	3318	Grave
129	Error Id Validación 129. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Tmercado no es válida, tratándose de operaciones derivadas	3319	Grave
130	Error Id Validación 130. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Tmercado no es válida, tratándose de operaciones con valores o créditos	3320	Grave
131	Error Id Validación 131. La combinación entre el Campo Clase y el Campo (IDOperacio) no es válida, tratándose de operaciones de crédito	3321	Grave
132	Error Id Validación 132. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IDCompensa no es válida, tratándose de operaciones derivadas	3322	Grave
133	Error Id Validación 133. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IDCompensa no es válida, tratándose de operaciones con valores o créditos	3323	Grave
134	Error Id Validación 134. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Plazoremanente no es válida.	3324	Grave
135	Error Id Validación 135. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Plazoremanente no es válida.	3325	Grave
136	Error Id Validación 136. La combinación entre el Campo Clase y el Campo NocionalE no es válida.	3326	Grave
137	Error Id Validación 137. La combinación entre el Campo Clase y el Campo NocionalE no es válida.	3327	Grave
138	Error Id Validación 138. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IdGarantia no es válida.	3328	No Grave
139	Error Id Validación 139. La combinación entre el Campo Clase y el Campo IdGarantia no es válida.	3329	Grave
140	Error Id Validación 140. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Valor añadido no es válida.	3330	Grave
141	Error Id Validación 141. La combinación entre el Campo Clase y el Campo Valor añadido no es válida.	3331	Grave
144	Error Id Validación 144. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 0 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3334	Grave

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
145	Error Id Validación 145. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 0 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3335	Grave
146	Error Id Validación 146. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 92 o 93 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3336	Grave
147	Error Id Validación 147. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 92 o 93 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3337	Grave
148	Error Id Validación 148. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Validación de consistencia entre el campo (GRiesgo) y el campo (Grado)	3338	Grave
149	Error Id Validación 149. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Validación de consistencia entre el campo (GRiesgo) y el campo (Grado)	3339	Grave
150	Error Id Validación 150. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Validación de consistencia entre el campo (GRiesgo) y el campo (Grado)	3340	Grave
151	Error Id Validación 151. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 130, 131,132, 133, 134, 135, 136, 137, 138, 139, 141, 142, 143, 144, 145, 146, 147,148 y se trate de una operación de largo plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3341	Grave
152	Error Id Validación 152. La combinación de grupo y grado de riesgo no es válida. Cuando la clave del grupo de riesgo sea 130, 131,132, 133, 134, 135, 136, 137, 138, 139, 141, 142, 143, 144, 145, 146, 147,148 y se trate de una operación de corto plazo, el grado de riesgo deberá ser "SG"	3342	Grave
156	Error Id Validación 156. La combinación entre el Campo Clase, Plazo remanente y el Campo Valor añadido no es válida. . Validación de consistencia entre el campo (Clase) campo (Plazo remanente) y el campo (Valor añadido)	3346	Grave
161	Error Id Validación 161. La combinación entre el Campo (Clase = Derivados, Plazo remanente= 1) y el Campo Valor añadido no es válida	3363	Grave
162	Error Id Validación 162. La combinación entre el Campo (Clase = Derivados, Plazo remanente <> 1) y el Campo Valor añadido no es válida.	3364	Grave
173	Error Id Validación173. La combinación entre el Campo CPersonaRel y el Campo Griesgo grupo I no es válida.	3375	Grave
174	Error Id Validación174. La combinación entre el Campo CPersonaRel y el Campo Griesgo grupo VII no es válida.	3376	Grave
549	Error Id Validación 549 El Campo Grupo de Riesgo "no es válido para esta sección	3385	Grave
552	Error ID Valid3443 en el campo Griesgo<>172 si Clase in {105002,115040} sección RC15_A	3443	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
553	Error ID Valid3444 en el campo Griesgo<>173 si Clase=105003 sección RC15_A	3444	Grave
554	Error ID Valid3445 en el campo Griesgo<>174 si Clase in {105004,115050} sección RC15_A	3445	Grave
555	Error ID Valid3446 en el campo Griesgo<>175 si Clase=105005 sección RC15_A	3446	Grave
556	Error ID Valid3447 en el campo Griesgo<>176 si Clase=105006 sección RC15_A	3447	Grave
557	Error ID Valid3448 en el campo Griesgo<>177 si Clase in {105007, 115030, 115060} sección RC15_A	3448	Grave
560	Error ID Valid3451 en el campo Griesgo<>170 si Clase in {115000, 115005, 115010, 115080} sección R15_A	3451	Grave
561	Error ID Valid3452 en el campo Griesgo in [170 a 179] si Clase in {115020, 115090} sección RC15_A	3452	Grave
562	Error ID Valid3453 en el campo Griesgo<>180 si Clase=115070 sección RC15_A	3453	Grave
563	Error ID Valid3454 en el campo Griesgo<>[158,159] si Clase in {115100, 115105, 115110, 115120} sección RC15_A	3454	Grave
564	Error ID Valid3455 en el campo Clase in {105000, 105001, 105008, 105009} si sección RC15_A	3455	Grave
564	Error ID Valid3456 en el campo TipoTrat<>6 o 7 si Clase in {10204, 10205} sección RC15_A	3456	Grave
566	Error ID Valid3457 en el campo TipoTrat<>{4,5} si Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007} sección RC15_A	3457	Grave
567	Error ID Valid3458 en el campo TipoTrat<>{4,5} si Clase {115000, 115005,115010,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115100,115105,115110,115120} sección RC15_A	3458	Grave
568	Error ID Valid3459 en el campo TipoTrat<>7 si Clase in {115020, 115090} sección RC15_A	3459	Grave
569	Error ID Valid3460 en el campo Clase in {10201 a 10204, 10212 a 10214, 105001 a 105009, 115000 a115120} si TipoTrat=8 sección RC15_A	3460	Grave
570	Error ID Valid3461 en el campo TipoTrat<>7 si Clase in {10201,10212,10213,10214} sección RC15_A	3461	Grave
571	Error Id Validación 3462 en el campo Griesgo in [170 a 180] si TipoTrat in {6, 7} sección RC15_A	3462	Grave
572	Error Id Validación 3463 en el campo Griesgo not in {0, 53 a 64, 75, 76, 80 a 89, 92, 93, 111 a 120, 130 a 139, 141 a 148, 158, 159} si Clase in {10101 a 10320,10407 a 10463,10501,10502,104099} and TipoTrat= {6,7,8} and Etiq_Periodo_Paralelo<> 2 sección RC15_A	3463	Grave

RC15 SECCIÓN B, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA DE OPERACIONES RELACIONADAS

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
123	Error Id Validación 123. no hay consistencia entre el campo (Ndcont) y el campo (Mcob)	3313	Grave
124	Error Id Validación 124. no hay consistencia entre el campo (Ndcont) y el campo (Mcob)	3314	Grave
125	Error Id Validación 125. no hay consistencia entre el campo (Ndind) y el campo (Mind)	3315	Grave
126	Error Id Validación 126. no hay consistencia entre el campo (Ndind) y el campo (Mind)	3316	Grave
545	Error Id Validación 545. El Campo(GradRiesgoCont) = 17 no es válido para esta sección	3381	Grave

RC17 RELATIVO A LAS OPERACIONES CON MERCANCÍAS, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Error Id Validación 1. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe2” de la sección RC17	3351	Grave
2	Error Id Validación 2. Concepto con importe distinto de 0 en el campo “Importe1” de la sección RC17	3352	Grave

RC18 RELATIVO A LAS OPERACIONES SOBRE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES SUJETAS A REQUERIMIENTO POR IMPACTO GAMMA Y VEGA

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel
1	Error Id Validación 1. Concepto con importe 0 en ambos campos de la sección RC018	3353	Grave

RC 21 RELATIVA A LOS INSTRUMENTOS DE CAPITAL ELEGIBLES PARA COMPUTAR EL CAPITAL NETO

No. Validación	Descripción	Identificador	Nivel	Condición Previa	Condición Base
1	Valida que el título reportado se encuentre reportado en el CATÁLGO DE TITULOS DE DEUDA bajo la llave Clavetit	3525	Grave	Cualquier registro reportado en la sección RC21	Bajo la llave Emisor y Clavetit de la sección RC21,no pertenece Catálogo General de Títulos de Deuda
2	La emisión no es elegible por tener un plazo remanenete menor a un año. En caso de que la emisión no sea elegible para computar en el capital neto o en el	3526	Grave	Cve_suplemento=10	Pzo_residual<1

	suplemento al capital neto se deberá de reportar en ceros campos 12, 13 y 14 según las ayudas.				
3	Se valida si el monto el suplemento del capital neto, si y solo sí, la emisión califica para computar como suplmento del capital neto.	3527	Grave	Cve_suplemento=20	(Monto_suplemento>0 OR Activos_ajustados>0 OR Activos_ponderados>0)
4	Se deben reportar los activos ponderados y los activos ajustados para el cálculo del suplemento de capital neto	3528	Grave	Cve_suplemento=10	Monto_suplemento=0 OR Activos_ajustados=0 OR Activos_ponderados=0)
6	Se valida la elegibilidad de los instrumentos de capital registrados.	3530	Grave	Cve_Suplemento=10	Sí la emisión pertenece al catálogo general de títulos de deuda (CGTD) y CGTD.cve_elegible=30
7	Se validan que los activos ajustados, activos ponderados totales por riesgo, valor razonable y emisión sean los mismos para cada registro.	3531	Grave	Si existen mas de un registro bajo los campos, emisor, fecha_corte, clavetit	Los campos valor_razonable, monto en circulación, activos_ajustados, activos_ponderados no son identicos.
8	La emisión no cumple con el anexo I-R	3532	Grave	Cve_Suplemento=10 OR nivel_capital=2	Sí la emisión pertenece al catálogo general de títulos de deuda (CGTD) y CGTD.cve_elegible<>10
9	La emisión no cumple con el anexo I-S	3533	Grave	Cve_Suplemento=10 OR nivel_capital=3	Sí la emisión pertenece al catálogo general de títulos de deuda (CGTD) y CGTD.cve_elegible<>20
10	Valida que el MONTO EN CIRCULACION reportado sea consistente con el CATÁLOGO GENERAL DE TITULOS DE DEUDA BAJO la llave Emisor y Clavetit	3534	Grave	Cualquier registro reportado en la sección RC21	Acorde con la información contenida en el catálogo de títulos de deuda.
11	Valida que la FECHA DE VENCIMIENTO reportada sea consistente con el CATÁLOGO GENERAL DE TITULOS DE DEUDA BAJO la llave Emisor y Clavetit	3535	Grave	Cualquier registro reportado en la sección RC21	Acorde con la información contenida en el catálogo de títulos de deuda.

12	Valida que los activos ajustados sean consistentes con el subreporte R34 A-3401 Cálculo de la razón de apalancamiento	3536	No Grave	Cualquier registro reportado en la sección RC21	El campo activos_ajustado deberá ser igual a lo reportado en el subreporte R34 A-3401 Cálculo de la razón de apalancamiento, bajo la llave fecha, institución, concepto (900600000000)

iii. Expresiones condicionales

A continuación, se muestran las expresiones condicionales de cada validación.
La regla de validación busca valores incorrectos dentro de las condiciones base, por ello cuando la condición previa y la condición base sean verdaderas, el sistema desplegará un diagnóstico de carácter grave. La inconsistencia está en lo reportado en los campos de la condición base.

RC01 RELATIVO A OPERACIONES EN MONEDA NACIONAL CON TASA DE INTERÉS NOMINAL, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	INT_REG_1	IdSeccion=RC01	(Importe1+Importe2=0)

RC02 RELATIVO A OPERACIONES CON TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL Y SOBRETASA, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
2	INT_REG_2	IdSeccion=RC02	(Importe1+Importe2=0)

RC03 RELATIVO A OPERACIONES EN UDIS, UMA Y TASA DE INTERÉS REAL EN MONEDA NACIONAL, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
3	INT_REG_3	IdSeccion=RC03	(Importe1+Importe2=0)

RC04 RELATIVO A OPERACIONES EN DIVISAS O INDIZADAS A TIPOS DE CAMBIO CON TASA DE INTERÉS NOMINAL EN MONEDA EXTRANJERA, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
4	INT_REG_4	IdSeccion=RC04	(Importe1+Importe2+Importe3+Importe4=0)
160	3350	NA	(49288.Importe1<>1000) or (49288.Importe1<>2000) or (49288.Importe1<>3000)

RC05 RELATIVO A OPERACIONES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
5	INT_REG_5	IdSeccion=RC05	(Importe1+Importe2=0)
158	3348	SI Concepto pertenece a [55103,55104,55105,55106,55107,55108,55109,55110,55111,55112,55113,55114,55115,55116,55117,55118,55119,55120,55121,55122,55123,551124,55125,55126,55127,55128,55140,55141,55142,55143]	Concepto.Importe2 <>0

RC06_ SECCIÓN A, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR CONTRAPARTE

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
52	3242	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Tmercado =10
53	3243	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Tmercado <> 10
54	3244	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [101031, 101032, 103151,103152,103161,103162,103171,103172,103181,103182,103191,103192,104044,104045,104056,104057,104066,104067,104073,104074,104080,104081,104087,104088]	IDOperacio<>1

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
55	3245	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IDCompensa <> 1
56	3246	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IDCompensa <>1
57	3247	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [101031, 101032, 103151,103152,103161,103162,103171,103172,103181,103182,103191,103192,104044,104045,104056,104057,104066,104067,104073,104074,104080,104081,104087,104088]	PlazoCalif<>10
58	3248	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [101031, 101032, 103151,103152,103161,103162,103171,103172,103181,103182,103191,103192,104044,104045,104056,104057,104066,104067,104073,104074,104080,104081,104087,104088]	PlazoCalif =10
59	3249	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [40,41,42]	PlazoCalif <>10
60	3250	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [127,128]	PlazoCalif <>10
61	3251	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [44,45,46,49]	PlazoCalif=10
62	3252	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= 43	PlazoCalif<>30
63	3253	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= 48	PlazoCalif<>21 y 31
64	3254	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [51]	PlazoCalif<>10
65	3255	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [55,63]	PlazoCalif=10
66	3256	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [57,61]	PlazoCalif<>21 y 31
67	3257	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [19,67]	PlazoCalif <>10
68	3258	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [68,69,70,71,72]	PlazoCalif <>10
69	3259	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [73,74,76,77,78]	PlazoCalif <>10
70	3260	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [79,96]	PlazoCalif<>10
71	3261	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [80,82,88]	PlazoCalif=10
72	3262	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [86]	PlazoCalif<>21 y 31

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
73	3263	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [110]	PlazoCalif<>10
74	3264	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [111,113,115,119]	PlazoCalif=10
75	3265	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [117]	PlazoCalif<>21 y 31
76	3266	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [92]	PlazoCalif<>10
77	3267	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [123,166]	PlazoCalif<>10
78	3268	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [156,157]	PlazoCalif<>10
79	3269	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [140,149]	PlazoCalif<>10
80	3270	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [160,161]	PlazoCalif<>10
81	3271	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [162,163]	PlazoCalif<>10
82	3272	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [150,151]	PlazoCalif<>10
83	3273	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [152,153]	PlazoCalif<>10
84	3274	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [164,165]	PlazoCalif<>10
85	3275	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [154,155]	PlazoCalif<>10
86	3276	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [158,159]	PlazoCalif<>10
87	3277	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Plazoremanente=0
88	3278	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Plazoremanente<>0
89	3279	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104052,104053,104054,104055,104062,104063,104064,104065,104069,104070,104071,104072,104076,104077,104078,104079,104083,104084,104085,104086,10419,10420,104090,104091,104092,104093,104095,104096,104097,104098]	CoeficienteSP=1
90	3280	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10103, 10105, 10315, 10316, 10317 ,10318, 10319, 10320, 10450, 101031, 101032, 103151, 103152,103161 ,103162, 103171, 103172, 103181 ,103182 ,103191 ,103192, 104044 ,104045, 104056 ,104057 ,104066 ,104067 ,104073 104074, 104080, 104081, 104087, 104088 ,104099]	CoeficienteSP<>1

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
91	3281	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	NocionalE=0
92	3282	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	NocionalE<>0
93	3283	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Valor añadido=0
94	3284	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Valor añadido<>0
95	3285	Si campo importe positivo (ImportePO) <> 0	(Importe PO) <>(Importe A) -(ImporteP)
96	3286	Si campo importe negativo (ImporteNE) <> 0	(Importe NE) <>(Importe P) -(ImporteA)
142	3332	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IdGarantia=10

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
143	3333	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IdGarantia<>10
153	3343	SI campo Grupo de Riesgo (GRiesgo) pertenece a [24]	PlazoCalif<>10
154	3344	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10403,104051,104061,104068,104075,104082,] y campo Plazo remanente (Plazo remanente)= 1	CoeficienteSP<>1
155	3345	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10403,104051,104061,104068,104075,104082,] y campo Plazo remanente (Plazo remanente)= 1	Valor añadido<>0
159	3349	Griesgo pertenece a { 123,166}	IDOperacio<> 1
163	3365	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10403, 104051,104061,104068, 104075, 104082,] y Plazo Remanente <> 1 y <> 0	Valor añadido=0
164	3366	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 1 y que no pertenezca a [025008, 025007, 214832]	Griesgo <> {40}
165	3367	Si campo Contraparte pertenece a [200282,214274] y campo clase <> [10205,10212]	Griesgo <> 43
166	3368	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 2	Griesgo <> {44 a 49,156,157}
167	3369	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 3	Griesgo <> {53,55,57,59,61,63, 131,133,135,137,139,140,142,144,146,148,149}
168	3370	Si campo Contraparte pertenece a [037006,037009,037019,037135,037166,037168] y campo clase <> [10205,10212]	Griesgo <> 19
169	3371	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 14	Griesgo <>67,160,161
170	3372	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 5	Griesgo <> {68 a 72,162,163,167}

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
171	3373	RC06A.[Contraparte] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 7	Griesgo <> {80,82,84,86,88,96, 97,110,111,113,11 5,117,119,152,153, 164,165}
172	3374	Si clase de operación pertenece a [101031, 101032,103151,103152,103161,103162,103171,103172, 103181,103182,103191,103192,104044,104045,104056, 104057,104066,104067,104073,104074,104080,104081,10 4087,104088]	Griesgo <> 123,166
548	3384	El valor del Campo (GRiesgo) = 167	fecha de corte <= 31/07/2017
550	3393	Si Contraparte pertenece a [025008, 025007, 214832] y campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086]	Griesgo <> {127,128}
551	3394	RC06A.[Contraparte] pertenece a [025008, 025007, 214832] y campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071, 104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084, 104085, 104086]	Griesgo <> {80,82,84,86,88,96, 97,110,111,113,11 5,117,119,152,153, 164,165}
552	3395	SI campo garantiaMS > 1 and campo garantiaMI > 1	garantiaMS = garantiaMI
553	3396	SI GarantíaMI<>0 and ImportePO<>0	(ImporteA-ImporteP)<> ImportePO

RC06 SECCIÓN B, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
97	3287	SI campo (Ndcont) <>0	Mcob=0
98	3288	SI campo (Mcob) <>0	Ndcont=0
99	3289	SI campo (Ndind) <>0	Mind=0
100	3290	SI campo (Mind) <>0	Ndind=0
544	3380	El valor del Campo (GradRiesgoCont) = 17	fecha de corte <= 30/06/2017
546	3382	El valor del Campo (GradRiesgoCont) = 17	Contraparte <> 002001
547	3383	El campo Contraparte = 002001	El valor del Campo (GradRiesgoCont) <> 17

RC06 SECCIÓN C, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR LA EXPOSICIÓN AL FONDO DE INCUMPLIMIENTO

Expresiones condicionales de validaciones al interior del registro aplicable hasta 31/05/2022

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
101	3291	Si campo (Metodol) =30 y Asigna <> 3000	Aportacion<>0
102	3292	Si campo (Metodol) <>30	Aportacion=0
103	3293	Si campo (Metodol) =30	Conversion<>0
104	3294	Si campo (Metodol) <>30	Conversion=0
105	3295	Si campo (Metodol) = [10, 20]	CapitalT<>0
107	3297	Si campo (Metodol) = [10, 20]	RecursosTot Fondo<>0
108	3298	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	RecursosTot Fondo=0
109	3299	Si campo (Metodol) = [10, 20]	RecursosPropios<>0
110	3300	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	RecursosPropios=0
111	3301	Si campo (Metodol) = [10, 20]	Recursos disponibles<>0
112	3302	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	Recursos disponibles=0
113	3303	Si campo (Metodol) = [10, 20]	TotalAportac<>0
114	3304	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	TotalAportac=0
115	3305	Si campo (Metodol) = [10, 20]	NumeroSoc<>0
116	3306	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	NumeroSoc=0
117	3307	Si campo (Metodol) = [10, 20]	Beta2<>0
118	3308	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	Beta2=0
119	3309	Si campo (Metodol) = [10, 20]	Asigna<>0
120	3310	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	Asigna=0
121	3311	Si campo (Metodol) = [10, 20]	FraccSocL<>0
122	3312	Si campo (Metodol) <> [10, 20]	FraccSocL =0

Expresiones condicionales de validaciones al interior del registro aplicable desde 30/06/2022

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3504	Si campo [TipoCC] <> {20, 30, 70}	Metodol<>10
2	3505	Si campo [TipoCC] = {20, 30, 70}	Metodol<>30
3	3506	Si campo (Metodol) =10	CapitalT<>0
4	3507	Si campo (Metodol) =10	RecursosPropios<>0
5	3508	Si campo (Metodol) =10	Recursos disponibles<>0
6	3509		Aportacion=0
7	3510		Metodol <> {10,30}
8	3511	Si campo (Metodol) =30	(RecursosPropios + Recursos disponibles) = 0
9	3512	Si campo (Metodol) =30	Conversion<>0
10	3513	Si campo (Metodol) = 10	Conversion=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

RC07 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO DE LA ENTIDAD EMISORA

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
9	INT_REG_9	IdSeccion=RC07	(Importe1+Importe2=0)

RC08 RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR DEPÓSITOS Y PRÉSTAMOS

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
10	3172	NA	Importe2<>0 (aplicable hasta diciembre 2021)
11	3173	NA	Importe1=0 (aplicable hasta diciembre 2021)
12	INT_REG_12	IdSeccion=RC08	(Importe1+Importe2=0)
22	3179	NA	(89900.Importe1<>1000) or (89900.Importe1<>2000)
23	3480	Considerando el Catálogo de Conceptos de RCS. Si sección=RC08 y corresponde a conceptos que son de cartera en etapa 3	Importe1<>0
24	3481	Considerando el Catálogo de Conceptos de. Si sección=RC08 y no corresponde a conceptos de cartea en etapa 3	Importe2<>0

RC08_A RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO DE CARTERA DE CONSUMO, VIVIENDA Y A MIPYMES (NUEVOS, REESTRUCTURADOS O RENOVADOS AL AMPARO DEL OFICIO P418/2020 Y SU ALCANCE P430/2020 Y DE LA RESOLUCIÓN QUE MODIFICA EL ARTICULO 2 BIS 17 DE LA CUB PUBLICADA EN EL DOF EL 20 DE JULIO DE 2021)

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3401	Clase=105000	Griesgo<>170
2	3402	Clase=105001	Griesgo<>171
3	3403	Clase in {105002,115040}	Griesgo<>172
4	3404	Clase=105003	Griesgo<>173
5	3405	Clase in {105004,115050}	Griesgo<>174
6	3406	Clase=105005	Griesgo<>175

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

7	3407	Clase=105006	Griesgo<>176
8	3408	Clase in {105007, 115030, 115060}	Griesgo<>177
9	3409	Clase=105008	Griesgo<>178
10	3410	Clase=105009	Griesgo<>179
12	3412		Clase not in {105000, 105001, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 105008, 105009, 115000,115005,115010,115020, 115030,115040,115050,115060, 115070,115080,115090,115100,1 15105,115110,115120}
14	3414	Clase not in {115020,115090]	Griesgo not in {158, 159, 170 a 180}
15	3415	Griesgo=178	Grado not in {10, 13, 14, 15, 16}
16	3416	Griesgo<> 178	Grado <> 10
17	3417	Griesgo<> 178	PlazoCalif <> 10
18	3418	(Garantia_ME + Garantia_MI + Aval+ Der_Cred+ Reservas) >0	Importe < (Garantia_ME + Garantia_MI + Aval+ Der_Cred+ Reservas)
19	3419		TipoRel<>10
20	3422	Clase in {115000, 115005, 115010, 115080}	Griesgo<>170
21	3423	Clase in {115020, 115090}	Griesgo in [170 a 179]
22	3424	Clase=115070	Griesgo<>180
23	3425	Clase in {115100, 115105, 115110, 115120}	Griesgo<>[158,159]
24	3426	Clase=105000, 105001, 105008, 105009	TipoTrat<>{1,2,3}
25	3427	Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007}	TipoTrat=6,7,8
26	3428	Clase {115000, 115005,115010,115030,115040,115050,115060,115070,11 5080,115100,115105,115110,115120}	TipoTrat<>{4,5}
27	3429	Clase in {115020, 115090}	TipoTrat<>7
28	3430	Clase=115020	Grado in {10, 17}
29	3431	Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007, 115030}	CCV_promedio=0
30	3432	105002	CCV_promedio>50
31	3433	105003	CCV_promedio<=50 o CCv_promedio >60
32	3434	105004	CCV_promedio<=60 o CCv_promedio >80
33	3435	105005	CCV_promedio<=80 o CCv_promedio >90
34	3436	105006	CCV_promedio<=90 o CCv_promedio >100
35	3437	105007	CCV_promedio<=100
36	3438	Clase not in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007,115030}	CCV_promedio<>0
37	3439	Clase in {115040,115050,115060}	Valor_subcuenta=0
38	3440	Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007,115030}	Valor_vivienda=0

39	3464	0< CCV_promedio <= 50	Griesgo <> {172,177}
40	3465	50 < CCV_promedio <= 60	Griesgo <> {173,177}
41	3466	60 < CCV_promedio <= 80	Griesgo <> {174,177}
42	3467	80 < CCV_promedio <= 90	Griesgo <> {175,177}
43	3468	90 < CCV_promedio <= 100	Griesgo <> {176,177}
44	3469	CCV_promedio > 100	Griesgo <> 177
45	3470	0<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=50	Griesgo <> {172,177}
46	3471	50<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=60	Griesgo <> {173,177}
47	3472	60<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=80	Griesgo <> {174,177}
48	3473	80<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=90	Griesgo <> {175,177}
49	3474	90<(Importe/ Valor_vivienda)* 100<=100	Griesgo <> {176,177}
50	3475	(Importe/ Valor_vivienda)* 100>100	Griesgo <> 177
51	3482	Fecha >= 2021/01/31	Situacion in (1,2,3,4)

RC09 RELATIVO A LA DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
14	INT_REG_14	IdSeccion=RC09	(Importe1+Importe2=0)
13	3174	(Concepto<>95130) and (Concepto<>95135) and (Concepto<>95140) and (Concepto<>95145) and (Concepto<>95146) and (Concepto<>95150) and (Concepto<>95151) and (Concepto<>92350) and (Concepto<>95152) and (Concepto<>95155) and (Concepto<>92790) and (Concepto<>92792) and (Concepto<>95156) and (Concepto<>92808) and (Concepto<>92810) and (Concepto<>95160) and (Concepto<>95165) and (Concepto<>95170) and (Concepto<>95175) and (Concepto<>95176) and (Concepto<>95185) and (Concepto<>91950) and (Concepto<>95190) and (Concepto<>95195) and (Concepto<>95200) and (Concepto<>95215) and (Concepto<>95220) and (Concepto<>95225) and (Concepto<>95230) and (Concepto<>95235) and	Concepto.Importe2 <>0

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
		(Concepto<>95240) and (Concepto<>95245)	
50	3207	(Concepto 95215) and (Concepto95220) and (Concepto 95225) and (Concepto95230) and (Concepto 95235) and (Concepto95240) and (Concepto95245)	Importe1<>0
51	3208	(IdSeccion=RC09)	(Concepto="95662") and ((Importe1<>1000) and (Importe1<> 2000))
52	3388	Si 95685 = 1	95675 < 10.00
53	3389	Si 95685 <> 1 y 95685<>NULL	95675 >= 10.00
54	3390	Si 95675 >= 10.00	95685 <> 1 y 95075+95080<>0 o 95685 = NULL
55	3391	Si 95675 < 10.00	95685 = 1 y 95075+95080<>0

RC10 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO DE COBERTURAS OTORGADAS A TRAVÉS DE GARANTÍAS PERSONALES, DERIVADOS DE CRÉDITO Y BURSATILIZACIONES

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
17	INT_REG_17	IdSeccion=RC10	(Importe1+Importe2=0)
15	3175	NA	Importe2<>0 A partir de marzo 2026. Excepto para los conceptos 100430, 100431,100432, 100433, 100434, 100634, 100636, 100637, 100638, 100639

16	3176	NA	Importe1=0 A partir de marzo 2026. Excepto para los conceptos 100430, 100431,100432, 100433, 100434, 100634, 100636, 100637, 100638, 100639

RC10A RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR BURSATILIZACIONES

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3484	Campo Esquema = 10 and Tipo_tramo<> 30	Campo Clase de Bursatilización <> (70,81)
2	3485	Campo Esquema = 20 and Tipo_tramo<> 30	Campo Clase de Bursatilización <> (71,72,73)
3	3486	Campo Esquema = 30 and Tipo_tramo<> 30	Campo Clase de Bursatilización <> (74 a 77)
4	3487	Campo Clase de Bursatilización {70,71,72}	Campo Tipo_activo subyacente <> (10 al 16)
5	3488	Campo Clase de Bursatilización (73 ,74)	Campo Tipo_activo subyacente <> (18)
6	3489	Campo Clase de Bursatilización (75,76,77)	Campo Tipo_activo subyacente <> (19)
7	3490	Campo Clase de Bursatilización (81)	Campo Tipo_activo subyacente <> (17)
8	3491	Campo Clase de Bursatilización (78)	Campo Tipo_activo subyacente <> (10 al 16)
9	3492	Campo Clase de Bursatilización {70}	Campo (Forma_part) <> (50, 51)
10	3493	Campo Clase de Bursatilización (73 ,74,75,76)	Campo (Forma_part) <> (52,54)
11	3494	Campo Clase de Bursatilización (71,72)	Campo (Forma_part) <> (52,54)
12	3495	Campo Clase de Bursatilización (77)	Campo (Forma_part) <> (50, 51)
13	3496	Campo Clase de Bursatilización (78)	Campo (Forma_part) <> (50, 51,55)
14	3497	Campo Ponderación Final	Pond_ Final <> Ponderador_calculado (ver hoja ANEXO VALID 3497)
16	3499	Campo Clase de Bursatilización (70, 71, 73,75) and Tipo_tramo<> 30	Plazo_efectivo =0
17	3500	Campo Clase de Bursatilización (70, 71, 73,75) and Tipo_tramo<> 30	Pond_ Final=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
18	3501	Campo Clase de Bursatilización (70, 71, 73,75) and Tipo_tramo=20	Punto A<0 o Punto A>100
19	3502	Campo Clase de Bursatilización (70, 71, 73,75) and Tipo_tramo=20	Punto D<0 o Punto D> 100
20	3503	Campo Clase de Bursatilización (70, 71, 73,75) and Tipo_tramo<> 30	Importe=0
21	3514	Campo Clase de Bursatilización (70, 78) and Tipo_tramo<> 30	RC10A. [Clave_emisión] no pertenece no pertenece al Catálogo de Títulos de operaciones con valores.
22	3515	Tipo_tramo=10	Punto A <> 0
23	3516	Tipo_tramo=10	Punto D <> 0
24	3517	Si campo (Transferencia)= 63	Tipo_tramo<> 30 ó Clase_bursatilización <> {72,78,80,81}
25	3518	Si Tipo_tramo=10,20	Campo (Transferencia)<> 60,61
26	3519	Si Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización={70,77}	Forma_part<> {50,51}
27	3520	Si Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización={71}	Forma_part<> {52,54}
28	3521	Si Tipo_tramo=30, and Transferencia= {61}, and Clase_bursatilización={74,76}	Esquema<> {20}, Forma_part<> {54}
29	3522	Si Tipo_tramo=30, and Transferencia= {63}, and Clase_bursatilización= {80}	Esquema<> {10}, Forma_part<> {50,53}
30	3523	Si campo (Transferencia)= 60	Tipo_tramo<> [10,20]

RC11 RELATIVO A OPERACIONES EN MONEDA NACIONAL CON TASA DE RENDIMIENTO REFERIDA AL SMG, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
18	INT_REG_18	IdSeccion=RC11	(Importe1+Importe2=0)

RC12 RIESGO OPERACIONAL

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
2	3354	Si concepto 121600 = 1	**Sólo podrá reportar en el Importe 1**
3	3355	Si concepto 121600 = 1	Suma Importe 1 de los conceptos 120010 a 120560 < 0
4	3356	Si concepto 121600 = 2	Para cada concepto 120010 a 120560 , el Importe 1 <> Suma de los importes 2 a 9
5	3357	Si concepto 121600 = 3	Del concepto 120010 al 120560 , Importe 4 + Importe 5 <> 0
6	3358	Si concepto 121600 = 3	Para cada conceptos de 120010 a 120560, Importe 1 <> Importe2 + Importe 3+ Importe 6 + Importe 7 + Importe 8 + Importe 9
7	3359	Si concepto 121600 = 3	El concepto 121700 , Importes 4 + Importe 5= 0
8	3360	Si concepto 121600 = 3	El concepto 121700, Importe 1 <> Importe4 + Importe 5
9	3361	Si concepto 121600 = 4	Debe reportar en el Importe 1 el concepto 121800
10	3362	Si concepto 121600 = 4	Para cada concepto 120010 a 121700 , el Importe 1 <> Suma de los importes 2 a 9
19	3177	IdSeccion=RC12	(Importe1+Importe2+Importe3+Importe4+Importe5+Importe6+Importe7+Importe8+Importe9=0)
20	3386	Si 121910 = 1000	En AdeC (Método para riesgo operacional) campo gradualidad = 0 o = NULL
21	3387	Si 121910 = 2000	En AdeC (Método para riesgo operacional) campo gradualidad <> 0 o <>NULL
22	3392	Si en AdeC (Método para riesgo operacional) la gradualidad vigente = 3 , 4, 5, 6)	121910 <> 1000

RC12_IN RIESGO OPERACIONAL INDICADOR DE NEGOCIO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3397	NA	Importe1=0
2	3398	NA	Importe2<>0
3	3399	NA	(123090.Importe1<>1) or (123090.Importe1<>2) or (123090.Importe1<>3)
4	3400	NA	(123120.Importe1<>1) or (123120.Importe1<>2)
5	3420	concepto 123090=2	concepto 123110<1
6	3421	concepto 12309<>2	concepto 123110<>0
7	3537	concepto 123090=2	123080<>0
8	3538	concepto 123090<>2	123080=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

9	3539	Concepto 123120 =2	2023 (fecha de corte -fecha de inicio de operaciones de la institución)/365 >=8 2024 (fecha de corte -fecha de inicio de operaciones de la institución)/365 >=9 2025 (fecha de corte -fecha de inicio de operaciones de la institución)/365 >=10

RC13 RELATIVO A GARANTÍAS REALES, PERSONALES RECIBIDO Y DERIVADOS DE CRÉDITO COMO COMPRADOR DE PROTECCIÓN

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
21	INT_REG_21	IdSeccion=RC13	(Importe1+Importe2=0)
49	3206	(Concepto)>=131003	(Importe1)<>0)

RC14 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO BAJO EL ENFOQUE DE MÉTODOS BASADOS EN CALIFICACIONES INTERNAS

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
23	3180	NA	Importe4<Importe1
24	3181	(TipoC=140006) and (Subclase=140065) and (IdSegmento<>140999)	Factor<>4
27	3184	(TipoC=140006) and (Subclase=140066) and (IdSegmento<>140999)	Factor<8 or Factor>24
28	3185	(TipoC=140006) and (Subclase=140067) and (IdSegmento<>140999)	Factor<>15
29	3186	(TipoC<>140006) and (IdSegmento<>140999)	Factor<12 or Factor>24
30	3187	(Etiq2="B") and (GPrelacion="P")	XCien2<>45
31	3188	(Etiq2="B") and (GPrelacion="S")	XCien2<>75
32	3189	IdSegmento=140999	Importe14<>0 and Importe15=0
33	3190	IdSegmento=140999	(Importe14=0) and (Importe15=0)
34	3191	IdSegmento=140999	((Importe14<>0) and (Importe15<>0))
35	3192	IdSegmento<>140999	(Importe14=0) and (Importe15=0)
36	3193	(IdSegmento<>140999) and (Mes de autorización >36)	Importe15<>0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
37	3194	(XCien8<>0) and (Mes de autorización (ANEXO VALID 3194) = MES DE LA INFORMACIÓN) and Subclase = Subclase (ANEXO VALID 3194)	(XCien9<> Gradualidad (anexo valid 3194)
38	3195	(Importe14<>0) and (Importe16>Importe17)	Importe18=0
39	3196	(Importe14<>0) and (Importe16<Importe17)	Importe19=0
40	3197	(Importe14<>0) and (Importe16<Importe17)	Importe18<>0
41	3198	(Importe14<>0) and (Importe16>Importe17)	Importe19<>0
42	3199	(IdSegmento<>"140999") and (Importe14<>0)	XCien8=0
43	3200	NA	(Etiq1<>"EB") OR (Etiq1<>"EA") OR (Etiq1<>"FB")
44	3201	NA	(Gprelación<>"S") OR (Gprelación<>"P") OR (Gprelación<>"NA")
45	3202	NA	(Etiq2<>"B") OR (Etiq2<>"A") OR (Etiq2<>"NA")
46	3203	(Importe14<>0) and (Importe16=Importe17)	Importe19+Importe18<>0
47	3204	xCien8<>0	xCien9 not in (Gradualidad_Catálogo por año)
48	3205	(Mes de autorización (ANEXO VALID 3194) < MES DE LA INFORMACIÓN) and Subclase = Subclase (ANEXO VALID 3194)	XCien9<>0
49	3377	(Subclase=140070) and (IdSegmento<>140999)	Factor<>4
50	3378	(Subclase<>{140065, 140070})	Factor=4
51	3379	((Subclase=140061) or (Subclase=140062) or (Subclase=140063) or (Subclase=140064) or (Subclase=140068) or (Subclase=140069) or (Subclase=140072)) and (IdSegmento<>140999)	Factor<3 or Factor>16

RC15 SECCIÓN A, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR ACREDITADO/ACREDITADA, CONTRAPARTE Y ENTIDAD EMISORA DE PERSONAS RELACIONADAS (RELEVANTES Y NO RELEVANTES)

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
2	3210	ImporteN>0	clase in [10101, 10102, 10201, 10204, 10205, 10212, 10213, 10214, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 115000,115005,115010,115020,115030, 115040,115050,115060,115070,115080, 115090,115100,115105,115110,115120]
3	3211	(ImporteRC3>0) and (CPersonaRel in Catalogo de personas relacionadas)	TipoRel<>9
4	3212	(clase = 10101, 10102, 10201, 10204, 10205, 10212, 10213, 10214, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007,115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115090,115100,115105,115110,115120)	(0<Importe) and (Importe<>ImporteP) and (ImporteN<>0)
5	3213	ImporteRC3>0	FechaC<>2
6	3214	((GRiesgo=54) or (GRiesgo=56) or (GRiesgo=58) or (GRiesgo=60) or (GRiesgo=62) or (GRiesgo=64) or (GRiesgo=81) or (GRiesgo=83) or (GRiesgo=85) or (GRiesgo=87) or (GRiesgo=89) or (GRiesgo=93) or (GRiesgo=130) or (GRiesgo=132) or (GRiesgo=134),or (GRiesgo=136) ,or (GRiesgo=138), or (GRiesgo=141),or (GRiesgo=143),or (GRiesgo=145),or (GRiesgo=147)) and (ImporteN = 0) and (ImporteP>(Garantía+Aval+Reserva))	(Importe RC1<>0) and ((ImporteRC2+ImporteRC3)=0))
6	3215	(Importe RC1=0) and ((ImporteRC2+ImporteRC3)>0)) and ImporteP<(Garantía+Aval+Reserva)	((GRiesgo<>54) or (GRiesgo<>56) or (GRiesgo<>58) or (GRiesgo<>60) or (GRiesgo<>62) or (GRiesgo<>64) or (GRiesgo<>81) or (GRiesgo<>83) or (GRiesgo<>85) or (GRiesgo<>87) or (GRiesgo<>89) or (GRiesgo<>93) or (GRiesgo<>130) or (GRiesgo<>132) or (GRiesgo<>134),or (GRiesgo<>136) ,or (GRiesgo<>138), or (GRiesgo<>141),or (GRiesgo<>143),or (GRiesgo<>145),or (GRiesgo<>147)) and (ImporteN <> 0)
7	3216	clase pertenezca a { 10101, 10102, 10201, 10204, 10205, 10212, 10213, 10214, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,1	((ImporteP-(Reserva + Aval + Garantía)) <> (ImporteRC1 + ImporteRC2+ ImporteRC3)

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
		15080,115090,115100,115105,115110,115120} and (Reserva + Aval + Garantía) >= 0 and (Reserva + Aval + Garantía)<ImpP	
8	3217	(Clase in {10315,…,10319}) or (Clase in {10402,…,10406} or clase in {104041 al 104043} or clase in {104051 al 104055} or clase in {104061 al104065} or clase in { 104068 al 104072}) and (Importe > ImportePO)	ImporteP<> (Importe-ImportePO)
9	3218	(Clase in {10315,…,10319}) or (Clase in {10402,…,10406} or clase in {104041 al 104043} or clase in {104051 al 104055} or clase in {104061 al104065} or clase in { 104068 al 104072}) and (Importe <= ImportePO)	ImporteN <>|Importe-ImportePO|
10	3219	(GRiesgo= 55) or (GRiesgo=56) and (PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31)	Grado<> 11
11	3220	(GRiesgo= 55) or (GRiesgo=56) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	Grado<> 11 or 12 or 13 or 14 or 15 or 16
12	3221	(GRiesgo = 57) or (GRiesgo=58) and ((PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31))	Grado <>12
13	3222	(GRiesgo = 57) or (GRiesgo=58) and (PlazoCalif=10)	Grado<>10
14	3223	(GRiesgo = 59) or (GRiesgo=60) and ((PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31))	Grado<>13
15	3224	(GRiesgo = 61) or (GRiesgo=62) and ((PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31))	Grado <>14
16	3225	(GRiesgo = 63) or (GRiesgo=64) and ((PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31))	Grado<>15
17	3226	(GRiesgo = 80) or (GRiesgo=81) and ((PlazoCalif=20) or(PlazoCalif=30))	(Grado<>11) or (Grado<>12)
18	3227	(GRiesgo = 80) or (GRiesgo=81) and ((PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31))	Grado<>11
19	3228	(GRiesgo = 82) or (GRiesgo=83) and ((PlazoCalif=20) or(PlazoCalif=30))	(Grado<>12) or (Grado<>13)
20	3229	(GRiesgo = 82) or (GRiesgo=83) and ((PlazoCalif=21) or(PlazoCalif=31))	Grado<>12
21	3230	(GRiesgo =84) or (GRiesgo= 85) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	(Grado<>13) or (Grado<> 14) or (Grado<>15)
22	3231	(GRiesgo =84) or (GRiesgo= 85) and (PlazoCalif=10)	Grado<>10
23	3232	(GRiesgo =84) or (GRiesgo= 85) and (PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31)	Grado<>13

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
24	3233	(GRiesgo =86) or (GRiesgo= 87) and (PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31)	Grado<>14
25	3234	(GRiesgo =88) or (GRiesgo= 89) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	(Grado<>15) or (Grado<>16)
26	3235	(GRiesgo =88) or (GRiesgo= 89) and (PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31)	Grado<>15
27	3236	(GRiesgo not in {0,54,56,58,60,62,64,81,83,85,87,89, 93,130,132,134,136,138,141,143,145 ,147, 112, 114, 116 , 120, 158}) and (ImporteN = 0) and (ImporteP>(Garantía+Aval+Reserva))	(Importe RC1+ImporteRC3=0) and (ImporteRC2<>0)
27	3237	(Importe RC1+ImporteRC3>0) and (ImporteRC2=0), and (ImporteP>(Garantía+Aval+Reserva))	GRiesgo in {0,54,56,58,60,62,64,81,83,85,87,89,93,130,132,134,136,138,141,143,145,147, 112, 114, 116 , 120, 158} and (ImporteN <> 0)
29	3239		Importe+ ImportePO + ImporteP + ImporteN + ImporteRC1 + ImporteRC2 + ImporteRC3 =0
30	3240	si clase pertenece a (10101, 10102, 10201, 10204, 10205, 10212, 10213, 10214, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115090,115100,115105,115110,115120) and (Reserva + Aval + Garantía) >0	ImporteP <(Reserva + Aval + Garantía)
31	3241	(ImporteRC1+ImporteRC2)>0	ImporteRC1= ImporteRC2
127	3317	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10201,10212,10213,10214,10204,10205, 10407,10408,10409,10410, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115090,115100,115105,115110,11512]	Reserva<>0
128	3318	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10201,10204,10205, 10212,10213,10214, 105002, 105003, 105004, 105005, 105006, 105007, 115000,115005,115010,115020,115030,115040,115050,115060,115070,1	Reserva=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
		15080,115090,115100,115105,115110,115120]	
129	3319	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043,104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Tmercado =10
130	3320	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043,104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Tmercado <> 10
131	3321	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10201,10212,10213,10214,10204,10205]	IDOperacio<>1
132	3322	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IDCompensa =1
133	3323	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043,104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092,	IDCompensa <>1

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
		104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098, 104099]	
134	3324	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Plazoremanente=0
135	3325	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043,104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	Plazoremanente<>0
136	3326	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043,104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	NocionalE=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
137	3327	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	NocionalE<>0
138	3328	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IdGarantia=10
139	3329	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051, 104052, 104053, 104054, 104055, 104061, 104062, 104063, 104064, 104065, 104068, 104069, 104070, 104071,104072, 104075, 104076, 104077, 104078, 104079, 104082, 104083, 104084 , 104085, 104086, 10419, 10420, 104089, 104090, 104091, 104092, 104093, 104094, 104095, 104096, 104097, 104098]	IdGarantia<>10
140	3330	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10402, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104052,104053,104054,104055, 104062,104063,104064,104065, 104069,104070,104071,104072, 104076,104077,104078, 104079, 104083,104084 ,104085,104086,10419,10420,]	Valor añadido=0

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
141	3331	Si campo clase de operación (Clase) NO pertenece a [10402, 10403, 10419, 10420, 104041, 104042, 104043, 104051,104052,104053,104054,104055,104061,104062,104063,104064,104065,104068, 104069,104070,104071,104072,104075, 104076,104077,104078, 104079,104082,104083,104084,104085,104086]	Valor añadido<>0
144	3334	(GRiesgo= 0) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	Grado<>10
145	3335	(GRiesgo= 0) and (PlazoCalif=21) or (PlazoCalif=31)	Grado<>10
146	3336	(GRiesgo =92) or (GRiesgo= 93) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	Grado<>10
147	3337	(GRiesgo = 92) or (GRiesgo=93) and ((PlazoCalif=21) or(PlazoCalif=31))	Grado<>10
148	3338	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [140,149]	Grado<>10
149	3339	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [152,153]	Grado<>10
150	3340	SI campo Grupo de Riesgo (Griesgo)= [154,155]	Grado<>10
151	3341	(GRiesgo =130) or (GRiesgo= 131),or (GRiesgo= 132),or (GRiesgo= 133),or (GRiesgo= 134),or (GRiesgo= 135),or (GRiesgo= 136),or (GRiesgo= 137),or (GRiesgo= 138),or (GRiesgo= 139),or (GRiesgo= 141),or (GRiesgo= 142),or (GRiesgo= 143),or (GRiesgo= 144),or (GRiesgo= 145),or (GRiesgo= 146),or (GRiesgo= 147),or (GRiesgo= 148) and (PlazoCalif=20) or (PlazoCalif=30)	Grado<>10
152	3342	(GRiesgo =130) or (GRiesgo= 131),or (GRiesgo= 132),or (GRiesgo= 133),or (GRiesgo= 134),or (GRiesgo= 135),or (GRiesgo= 136),or (GRiesgo= 137),or (GRiesgo= 138),or (GRiesgo= 139),or (GRiesgo= 141),or (GRiesgo= 142),or (GRiesgo= 143),or (GRiesgo= 144),or (GRiesgo= 145),or (GRiesgo= 146),or (GRiesgo= 147),or (GRiesgo= 148) and ((PlazoCalif=21) or(PlazoCalif=31))	Grado<>10

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
156	3346	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [104051,104061,104068,104075,104082,] y campo Plazo remanente (Plazo remanente)= 1	Valor añadido<>0
161	3363	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10403, 104051,104061,104068, 104075, 104082, 104089, 104094] y Plazo Remanente = 1	Valor añadido<>0
162	3364	Si campo clase de operación (Clase) pertenece a [10403, 104051,104061,104068, 104075, 104082,] y Plazo Remanente <> 1 y <> 0	Valor añadido=0
173	3375	RC15A.[CPersonaRel] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 3	Griesgo <> {53 a 64,130 a149}
174	3376	RC15A.[CPersonaRel] join Catálogo de Contrapartes de Valores [clave_ente] , SI Catálogo de Contrapartes de Valores. [clave_grupo_riesgo] = 7	Griesgo <> {79 a 89, 110 a 120, 152,153, 164,165}
549	3385	El valor del Campo (GRiesgo) = 167	El valor del Campo (GRiesgo) no es válido para esta sección
552	3443	Clase in {105002,115040}	Griesgo<>172
553	3444	Clase=105003	Griesgo<>173
554	3445	Clase in {105004,115050}	Griesgo<>174
555	3446	Clase=105005	Griesgo<>175
556	3447	Clase=105006	Griesgo<>176
557	3448	Clase in {105007, 115030, 115060}	Griesgo<>177
560	3451	Clase in {115000, 115005, 115010, 115080}	Griesgo<>170
561	3452	Clase in {115020, 115090}	Griesgo in [170 a 179]
562	3453	Clase=115070	Griesgo<>180
563	3454	Clase in {115100, 115105, 115110, 115120}	Griesgo<>[158,159]

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
564	3455		Clase in {105000, 105001, 105008, 105009}
565	3456	Clase in {10204, 10205}	TipoTrat<>{6,7}
566	3457	Clase in {105002,105003,105004, 105005, 105006, 105007}	TipoTrat<>{4,5}
567	3458	Clase {115000, 115005,115010,115030,115040,115050,115060,115070,115080,115100,115105,115110,115120}	TipoTrat<>{4,5}
568	3459	Clase in {115020, 115090}	TipoTrat<>7
569	3460	TipoTrat=8	Clase in {10201 a 10204, 10212 a 10214, 105001 a 105009, 115000 a115120}
570	3461	Clase in {10201,10212,10213,10214}	TipoTrat<>7
571	3462	TipoTrat in {6, 7}	Griesgo in [170 a 180]
572	3463	Clase in {10101 a 10320,10407 a 10463,10501,10502,104099 } and TipoTrat= {6,7,8} and Etiq_Periodo_Paralelo<> 2	Griesgo not in {0, 53 a 64, 75, 76, 80 a 89, 92, 93, 111 a 120, 130 a 139, 141 a 148, 158, 159}
52	3483	Fecha >= 2021/01/31	Situacion in (1,2,3,4)

RC15 SECCIÓN B, RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR AJUSTE DE VALUACIÓN CREDITICIA DE OPERACIONES RELACIONADAS

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
123	3313	SI campo (Ndcont) <>0	Mcob=0
124	3314	SI campo (Mcob) <>0	Ndcont=0
125	3315	SI campo (Ndind) <>0	Mind=0
126	3316	SI campo (Mind) <>0	Ndind=0
545	3381	El valor del Campo (GradRiesgoCont) = 17	El valor del Campo (GradRiesgoCont) no es válido para esta sección

RC17 RELATIVO A LAS OPERACIONES CON MERCANCÍAS, CON RIESGO DE MERCADO

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3351	IdSeccion=RC17	Importe2<>0
2	3352	IdSeccion=RC17	Importe1=0

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

RC18 RELATIVO A LAS OPERACIONES SOBRE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES SUJETAS A REQUERIMIENTO POR IMPACTO GAMMA Y VEGA

No. Valid	Identificador	Condición Previa (Si)	Condición Base (Entonces)
1	3353	IdSeccion=RC18	(Importe1+Importe2=0)

USO LIMITADO

Etapa: Validaciones al Interior de la sección.

i. Objetivo de la validación

Verificar la integridad de la información del formulario RCs, a través de la consistencia aritmética entre conceptos de una misma sección, que guardan una relación directa.

ii. Validaciones por sección en riesgo de mercado

A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

a) (AB) Activo Bruto, (AC) Activo Compensable

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>1</td><td>ABC_1</td><td>ERROR ID 1. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPERACIONES FECHA-VALOR DE REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO, DIVISAS, Y VALORES, (AC) COMPENSACION DE DINERO EN COMPRA-VENTA DE VALORES Y DIVISAS, ASI COMO REPORTOS DE TITULOS

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>1</td><td>A</td><td></td><td>40195</td></tr>
<tr><td>1</td><td>A</td><td>10195</td><td>40197</td></tr>
<tr><td>1</td><td>A</td><td>10200</td><td>40200</td></tr>
<tr><td>1</td><td>A</td><td>10202</td><td>40212</td></tr>
<tr><td>1</td><td>A</td><td>10250</td><td>40250</td></tr>
<tr><td>1</td><td>B</td><td>16145</td><td>46145</td></tr>
<tr><td>1</td><td>B</td><td>16147</td><td>46146</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
2	ABC_2	ERROR ID 2. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADOR , (AC) COMPENSACIONES DE MONEDA A RECIBIR REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADOR ***Algoritmo:*** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
2	A	10550	40550
2	A	10552	40552
2	A	10554	40554
2	A	10556	40556
2	A	10558	40558
2	A	10560	40560
2	A	10562	40562
2	A	10564	40564
2	A	10566	40566
2	A	10568	40568
2	A	10570	40570
2	A	10572	40572
2	A	10574	40574
2	A	10576	40576
2	B	16150	46150
2	B	16152	46152
2	B	16154	46154
2	B	16156	46156
2	B	16158	46158
2	B	16160	46160
2	B	16162	46162
2	B	16164	46164
2	B	16166	46166
2	B	16168	46168
2	B	16170	46170
2	B	16172	46172
2	B	16174	46174
2	B	16176	46176

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	ABC_3	ERROR ID 3. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPERACIONES FECHA-VALOR DE COMPRA DE VALORES, PRÉSTAMOS, REPORTOS Y TENENCIA DE TÍTULOS , (AC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC02	RC11
3	A	10300	30300	40300	20300	110300
3	A	10302	30302	40302	20302	110302
3	A	10304	30304	40304	20304	110304
3	A	10306	30306	40306	20306	110306
3	A	10308	30308	40308	20308	110308
3	A	10310	30310	40310	20310	110310
3	A	10312	30312	40312	20312	110312
3	A	10314	30314	40314	20314	110314
3	A	10316	30316	40316	20316	110316
3	A	10318	30318	40318	20318	110318
3	A	10320	30320	40320	20320	110320
3	A	10322	30322	40322	20322	110322
3	A	10324	30324	40324	20324	110324
3	A	10326	30326	40326	20326	110326
3	A	10350	30350	40350	20350	110350
3	A	10352	30352	40352	20352	110352
3	A	10354	30354	40354	20354	110354
3	A	10356	30356	40356	20356	110356
3	A	10358	30358	40358	20358	110358
3	A	10360	30360	40360	20360	110360
3	A	10362	30362	40362	20362	110362
3	A	10364	30364	40364	20364	110364
3	A	10366	30366	40366	20366	110366
3	A	10368	30368	40368	20368	110368
3	A	10370	30370	40370	20370	110370
3	A	10372	30372	40372	20372	110372
3	A	10374	30374	40374	20374	110374
3	A	10376	30376	40376	20376	110376
3	A	10400	30400	40400	20400	110400
3	A	10402	30402	40402	20402	110402
3	A	10404	30404	40404	20404	110404

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*							Nivel
	3	A	10406	30406	40406	20406	110406		
	3	A	10408	30408	40408	20408	110408		
	3	A	10410	30410	40410	20410	110410		
	3	A	10412	30412	40412	20412	110412		
	3	A	10414	30414	40414	20414	110414		
	3	A	10416	30416	40416	20416	110416		
	3	A	10418	30418	40418	20418	110418		
	3	A	10420	30420	40420	20420	110420		
	3	A	10422	30422	40422	20422	110422		
	3	A	10424	30424	40424	20424	110424		
	3	A	10426	30426	40426	20426	110426		
	3	A	10450	30450	40450	20450	110450		
	3	A	10452	30452	40452	20452	110452		
	3	A	10454	30454	40454	20454	110454		
	3	A	10456	30456	40456	20456	110456		
	3	A	10458	30458	40458	20458	110458		
	3	A	10460	30460	40460	20460	110460		
	3	A	10462	30462	40462	20462	110462		
	3	A	10464	30464	40464	20464	110464		
	3	A	10466	30466	40466	20466	110466		
	3	A	10468	30468	40468	20468	110468		
	3	A	10470	30470	40470	20470	110470		
	3	A	10472	30472	40472	20472	110472		
	3	A	10474	30474	40474	20474	110474		
	3	A	10476	30476	40476	20476	110476		
	3	A	10500	30500	40500	20500	110500		
	3	A	10502	30502	40502	20502	110502		
	3	A	10504	30504	40504	20504	110504		
	3	A	10506	30506	40506	20506	110506		
	3	A	10508	30508	40508	20508	110508		
	3	A	10510	30510	40510	20510	110510		
	3	A	10512	30512	40512	20512	110512		
	3	A	10514	30514	40514	20514	110514		
	3	A	10516	30516	40516	20516	110516		
	3	A	10518	30518	40518	20518	110518		
	3	A	10520	30520	40520	20520	110520		
	3	A	10522	30522	40522	20522	110522		
	3	A	10524	30524	40524	20524	110524		
	3	A	10526	30526	40526	20526	110526		
	3	A	10600	30600	40600	20600	110600		
	3	A	10602	30602	40602	20602	110602		
	3	A	10604	30604	40604	20604	110604		
	3	A	10606	30606	40606	20606	110606		
	3	A	10608	30608	40608	20608	110608		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
	3	A	10610	30610	40610	20610	110610	
	3	A	10612	30612	40612	20612	110612	
	3	A	10614	30614	40614	20614	110614	
	3	A	10616	30616	40616	20616	110616	
	3	A	10618	30618	40618	20618	110618	
	3	A	10620	30620	40620	20620	110620	
	3	A	10622	30622	40622	20622	110622	
	3	A	10624	30624	40624	20624	110624	
	3	A	10626	30626	40626	20626	110626	
	3	B	16180	36180	46180	26000	116180	
	3	B	16182	36182	46182	26002	116182	
	3	B	16184	36184	46184	26004	116184	
	3	B	16186	36186	46186	26006	116186	
	3	B	16188	36188	46188	26008	116188	
	3	B	16190	36190	46190	26010	116190	
	3	B	16192	36192	46192	26012	116192	
	3	B	16194	36194	46194	26014	116194	
	3	B	16196	36196	46196	26016	116196	
	3	B	16198	36198	46198	26018	116198	
	3	B	16200	36200	46200	26020	116200	
	3	B	16202	36202	46202	26022	116202	
	3	B	16204	36204	46204	26024	116204	
	3	B	16206	36206	46206	26026	116206	
	3	B	16210	36210	46210		-	
	3	B	16212	36212	46212		-	
	3	B	16214	36214	46214		-	
	3	B	16216	36216	46216		-	
	3	B	16218	36218	46218		-	
	3	B	16220	36220	46220		-	
	3	B	16222	36222	46222		-	
	3	B	16224	36224	46224		-	
	3	B	16226	36226	46226		-	
	3	B	16228	36228	46228		-	
	3	B	16230	36230	46230		-	
	3	B	16232	36232	46232		-	
	3	B	16234	36234	46234		-	
	3	B	16236	36236	46236		-	
	3	B	16810	36810	46870			
	3	B	16812	36812	46872			
	3	B	16814	36814	46874			
	3	B	16816	36816	46876			
	3	B	16818	36818	46878			
	3	B	16820	36820	46880			
	3	B	16822	36822	46882			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3	B	16824	36824	46884		
3	B	16826	36826	46886		
3	B	16828	36828	46888		
3	B	16830	36830	46890		
3	B	16832	36832	46892		
3	B	16834	36834	46894		
3	B	16836	36836	46896		
3	B	16840	36840	46900		
3	B	16842	36842	46902		
3	B	16844	36844	46904		
3	B	16846	36846	46906		
3	B	16848	36848	46908		
3	B	16850	36850	46910		
3	B	16852	36852	46912		
3	B	16854	36854	46914		
3	B	16856	36856	46916		
3	B	16858	36858	46918		
3	B	16860	36860	46920		
3	B	16862	36862	46922		
3	B	16864	36864	46924		
3	B	16866	36866	46926		

4 ABC_4

ERROR ID 4. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
4	A	10630	30630	40630
4	A	10632	30632	40632
4	A	10634	30634	40634
4	A	10636	30636	40636
4	A	10638	30638	40638
4	A	10640	30640	40640
4	A	10642	30642	40642
4	A	10644	30644	40644
4	A	10646	30646	40646

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

4	A	10648	30648	40648	
4	A	10650	30650	40650	
4	A	10652	30652	40652	
4	A	10654	30654	40654	
4	A	10656	30656	40656	
4	A	10690	30690	40690	
4	A	10692	30692	40692	
4	A	10694	30694	40694	
4	A	10696	30696	40696	
4	A	10698	30698	40698	
4	A	10700	30700	40700	
4	A	10702	30702	40702	
4	A	10704	30704	40704	
4	A	10706	30706	40706	
4	A	10708	30708	40708	
4	A	10710	30710	40710	
4	A	10712	30712	40712	
4	A	10714	30714	40714	
4	A	10716	30716	40716	
4	B	16240	36240	46240	
4	B	16242	36242	46242	
4	B	16244	36244	46244	
4	B	16246	36246	46246	
4	B	16248	36248	46248	
4	B	16250	36250	46250	
4	B	16252	36252	46252	
4	B	16254	36254	46254	
4	B	16256	36256	46256	
4	B	16258	36258	46258	
4	B	16260	36260	46260	
4	B	16262	36262	46262	
4	B	16264	36264	46264	
4	B	16266	36266	46266	

5	ABC_5	ERROR ID 5. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
5	A	10660	30660	40660
5	A	10662	30662	40662
5	A	10664	30664	40664
5	A	10666	30666	40666
5	A	10668	30668	40668
5	A	10670	30670	40670
5	A	10672	30672	40672
5	A	10674	30674	40674
5	A	10676	30676	40676
5	A	10678	30678	40678
5	A	10680	30680	40680
5	A	10682	30682	40682
5	A	10684	30684	40684
5	A	10686	30686	40686
5	A	10720	30720	40720
5	A	10722	30722	40722
5	A	10724	30724	40724
5	A	10726	30726	40726
5	A	10728	30728	40728
5	A	10730	30730	40730
5	A	10732	30732	40732
5	A	10734	30734	40734
5	A	10736	30736	40736
5	A	10738	30738	40738
5	A	10740	30740	40740
5	A	10742	30742	40742
5	A	10744	30744	40744
5	A	10746	30746	40746
5	B	16270	36270	46270
5	B	16272	36272	46272
5	B	16274	36274	46274
5	B	16276	36276	46276
5	B	16278	36278	46278
5	B	16280	36280	46280
5	B	16282	36282	46282
5	B	16284	36284	46284
5	B	16286	36286	46286
5	B	16288	36288	46288
5	B	16290	36290	46290
5	B	16292	36292	46292
5	B	16294	36294	46294

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

	5	B	16296	36296	46296

6	ABC_6	ERROR ID 6. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
6	A	10750	40780
6	A	10752	40782
6	A	10754	40784
6	A	10756	40786
6	A	10758	40788
6	A	10760	40790
6	A	10762	40792
6	A	10764	40794
6	A	10766	40796
6	A	10768	40798
6	A	10770	40800
6	A	10772	40802
6	A	10774	40804
6	A	10776	40806
6	A	10780	40840
6	A	10782	40842
6	A	10784	40844
6	A	10786	40846
6	A	10788	40848
6	A	10790	40850
6	A	10792	40852
6	A	10794	40854
6	A	10796	40856
6	A	10798	40858
6	A	10800	40860
6	A	10802	40862

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		6	A	10804	40864
		6	A	10806	40866
		6	B	16300	46330
		6	B	16302	46332
		6	B	16304	46334
		6	B	16306	46336
		6	B	16308	46338
		6	B	16310	46340
		6	B	16312	46342
		6	B	16314	46344
		6	B	16316	46346
		6	B	16318	46348
		6	B	16320	46350
		6	B	16322	46352
		6	B	16324	46354
		6	B	16326	46356

7 ABC_7 ERROR ID 7. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
7	A	11806	30810	41806	110630
7	A	11807	30812	41807	110632
7	A	11808	30814	41808	110634
7	A	11809	30816	41809	110636
7	A	11810	30818	41810	110638
7	A	11811	30820	41811	110640
7	A	11812	30822	41812	110642
7	A	11813	30824	41813	110644
7	A	11814	30826	41814	110646
7	A	11815	30828	41815	110648
7	A	11816	30830	41816	110650
7	A	11817	30832	41817	110652
7	A	11818	30834	41818	110654
7	A	11819	30836	41819	110656
7	A	11866	30870	41866	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

7	A	11867	30872	41867		
7	A	11868	30874	41868		
7	A	11869	30876	41869		
7	A	11870	30878	41870		
7	A	11871	30880	41871		
7	A	11872	30882	41872		
7	A	11873	30884	41873		
7	A	11874	30886	41874		
7	A	11875	30888	41875		
7	A	11876	30890	41876		
7	A	11877	30892	41877		
7	A	11878	30894	41878		
7	A	11879	30896	41879		
7	B	16041	36330	47326	116240	
7	B	16042	36332	47327	116242	
7	B	16043	36334	47328	116244	
7	B	16044	36336	47329	116246	
7	B	16045	36338	47330	116248	
7	B	16046	36340	47331	116250	
7	B	16047	36342	47332	116252	
7	B	16048	36344	47333	116254	
7	B	16049	36346	47334	116256	
7	B	16050	36348	47335	116258	
7	B	16051	36350	47336	116260	
7	B	16052	36352	47337	116262	
7	B	16053	36354	47338	116264	
7	B	16054	36356	47339	116266	

8 ABC_8 ERROR ID 8. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
8	A	11821	30840	41821	110660
8	A	11822	30842	41822	110662

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
		8	A	11823	30844	41823	110664	
		8	A	11824	30846	41824	110666	
		8	A	11825	30848	41825	110668	
		8	A	11826	30850	41826	110670	
		8	A	11827	30852	41827	110672	
		8	A	11828	30854	41828	110674	
		8	A	11829	30856	41829	110676	
		8	A	11830	30858	41830	110678	
		8	A	11831	30860	41831	110680	
		8	A	11832	30862	41832	110682	
		8	A	11833	30864	41833	110684	
		8	A	11834	30866	41834	110686	
		8	A	11881	30900	41881		
		8	A	11882	30902	41882		
		8	A	11883	30904	41883		
		8	A	11884	30906	41884		
		8	A	11885	30908	41885		
		8	A	11886	30910	41886		
		8	A	11887	30912	41887		
		8	A	11888	30914	41888		
		8	A	11889	30916	41889		
		8	A	11890	30918	41890		
		8	A	11891	30920	41891		
		8	A	11892	30922	41892		
		8	A	11893	30924	41893		
		8	A	11894	30926	41894		
		8	B	16056	36360	47341	116270	
		8	B	16057	36362	47342	116272	
		8	B	16058	36364	47343	116274	
		8	B	16059	36366	47344	116276	
		8	B	16060	36368	47345	116278	
		8	B	16061	36370	47346	116280	
		8	B	16062	36372	47347	116282	
		8	B	16063	36374	47348	116284	
		8	B	16064	36376	47349	116286	
		8	B	16065	36378	47350	116288	
		8	B	16066	36380	47351	116290	
		8	B	16067	36382	47352	116292	
		8	B	16068	36384	47353	116294	
		8	B	16069	36386	47354	116296	
9	ABC_9	ERROR ID 9. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) PAQUETES DE CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA						Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
9	A	10930	30930	40990
9	A	10932	30932	40992
9	A	10934	30934	40994
9	A	10936	30936	40996
9	A	10938	30938	40998
9	A	10940	30940	41000
9	A	10942	30942	41002
9	A	10944	30944	41004
9	A	10946	30946	41006
9	A	10948	30948	41008
9	A	10950	30950	41010
9	A	10952	30952	41012
9	A	10954	30954	41014
9	A	10956	30956	41016
9	A	10990	30990	41050
9	A	10992	30992	41052
9	A	10994	30994	41054
9	A	10996	30996	41056
9	A	10998	30998	41058
9	A	11000	31000	41060
9	A	11002	31002	41062
9	A	11004	31004	41064
9	A	11006	31006	41066
9	A	11008	31008	41068
9	A	11010	31010	41070
9	A	11012	31012	41072
9	A	11014	31014	41074
9	A	11016	31016	41076
9	B	16390	36390	46420
9	B	16392	36392	46422
9	B	16394	36394	46424
9	B	16396	36396	46426
9	B	16398	36398	46428

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

9	B	16400	36400	46430
9	B	16402	36402	46432
9	B	16404	36404	46434
9	B	16406	36406	46436
9	B	16408	36408	46438
9	B	16410	36410	46440
9	B	16412	36412	46442
9	B	16414	36414	46444
9	B	16416	36416	46446
9	B	16420	36420	46450
9	B	16422	36422	46452
9	B	16424	36424	46454
9	B	16426	36426	46456
9	B	16428	36428	46458
9	B	16430	36430	46460
9	B	16432	36432	46462
9	B	16434	36434	46464
9	B	16436	36436	46466
9	B	16438	36438	46468
9	B	16440	36440	46470
9	B	16442	36442	46472
9	B	16444	36444	46474
9	B	16446	36446	46476
9	B	16960	36870	46930
9	B	16962	36872	46932
9	B	16964	36874	46934
9	B	16966	36876	46936
9	B	16968	36878	46938
9	B	16970	36880	46940
9	B	16972	36882	46942
9	B	16974	36884	46944
9	B	16976	36886	46946
9	B	16978	36888	46948
9	B	16980	36890	46950
9	B	16982	36892	46952
9	B	16984	36894	46954
9	B	16986	36896	46956

10	ABC_10	ERROR ID 10. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) PAQUETES DE CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES DE PAQUETES FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
10	A	10960	30960	41020
10	A	10962	30962	41022
10	A	10964	30964	41024
10	A	10966	30966	41026
10	A	10968	30968	41028
10	A	10970	30970	41030
10	A	10972	30972	41032
10	A	10974	30974	41034
10	A	10976	30976	41036
10	A	10978	30978	41038
10	A	10980	30980	41040
10	A	10982	30982	41042
10	A	10984	30984	41044
10	A	10986	30986	41046
10	A	11020	31020	41080
10	A	11022	31022	41082
10	A	11024	31024	41084
10	A	11026	31026	41086
10	A	11028	31028	41088
10	A	11030	31030	41090
10	A	11032	31032	41092
10	A	11034	31034	41094
10	A	11036	31036	41096
10	A	11038	31038	41098
10	A	11040	31040	41100
10	A	11042	31042	41102
10	A	11044	31044	41104
10	A	11046	31046	41106
10	B	16450	36450	46480
10	B	16452	36452	46482
10	B	16454	36454	46484
10	B	16456	36456	46486
10	B	16458	36458	46488
10	B	16460	36460	46490
10	B	16462	36462	46492

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

10	B	16464	36464	46494
10	B	16466	36466	46496
10	B	16468	36468	46498
10	B	16470	36470	46500
10	B	16472	36472	46502
10	B	16474	36474	46504
10	B	16476	36476	46506

11 ABC_11 ERROR ID 11. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE OTROS SUBYACENTES , (AC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE OTROS SUBYACENTES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
11	A	11926	31050	41926	111080
11	A	11927	31052	41927	111082
11	A	11928	31054	41928	111084
11	A	11929	31056	41929	111086
11	A	11930	31058	41930	111088
11	A	11931	31060	41931	111090
11	A	11932	31062	41932	111092
11	A	11933	31064	41933	111094
11	A	11934	31066	41934	111096
11	A	11935	31068	41935	111098
11	A	11936	31070	41936	111100
11	A	11937	31072	41937	111102
11	A	11938	31074	41938	111104
11	A	11939	31076	41939	111106
11	B	16101	36480	47386	116510
11	B	16102	36482	47387	116512
11	B	16103	36484	47388	116514
11	B	16104	36486	47389	116516
11	B	16105	36488	47390	116518
11	B	16106	36490	47391	116520
11	B	16107	36492	47392	116522

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

11	B	16108	36494	47393	116524	
11	B	16109	36496	47394	116526	
11	B	16110	36498	47395	116528	
11	B	16111	36500	47396	116530	
11	B	16112	36502	47397	116532	
11	B	16113	36504	47398	116534	
11	B	16114	36506	47399	116536	

12 ABC_12 ERROR ID 12. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE TASA DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES FIJA — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
12	A	11080	31080	41140
12	A	11082	31082	41142
12	A	11084	31084	41144
12	A	11086	31086	41146
12	A	11088	31088	41148
12	A	11090	31090	41150
12	A	11092	31092	41152
12	A	11094	31094	41154
12	A	11096	31096	41156
12	A	11098	31098	41158
12	A	11100	31100	41160
12	A	11102	31102	41162
12	A	11104	31104	41164
12	A	11106	31106	41166
12	B	16510	36510	46540
12	B	16512	36512	46542
12	B	16514	36514	46544
12	B	16516	36516	46546
12	B	16518	36518	46548
12	B	16520	36520	46550

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		12	B	16522	36522	46552	
		12	B	16524	36524	46554	
		12	B	16526	36526	46556	
		12	B	16528	36528	46558	
		12	B	16530	36530	46560	
		12	B	16532	36532	46562	
		12	B	16534	36534	46564	
		12	B	16536	36536	46566	
		12	B	16540	36540	46570	
		12	B	16542	36542	46572	
		12	B	16544	36544	46574	
		12	B	16546	36546	46576	
		12	B	16548	36548	46578	
		12	B	16550	36550	46580	
		12	B	16552	36552	46582	
		12	B	16554	36554	46584	
		12	B	16556	36556	46586	
		12	B	16558	36558	46588	
		12	B	16560	36560	46590	
		12	B	16562	36562	46592	
		12	B	16564	36564	46594	
		12	B	16566	36566	46596	
		12	B	16990	36900	46960	
		12	B	16992	36902	46962	
		12	B	16994	36904	46964	
		12	B	16996	36906	46966	
		12	B	16998	36908	46968	
		12	B	17000	36910	46970	
		12	B	17002	36912	46972	
		12	B	17004	36914	46974	
		12	B	17006	36916	46976	
		12	B	17008	36918	46978	
		12	B	17010	36920	46980	
		12	B	17012	36922	46982	
		12	B	17014	36924	46984	
		12	B	17016	36926	46986	
13	ABC_13	ERROR ID 13. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE TASA DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES VARIABLE ***Algoritmo*:**					Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
13	A	11110	31110	41170
13	A	11112	31112	41172
13	A	11114	31114	41174
13	A	11116	31116	41176
13	A	11118	31118	41178
13	A	11120	31120	41180
13	A	11122	31122	41182
13	A	11124	31124	41184
13	A	11126	31126	41186
13	A	11128	31128	41188
13	A	11130	31130	41190
13	A	11132	31132	41192
13	A	11134	31134	41194
13	A	11136	31136	41196
13	B	16570	36570	46600
13	B	16572	36572	46602
13	B	16574	36574	46604
13	B	16576	36576	46606
13	B	16578	36578	46608
13	B	16580	36580	46610
13	B	16582	36582	46612
13	B	16584	36584	46614
13	B	16586	36586	46616
13	B	16588	36588	46618
13	B	16590	36590	46620
13	B	16592	36592	46622
13	B	16594	36594	46624
13	B	16596	36596	46626

14	ABC_14	ERROR ID 14. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES EMISIÓN COMPRA DE TASAS DE INTERES CON OPCIONES DE TENENCIA COMPRA	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
14	A	11140	31140	41200
14	A	11142	31142	41202
14	A	11144	31144	41204
14	A	11146	31146	41206
14	A	11148	31148	41208
14	A	11150	31150	41210
14	A	11152	31152	41212
14	A	11154	31154	41214
14	A	11156	31156	41216
14	A	11158	31158	41218
14	A	11160	31160	41220
14	A	11162	31162	41222
14	A	11164	31164	41224
14	A	11166	31166	41226
14	B	16600	36600	46630
14	B	16602	36602	46632
14	B	16604	36604	46634
14	B	16606	36606	46636
14	B	16608	36608	46638
14	B	16610	36610	46640
14	B	16612	36612	46642
14	B	16614	36614	46644
14	B	16616	36616	46646
14	B	16618	36618	46648
14	B	16620	36620	46650
14	B	16622	36622	46652
14	B	16624	36624	46654
14	B	16626	36626	46656

15	ABC_15	ERROR ID 15. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE TASAS DE INTERES , (AC) COMPENSACIONES OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE TASAS DE INTERES CON OPCIONES DE EMISIÓN VENTA ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
15	A	11500	31380	41470
15	A	11502	31382	41472
15	A	11504	31384	41474
15	A	11506	31386	41476
15	A	11508	31388	41478
15	A	11510	31390	41480
15	A	11512	31392	41482
15	A	11514	31394	41484
15	A	11516	31396	41486
15	A	11518	31398	41488
15	A	11520	31400	41490
15	A	11522	31402	41492
15	A	11524	31404	41494
15	A	11526	31406	41496
15	B	17020	36930	46990
15	B	17022	36932	46992
15	B	17024	36934	46994
15	B	17026	36936	46996
15	B	17028	36938	46998
15	B	17030	36940	47000
15	B	17032	36942	47002
15	B	17034	36944	47004
15	B	17036	36946	47006
15	B	17038	36948	47008
15	B	17040	36950	47010
15	B	17042	36952	47012
15	B	17044	36954	47014
15	B	17046	36956	47016

16	ABC_16	ERROR ID 16. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) VENTA DE ACCIONES, TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES, Y TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A INDICES ACCIONARIOS (OPERACIONES FECHA VALOR 24,48,72 Y 96 HRS, PENDIENTESDE LIQUIDAR) , (AC) COMPENSACIONES DE VENTA DE ACCIONES, TITULOS DE DEUDA	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES, Y TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A INDICES ACCIONARIOS (FECHA VALOR PENDIENTES DE LIQUIDAR)

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>16</td><td>A</td><td>11771</td><td>41771</td></tr>
<tr><td>16</td><td>A</td><td>11772</td><td>41772</td></tr>
<tr><td>16</td><td>B</td><td>16006</td><td>47291</td></tr>
<tr><td>16</td><td>B</td><td>16007</td><td>47292</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>17</td><td>ABC_17</td><td>ERROR ID 17. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) VENTAS AL CONTADO DE MERCANCIAS , (AC) COMPENSACIONES DE VENTAS AL CONTADO DE MERCANCIAS

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>17</td><td>A</td><td>11774</td><td>41774</td></tr>
<tr><td>17</td><td>B</td><td>16009</td><td>47294</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>18</td><td>ABC_18</td><td>ERROR ID 18. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE DIVISAS , (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA DE DIVISAS CON OPCIONES DE TENENCIA COMPRA
Algoritmo:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
18	A	11200	41260
18	A	11202	41262
18	A	11204	41264
18	A	11206	41266
18	A	11208	41268
18	A	11210	41270
18	A	11212	41272
18	A	11214	41274
18	A	11216	41276
18	A	11218	41278
18	A	11220	41280
18	A	11222	41282
18	A	11224	41284
18	A	11226	41286
18	B	16660	46690
18	B	16662	46692
18	B	16664	46694
18	B	16666	46696
18	B	16668	46698
18	B	16670	46700
18	B	16672	46702
18	B	16674	46704
18	B	16676	46706
18	B	16678	46708
18	B	16680	46710
18	B	16682	46712
18	B	16684	46714
18	B	16686	46716

19	ABC_19	ERROR ID 19. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE DIVISAS , (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA DE DIVISAS CON OPCIONES DE EMISIÓN VENTA ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
19	A	11560	41530
19	A	11562	41532
19	A	11564	41534
19	A	11566	41536
19	A	11568	41538
19	A	11570	41540
19	A	11572	41542
19	A	11574	41544
19	A	11576	41546
19	A	11578	41548
19	A	11580	41550
19	A	11582	41552
19	A	11584	41554
19	A	11586	41556
19	B	17080	47050
19	B	17082	47052
19	B	17084	47054
19	B	17086	47056
19	B	17088	47058
19	B	17090	47060
19	B	17092	47062
19	B	17094	47064
19	B	17096	47066
19	B	17098	47068
19	B	17100	47070
19	B	17102	47072
19	B	17104	47074
19	B	17106	47076

20	ABC_20	ERROR ID 20. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FORWARDS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA). , (AC) FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
20	A	11776	41776
20	A	11777	41777
20	A	11778	41778
20	A	11779	41779
20	A	11780	41780
20	A	11781	41781
20	A	11782	41782
20	A	11783	41783
20	A	11784	41784
20	A	11785	41785
20	A	11786	41786
20	A	11787	41787
20	A	11788	41788
20	A	11789	41789
20	A	11836	41836
20	A	11837	41837
20	A	11838	41838
20	A	11839	41839
20	A	11840	41840
20	A	11841	41841
20	A	11842	41842
20	A	11843	41843
20	A	11844	41844
20	A	11845	41845
20	A	11846	41846
20	A	11847	41847
20	A	11848	41848
20	A	11849	41849
20	B	16011	47296
20	B	16012	47297

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

20	B	16013	47298
20	B	16014	47299
20	B	16015	47300
20	B	16016	47301
20	B	16017	47302
20	B	16018	47303
20	B	16019	47304
20	B	16020	47305
20	B	16021	47306
20	B	16022	47307
20	B	16023	47308
20	B	16024	47309

21	ABC_21	ERROR ID 21. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON OPCIONES DE EMISIÓN VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
21	A	12136	31440	42046	111140
21	A	12137	31442	42047	111142
21	A	12138	31444	42048	111144
21	A	12139	31446	42049	111146
21	A	12140	31448	42050	111148
21	A	12141	31450	42051	111150
21	A	12142	31452	42052	111152
21	A	12143	31454	42053	111154
21	A	12144	31456	42054	111156
21	A	12145	31458	42055	111158
21	A	12146	31460	42056	111160
21	A	12147	31462	42057	111162
21	A	12148	31464	42058	111164
21	A	12149	31466	42059	111166
21	B	17516	36990	47491	116600
21	B	17517	36992	47492	116602
21	B	17518	36994	47493	116604
21	B	17519	36996	47494	116606
21	B	17520	36998	47495	116608
21	B	17521	37000	47496	116610
21	B	17522	37002	47497	116612
21	B	17523	37004	47498	116614
21	B	17524	37006	47499	116616
21	B	17525	37008	47500	116618
21	B	17526	37010	47501	116620
21	B	17527	37012	47502	116622
21	B	17528	37014	47503	116624
21	B	17529	37016	47504	116626

2	ABC_22	ERROR ID 22. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FORWARDS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA). , (AC) FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Algoritmo:

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
22	A	11791	41791
22	A	11792	41792
22	A	11793	41793
22	A	11794	41794
22	A	11795	41795
22	A	11796	41796
22	A	11797	41797
22	A	11798	41798
22	A	11799	41799
22	A	11800	41800
22	A	11801	41801
22	A	11802	41802
22	A	11803	41803
22	A	11804	41804
22	A	11851	41851
22	A	11852	41852
22	A	11853	41853
22	A	11854	41854
22	A	11855	41855
22	A	11856	41856
22	A	11857	41857
22	A	11858	41858
22	A	11859	41859
22	A	11860	41860
22	A	11861	41861
22	A	11862	41862
22	A	11863	41863
22	A	11864	41864
22	B	16026	47311
22	B	16027	47312
22	B	16028	47313
22	B	16029	47314
22	B	16030	47315
22	B	16031	47316
22	B	16032	47317
22	B	16033	47318

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		22	B	16034	47319	
		22	B	16035	47320	
		22	B	16036	47321	
		22	B	16037	47322	
		22	B	16038	47323	
		22	B	16039	47324	
23	ABC_23	ERROR ID 23. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) SWAPS RELATIVOS A ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) , (AC) SWAPS RELATIVOS A ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
23	A	11896	41896
23	A	11897	41897
23	A	11898	41898
23	A	11899	41899
23	A	11900	41900
23	A	11901	41901
23	A	11902	41902
23	A	11903	41903
23	A	11904	41904
23	A	11905	41905
23	A	11906	41906
23	A	11907	41907
23	A	11908	41908
23	A	11909	41909
23	B	16071	47356
23	B	16072	47357
23	B	16073	47358
23	B	16074	47359
23	B	16075	47360
23	B	16076	47361
23	B	16077	47362
23	B	16078	47363
23	B	16079	47364
23	B	16080	47365
23	B	16081	47366
23	B	16082	47367

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

23	B	16083	47368
23	B	16084	47369

24 ABC_24 — Grave

ERROR ID 24. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL , (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
24	A	11290	31290	41380	111290
24	A	11292	31292	41382	111292
24	A	11294	31294	41384	111294
24	A	11296	31296	41386	111296
24	A	11298	31298	41388	111298
24	A	11300	31300	41390	111300
24	A	11302	31302	41392	111302
24	A	11304	31304	41394	111304
24	A	11306	31306	41396	111306
24	A	11308	31308	41398	111308
24	A	11310	31310	41400	111310
24	A	11312	31312	41402	111312
24	A	11314	31314	41404	111314
24	A	11316	31316	41406	111316
24	B	16750	36750	46810	116750
24	B	16752	36752	46812	116752
24	B	16754	36754	46814	116754
24	B	16756	36756	46816	116756
24	B	16758	36758	46818	116758
24	B	16760	36760	46820	116760
24	B	16762	36762	46822	116762
24	B	16764	36764	46824	116764
24	B	16766	36766	46826	116766
24	B	16768	36768	46828	116768
24	B	16770	36770	46830	116770
24	B	16772	36772	46832	116772
24	B	16774	36774	46834	116774
24	B	16776	36776	46836	116776

25 ABC_25 — Grave

ERROR ID 25. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO , (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
25	A	11320	31320	41410	111320
25	A	11322	31322	41412	111322
25	A	11324	31324	41414	111324
25	A	11326	31326	41416	111326
25	A	11328	31328	41418	111328
25	A	11330	31330	41420	111330
25	A	11332	31332	41422	111332
25	A	11334	31334	41424	111334
25	A	11336	31336	41426	111336
25	A	11338	31338	41428	111338
25	A	11340	31340	41430	111340
25	A	11342	31342	41432	111342
25	A	11344	31344	41434	111344
25	A	11346	31346	41436	111346
25	B	16780	36780	46840	116780
25	B	16782	36782	46842	116782
25	B	16784	36784	46844	116784
25	B	16786	36786	46846	116786
25	B	16788	36788	46848	116788
25	B	16790	36790	46850	116790
25	B	16792	36792	46852	116792
25	B	16794	36794	46854	116794
25	B	16796	36796	46856	116796
25	B	16798	36798	46858	116798
25	B	16800	36800	46860	116800
25	B	16802	36802	46862	116802
25	B	16804	36804	46864	116804
25	B	16806	36806	46866	116806

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
26	ABC_26	ERROR ID 26. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (AC) SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
26	A	11911	41911
26	A	11912	41912
26	A	11913	41913
26	A	11914	41914
26	A	11915	41915
26	A	11916	41916
26	A	11917	41917
26	A	11918	41918
26	A	11919	41919
26	A	11920	41920
26	A	11921	41921
26	A	11922	41922
26	A	11923	41923
26	A	11924	41924
26	B	16086	47371
26	B	16087	47372
26	B	16088	47373
26	B	16089	47374
26	B	16090	47375
26	B	16091	47376
26	B	16092	47377
26	B	16093	47378
26	B	16094	47379
26	B	16095	47380
26	B	16096	47381
26	B	16097	47382

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		26	B	16098	47383	
		26	B	16099	47384	
27	ABC_27	ERROR ID 27. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) COMPENSADA CONTENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
27	A	11941	41941
27	A	11942	41942
27	A	11943	41943
27	A	11944	41944
27	A	11945	41945
27	A	11946	41946
27	A	11947	41947
27	A	11948	41948
27	A	11949	41949
27	A	11950	41950
27	A	11951	41951
27	A	11952	41952
27	A	11953	41953
27	A	11954	41954
27	B	16116	47401
27	B	16117	47402
27	B	16118	47403
27	B	16119	47404
27	B	16120	47405
27	B	16121	47406
27	B	16122	47407
27	B	16123	47408
27	B	16124	47409
27	B	16125	47410
27	B	16126	47411

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

27	B	16127	47412
27	B	16128	47413
27	B	16129	47414

28 ABC_28 ERROR ID 28. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
28	A	11956	41956
28	A	11957	41957
28	A	11958	41958
28	A	11959	41959
28	A	11960	41960
28	A	11961	41961
28	A	11962	41962
28	A	11963	41963
28	A	11964	41964
28	A	11965	41965
28	A	11966	41966
28	A	11967	41967
28	A	11968	41968
28	A	11969	41969
28	B	16131	47416
28	B	16132	47417
28	B	16133	47418
28	B	16134	47419
28	B	16135	47420
28	B	16136	47421
28	B	16137	47422
28	B	16138	47423
28	B	16139	47424

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

28	B	16140	47425
28	B	16141	47426
28	B	16142	47427
28	B	16143	47428
28	B	16144	47429

30 ABC_30

ERROR ID 30. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS , (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE DIVISAS

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
30	A	40750
30	A	40752
30	A	40754
30	A	40756
30	A	40758
30	A	40760
30	A	40762
30	A	40764
30	A	40766
30	A	40768
30	A	40770
30	A	40772
30	A	40774
30	A	40776
30	A	40810
30	A	40812
30	A	40814
30	A	40816
30	A	40818
30	A	40820
30	A	40822
30	A	40824
30	A	40826

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		30	A	40828	
		30	A	40830	
		30	A	40832	
		30	A	40834	
		30	A	40836	
		30	B	46300	
		30	B	46302	
		30	B	46304	
		30	B	46306	
		30	B	46308	
		30	B	46310	
		30	B	46312	
		30	B	46314	
		30	B	46316	
		30	B	46318	
		30	B	46320	
		30	B	46322	
		30	B	46324	
		30	B	46326	
31	ABC_31	ERROR ID 31. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) , (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA), ASI COMO OPERACIONES CON TÍTULO DE DEUDA, COMPENSADOS CON TITULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
31	A	12001
31	A	12002
31	A	12003
31	A	12004
31	A	12005
31	A	12006
31	A	12007
31	A	12008

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		31	A	12009	
		31	A	12010	
		31	A	12011	
		31	A	12012	
		31	A	12013	
		31	A	12014	
		31	A	12061	
		31	A	12062	
		31	A	12063	
		31	A	12064	
		31	A	12065	
		31	A	12066	
		31	A	12067	
		31	A	12068	
		31	A	12069	
		31	A	12070	
		31	A	12071	
		31	A	12072	
		31	A	12073	
		31	A	12074	
		31	B	17396	
		31	B	17397	
		31	B	17398	
		31	B	17399	
		31	B	17400	
		31	B	17401	
		31	B	17402	
		31	B	17403	
		31	B	17404	
		31	B	17405	
		31	B	17406	
		31	B	17407	
		31	B	17408	
		31	B	17409	
		31	B	17456	
		31	B	17457	
		31	B	17458	
		31	B	17459	
		31	B	17460	
		31	B	17461	
		31	B	17462	
		31	B	17463	
		31	B	17464	
		31	B	17465	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

31	B	17466
31	B	17467
31	B	17468
31	B	17469

32 ABC_32

ERROR ID 32. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TÍTULOS A RECIBIR POR FUTUROS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA) , (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA) ASI COMO OPERACIONES CON TÍTULO DE DEUDA COMPENSADOS CON TITULOS A ENTREGAR POR OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA A TASA FIJA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS (FASE PASIVA)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
32	A	11440
32	A	11442
32	A	11444
32	A	11446
32	A	11448
32	A	11450
32	A	11452
32	A	11454
32	A	11456
32	A	11458
32	A	11460
32	A	11462
32	A	11464
32	A	11466
32	A	12031
32	A	12032

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*		Nivel
		32	A	12033
		32	A	12034
		32	A	12035
		32	A	12036
		32	A	12037
		32	A	12038
		32	A	12039
		32	A	12040
		32	A	12041
		32	A	12042
		32	A	12043
		32	A	12044
		32	B	17381
		32	B	17382
		32	B	17383
		32	B	17384
		32	B	17385
		32	B	17386
		32	B	17387
		32	B	17388
		32	B	17389
		32	B	17390
		32	B	17391
		32	B	17392
		32	B	17393
		32	B	17394
		32	B	17441
		32	B	17442
		32	B	17443
		32	B	17444
		32	B	17445
		32	B	17446
		32	B	17447
		32	B	17448
		32	B	17449
		32	B	17450
		32	B	17451
		32	B	17452
		32	B	17453
		32	B	17454

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
33	ABC_33	ERROR ID 33. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES TIPO "FLOOR", COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERES TIPO "FLOOR" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
33	A	11170	31170	41230
33	A	11172	31172	41232
33	A	11174	31174	41234
33	A	11176	31176	41236
33	A	11178	31178	41238
33	A	11180	31180	41240
33	A	11182	31182	41242
33	A	11184	31184	41244
33	A	11186	31186	41246
33	A	11188	31188	41248
33	A	11190	31190	41250
33	A	11192	31192	41252
33	A	11194	31194	41254
33	A	11196	31196	41256
33	B	16630	36630	46660
33	B	16632	36632	46662
33	B	16634	36634	46664

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		33	B	16636	36636	46666
		33	B	16638	36638	46668
		33	B	16640	36640	46670
		33	B	16642	36642	46672
		33	B	16644	36644	46674
		33	B	16646	36646	46676
		33	B	16648	36648	46678
		33	B	16650	36650	46680
		33	B	16652	36652	46682
		33	B	16654	36654	46684
		33	B	16656	36656	46686
34	ABC_34	ERROR ID 34. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERES TIPO "CAP", COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERES TIPO "CAP" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
34	A	11530	31410	41500
34	A	11532	31412	41502
34	A	11534	31414	41504
34	A	11536	31416	41506
34	A	11538	31418	41508
34	A	11540	31420	41510
34	A	11542	31422	41512
34	A	11544	31424	41514
34	A	11546	31426	41516
34	A	11548	31428	41518
34	A	11550	31430	41520
34	A	11552	31432	41522
34	A	11554	31434	41524
34	A	11556	31436	41526
34	B	17050	36960	47020
34	B	17052	36962	47022
34	B	17054	36964	47024

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		34	B	17056	36966	47026	
		34	B	17058	36968	47028	
		34	B	17060	36970	47030	
		34	B	17062	36972	47032	
		34	B	17064	36974	47034	
		34	B	17066	36976	47036	
		34	B	17068	36978	47038	
		34	B	17070	36980	47040	
		34	B	17072	36982	47042	
		34	B	17074	36984	47044	
		34	B	17076	36986	47046	
35	ABC_35	ERROR ID 35. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) , (AC) EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES , COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES, AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
35	A	11650	31500	41650
35	A	11652	31502	41652
35	A	11654	31504	41654
35	A	11656	31506	41656
35	A	11658	31508	41658
35	A	11660	31510	41660
35	A	11662	31512	41662
35	A	11664	31514	41664
35	A	11666	31516	41666
35	A	11668	31518	41668
35	A	11670	31520	41670
35	A	11672	31522	41672
35	A	11674	31524	41674
35	A	11676	31526	41676
35	B	17170	37050	47170
35	B	17172	37052	47172
35	B	17174	37054	47174

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		35	B	17176	37056	47176
		35	B	17178	37058	47178
		35	B	17180	37060	47180
		35	B	17182	37062	47182
		35	B	17184	37064	47184
		35	B	17186	37066	47186
		35	B	17188	37068	47188
		35	B	17190	37070	47190
		35	B	17192	37072	47192
		35	B	17194	37074	47194
		35	B	17196	37076	47196
36	ABC_36	ERROR ID 36. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES, DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA), (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES, COMPENSADA CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES , AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
36	A	11680	31530	41680
36	A	11682	31532	41682
36	A	11684	31534	41684
36	A	11686	31536	41686
36	A	11688	31538	41688
36	A	11690	31540	41690
36	A	11692	31542	41692
36	A	11694	31544	41694
36	A	11696	31546	41696
36	A	11698	31548	41698
36	A	11700	31550	41700
36	A	11702	31552	41702
36	A	11704	31554	41704
36	A	11706	31556	41706
36	B	17200	37080	47200
36	B	17202	37082	47202

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

36	B	17204	37084	47204	
36	B	17206	37086	47206	
36	B	17208	37088	47208	
36	B	17210	37090	47210	
36	B	17212	37092	47212	
36	B	17214	37094	47214	
36	B	17216	37096	47216	
36	B	17218	37098	47218	
36	B	17220	37100	47220	
36	B	17222	37102	47222	
36	B	17224	37104	47224	
36	B	17226	37106	47226	

37 ABC_37

ERROR ID 37. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" (FASE ACTIVA) , (AC) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES COMPENSADA CON M.N A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES , AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR"

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
37	A	11710	31560	41710
37	A	11712	31562	41712
37	A	11714	31564	41714
37	A	11716	31566	41716
37	A	11718	31568	41718
37	A	11720	31570	41720
37	A	11722	31572	41722
37	A	11724	31574	41724
37	A	11726	31576	41726
37	A	11728	31578	41728
37	A	11730	31580	41730
37	A	11732	31582	41732
37	A	11734	31584	41734
37	A	11736	31586	41736

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

37	B	17230	37110	47230
37	B	17232	37112	47232
37	B	17234	37114	47234
37	B	17236	37116	47236
37	B	17238	37118	47238
37	B	17240	37120	47240
37	B	17242	37122	47242
37	B	17244	37124	47244
37	B	17246	37126	47246
37	B	17248	37128	47248
37	B	17250	37130	47250
37	B	17252	37132	47252
37	B	17254	37134	47254
37	B	17256	37136	47256

38 ABC_38

ERROR ID 38. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES, DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" (FASE ACTIVA), (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES, COMPENSADA CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES , AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR"

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
38	A	11740	31590	41740
38	A	11742	31592	41742
38	A	11744	31594	41744
38	A	11746	31596	41746
38	A	11748	31598	41748
38	A	11750	31600	41750
38	A	11752	31602	41752
38	A	11754	31604	41754
38	A	11756	31606	41756
38	A	11758	31608	41758
38	A	11760	31610	41760
38	A	11762	31612	41762
38	A	11764	31614	41764
38	A	11766	31616	41766

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

38	B	17260	37140	47260	
38	B	17262	37142	47262	
38	B	17264	37144	47264	
38	B	17266	37146	47266	
38	B	17268	37148	47268	
38	B	17270	37150	47270	
38	B	17272	37152	47272	
38	B	17274	37154	47274	
38	B	17276	37156	47276	
38	B	17278	37158	47278	
38	B	17280	37160	47280	
38	B	17282	37162	47282	
38	B	17284	37164	47284	
38	B	17286	37166	47286	

39 ABC_39

ERROR ID 39. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
39	A	11971	31200	41971
39	A	11972	31202	41972
39	A	11973	31204	41973
39	A	11974	31206	41974
39	A	11975	31208	41975
39	A	11976	31210	41976
39	A	11977	31212	41977
39	A	11978	31214	41978
39	A	11979	31216	41979
39	A	11980	31218	41980
39	A	11981	31220	41981
39	A	11982	31222	41982
39	A	11983	31224	41983

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

39	A	11984	31226	41984	
39	B	17351	36690	47431	
39	B	17352	36692	47432	
39	B	17353	36694	47433	
39	B	17354	36696	47434	
39	B	17355	36698	47435	
39	B	17356	36700	47436	
39	B	17357	36702	47437	
39	B	17358	36704	47438	
39	B	17359	36706	47439	
39	B	17360	36708	47440	
39	B	17361	36710	47441	
39	B	17362	36712	47442	
39	B	17363	36714	47443	
39	B	17364	36716	47444	

40 ABC_40

ERROR ID 40. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
40	A	11986	31260	41986
40	A	11987	31262	41987
40	A	11988	31264	41988
40	A	11989	31266	41989
40	A	11990	31268	41990
40	A	11991	31270	41991
40	A	11992	31272	41992
40	A	11993	31274	41993
40	A	11994	31276	41994
40	A	11995	31278	41995
40	A	11996	31280	41996
40	A	11997	31282	41997

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

40	A	11998	31284	41998	
40	A	11999	31286	41999	
40	B	17366	36720	47446	
40	B	17367	36722	47447	
40	B	17368	36724	47448	
40	B	17369	36726	47449	
40	B	17370	36728	47450	
40	B	17371	36730	47451	
40	B	17372	36732	47452	
40	B	17373	36734	47453	
40	B	17374	36736	47454	
40	B	17375	36738	47455	
40	B	17376	36740	47456	
40	B	17377	36742	47457	
40	B	17378	36744	47458	
40	B	17379	36746	47459	

41 ABC_41

ERROR ID 41. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
41	A	12151	31470	42061	111170
41	A	12152	31472	42062	111172
41	A	12153	31474	42063	111174
41	A	12154	31476	42064	111176
41	A	12155	31478	42065	111178
41	A	12156	31480	42066	111180
41	A	12157	31482	42067	111182
41	A	12158	31484	42068	111184
41	A	12159	31486	42069	111186
41	A	12160	31488	42070	111188
41	A	12161	31490	42071	111190

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

41	A	12162	31492	42072	111192
41	A	12163	31494	42073	111194
41	A	12164	31496	42074	111196
41	B	17531	37020	47506	116630
41	B	17532	37022	47507	116632
41	B	17533	37024	47508	116634
41	B	17534	37026	47509	116636
41	B	17535	37028	47510	116638
41	B	17536	37030	47511	116640
41	B	17537	37032	47512	116642
41	B	17538	37034	47513	116644
41	B	17539	37036	47514	116646
41	B	17540	37038	47515	116648
41	B	17541	37040	47516	116650
41	B	17542	37042	47517	116652
41	B	17543	37044	47518	116654
41	B	17544	37046	47519	116656

42 ABC_42

ERROR ID 42. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS, COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
42	A	41290
42	A	41292
42	A	41294
42	A	41296
42	A	41298
42	A	41300
42	A	41302
42	A	41304
42	A	41306
42	A	41308
42	A	41310
42	A	41312

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		42	A	41314	
		42	A	41316	
		42	B	46720	
		42	B	46722	
		42	B	46724	
		42	B	46726	
		42	B	46728	
		42	B	46730	
		42	B	46732	
		42	B	46734	
		42	B	46736	
		42	B	46738	
		42	B	46740	
		42	B	46742	
		42	B	46744	
		42	B	46746	
43	ABC_43	ERROR ID 43. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS, COMPENSADA CON EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

USO LIMITADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
43	A	41560
43	A	41562
43	A	41564
43	A	41566
43	A	41568
43	A	41570
43	A	41572
43	A	41574
43	A	41576
43	A	41578
43	A	41580
43	A	41582
43	A	41584
43	A	41586
43	B	47080
43	B	47082
43	B	47084
43	B	47086
43	B	47088
43	B	47090
43	B	47092
43	B	47094
43	B	47096
43	B	47098
43	B	47100
43	B	47102
43	B	47104
43	B	47106

44	ABC_44	ERROR ID 44. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR POR FUTUROS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA), COMPENSADOS CON M.N. A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
44	A	11470
44	A	11472
44	A	11474
44	A	11476
44	A	11478
44	A	11480
44	A	11482
44	A	11484
44	A	11486
44	A	11488
44	A	11490
44	A	11492
44	A	11494
44	A	11496
44	A	12046
44	A	12047
44	A	12048
44	A	12049
44	A	12050
44	A	12051
44	A	12052
44	A	12053
44	A	12054
44	A	12055
44	A	12056
44	A	12057
44	A	12058
44	A	12059
44	B	17411
44	B	17412
44	B	17413
44	B	17414
44	B	17415
44	B	17416
44	B	17417
44	B	17418
44	B	17419
44	B	17420

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

44	B	17421
44	B	17422
44	B	17423
44	B	17424

45 ABC_45

ERROR ID 45. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR POR FUTUROS DE VENTA TÍTULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA), COMPENSADOS CON M.N. A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
45	A	12016
45	A	12017
45	A	12018
45	A	12019
45	A	12020
45	A	12021
45	A	12022
45	A	12023
45	A	12024
45	A	12025
45	A	12026
45	A	12027
45	A	12028
45	A	12029
45	A	12076
45	A	12077
45	A	12078
45	A	12079
45	A	12080
45	A	12081
45	A	12082

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		45	A	12083	
		45	A	12084	
		45	A	12085	
		45	A	12086	
		45	A	12087	
		45	A	12088	
		45	A	12089	
		45	B	17426	
		45	B	17427	
		45	B	17428	
		45	B	17429	
		45	B	17430	
		45	B	17431	
		45	B	17432	
		45	B	17433	
		45	B	17434	
		45	B	17435	
		45	B	17436	
		45	B	17437	
		45	B	17438	
		45	B	17439	
46	ABC_46	ERROR ID 46. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
46	A	12091	42001
46	A	12092	42002
46	A	12093	42003
46	A	12094	42004
46	A	12095	42005

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

46	A	12096	42006
46	A	12097	42007
46	A	12098	42008
46	A	12099	42009
46	A	12100	42010
46	A	12101	42011
46	A	12102	42012
46	A	12103	42013
46	A	12104	42014
46	B	17471	47461
46	B	17472	47462
46	B	17473	47463
46	B	17474	47464
46	B	17475	47465
46	B	17476	47466
46	B	17477	47467
46	B	17478	47468
46	B	17479	47469
46	B	17480	47470
46	B	17481	47471
46	B	17482	47472
46	B	17483	47473
46	B	17484	47474

47 ABC_47 ERROR ID 47. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (AC) POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
47	A	12121	42031
47	A	12122	42032
47	A	12123	42033
47	A	12124	42034

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

47	A	12125	42035
47	A	12126	42036
47	A	12127	42037
47	A	12128	42038
47	A	12129	42039
47	A	12130	42040
47	A	12131	42041
47	A	12132	42042
47	A	12133	42043
47	A	12134	42044
47	B	17501	47476
47	B	17502	47477
47	B	17503	47478
47	B	17504	47479
47	B	17505	47480
47	B	17506	47481
47	B	17507	47482
47	B	17508	47483
47	B	17509	47484
47	B	17510	47485
47	B	17511	47486
47	B	17512	47487
47	B	17513	47488
47	B	17514	47489

48 ABC_48

ERROR ID 48. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA) , (AC) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE VENTA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
48	A	11380
48	A	11382
48	A	11384
48	A	11386

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		48	A	11388	
		48	A	11390	
		48	A	11392	
		48	A	11394	
		48	A	11396	
		48	A	11398	
		48	A	11400	
		48	A	11402	
		48	A	11404	
		48	A	11406	
		48	B	17290	
		48	B	17292	
		48	B	17294	
		48	B	17296	
		48	B	17298	
		48	B	17300	
		48	B	17302	
		48	B	17304	
		48	B	17306	
		48	B	17308	
		48	B	17310	
		48	B	17312	
		48	B	17314	
		48	B	17316	
49	ABC_49	ERROR ID 49. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA) , (AC) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave
		ID VALIDACIÓN	**ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN**	**RC01**	
		49	A	11410	
		49	A	11412	
		49	A	11414	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		49	A	11416	
		49	A	11418	
		49	A	11420	
		49	A	11422	
		49	A	11424	
		49	A	11426	
		49	A	11428	
		49	A	11430	
		49	A	11432	
		49	A	11434	
		49	A	11436	
		49	B	17320	
		49	B	17322	
		49	B	17324	
		49	B	17326	
		49	B	17328	
		49	B	17330	
		49	B	17332	
		49	B	17334	
		49	B	17336	
		49	B	17338	
		49	B	17340	
		49	B	17342	
		49	B	17344	
		49	B	17346	
181	ABC_181	ERROR ID 181. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “CAP” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
181	A	180152

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		181	A	180154	
		181	A	180156	
		181	A	180158	
		181	A	180160	
		181	A	180162	
		181	A	180164	
		181	A	180166	
		181	A	180168	
		181	A	180170	
		181	A	180172	
		181	A	180174	
		181	A	180176	
		181	A	180178	
		181	B	186052	
		181	B	186054	
		181	B	186056	
		181	B	186058	
		181	B	186060	
		181	B	186062	
		181	B	186064	
		181	B	186066	
		181	B	186068	
		181	B	186070	
		181	B	186072	
		181	B	186074	
		181	B	186076	
		181	B	186078	
182	ABC_182	ERROR ID 182. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
182	A	180202

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		182	A	180204	
		182	A	180206	
		182	A	180208	
		182	A	180210	
		182	A	180212	
		182	A	180214	
		182	A	180216	
		182	A	180218	
		182	A	180220	
		182	A	180222	
		182	A	180224	
		182	A	180226	
		182	A	180228	
		182	B	186102	
		182	B	186104	
		182	B	186106	
		182	B	186108	
		182	B	186110	
		182	B	186112	
		182	B	186114	
		182	B	186116	
		182	B	186118	
		182	B	186120	
		182	B	186122	
		182	B	186124	
		182	B	186126	
		182	B	186128	
183	ABC_183	ERROR ID 183. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
183	A	180252

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		183	A	180254	
		183	A	180256	
		183	A	180258	
		183	A	180260	
		183	A	180262	
		183	A	180264	
		183	A	180266	
		183	A	180268	
		183	A	180270	
		183	A	180272	
		183	A	180274	
		183	A	180276	
		183	A	180278	
		183	B	186152	
		183	B	186154	
		183	B	186156	
		183	B	186158	
		183	B	186160	
		183	B	186162	
		183	B	186164	
		183	B	186166	
		183	B	186168	
		183	B	186170	
		183	B	186172	
		183	B	186174	
		183	B	186176	
		183	B	186178	
184	ABC_184	ERROR ID 184. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave
		ID VALIDACIÓN	**ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN**	**RC18**	
		184	A	180452	
		184	A	180454	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		184	A	180456	
		184	A	180458	
		184	A	180460	
		184	A	180462	
		184	A	180464	
		184	A	180466	
		184	A	180468	
		184	A	180470	
		184	A	180472	
		184	A	180474	
		184	A	180476	
		184	A	180478	
		184	B	186202	
		184	B	186204	
		184	B	186206	
		184	B	186208	
		184	B	186210	
		184	B	186212	
		184	B	186214	
		184	B	186216	
		184	B	186218	
		184	B	186220	
		184	B	186222	
		184	B	186224	
		184	B	186226	
		184	B	186228	
185	ABC_185	ERROR ID 185. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL. (FASE ACTIVA), (AC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
185	A	180502
185	A	180504
185	A	180506

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		185	A	180508	
		185	A	180510	
		185	A	180512	
		185	A	180514	
		185	A	180516	
		185	A	180518	
		185	A	180520	
		185	A	180522	
		185	A	180524	
		185	A	180526	
		185	A	180528	
		185	B	186252	
		185	B	186254	
		185	B	186256	
		185	B	186258	
		185	B	186260	
		185	B	186262	
		185	B	186264	
		185	B	186266	
		185	B	186268	
		185	B	186270	
		185	B	186272	
		185	B	186274	
		185	B	186276	
		185	B	186278	
186	ABC_186	ERROR ID 186. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) , (AC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
186	A	180552
186	A	180554
186	A	180556
186	A	180558

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="3">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td colspan="3"><table>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180560</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180562</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180564</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180566</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180568</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180570</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180572</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180574</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180576</td></tr>
<tr><td>186</td><td>A</td><td>180578</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186302</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186304</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186306</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186308</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186310</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186312</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186314</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186316</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186318</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186320</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186322</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186324</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186326</td></tr>
<tr><td>186</td><td>B</td><td>186328</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>187</td><td>ABC_187</td><td colspan="3">ERROR ID 187. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA).
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>187</td><td>A</td><td>180802</td></tr>
<tr><td>187</td><td>A</td><td>180804</td></tr>
<tr><td>187</td><td>A</td><td>180806</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		187	A	180808	
		187	A	180810	
		187	A	180812	
		187	A	180814	
		187	A	180816	
		187	A	180818	
		187	A	180820	
		187	A	180822	
		187	A	180824	
		187	A	180826	
		187	A	180828	
		187	B	186352	
		187	B	186354	
		187	B	186356	
		187	B	186358	
		187	B	186360	
		187	B	186362	
		187	B	186364	
		187	B	186366	
		187	B	186368	
		187	B	186370	
		187	B	186372	
		187	B	186374	
		187	B	186376	
		187	B	186378	
188	ABC_188	ERROR ID 188. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
188	A	180852
188	A	180854
188	A	180856
188	A	180858

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		188	A	180860	
		188	A	180862	
		188	A	180864	
		188	A	180866	
		188	A	180868	
		188	A	180870	
		188	A	180872	
		188	A	180874	
		188	A	180876	
		188	A	180878	
		188	B	186402	
		188	B	186404	
		188	B	186406	
		188	B	186408	
		188	B	186410	
		188	B	186412	
		188	B	186414	
		188	B	186416	
		188	B	186418	
		188	B	186420	
		188	B	186422	
		188	B	186424	
		188	B	186426	
		188	B	186428	
189	ABC_189	ERROR ID 189. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
189	A	180902
189	A	180904
189	A	180906

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

189	A	180908
189	A	180910
189	A	180912
189	A	180914
189	A	180916
189	A	180918
189	A	180920
189	A	180922
189	A	180924
189	A	180926
189	A	180928
189	B	186452
189	B	186454
189	B	186456
189	B	186458
189	B	186460
189	B	186462
189	B	186464
189	B	186466
189	B	186468
189	B	186470
189	B	186472
189	B	186474
189	B	186476
189	B	186478

190 ABC_190

ERROR ID 190. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E.; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
190	A	180952

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		190	A	180954	
		190	A	180956	
		190	A	180958	
		190	A	180960	
		190	A	180962	
		190	A	180964	
		190	A	180966	
		190	A	180968	
		190	A	180970	
		190	A	180972	
		190	A	180974	
		190	A	180976	
		190	A	180978	
		190	B	186502	
		190	B	186504	
		190	B	186506	
		190	B	186508	
		190	B	186510	
		190	B	186512	
		190	B	186514	
		190	B	186516	
		190	B	186518	
		190	B	186520	
		190	B	186522	
		190	B	186524	
		190	B	186526	
		190	B	186528	
191	ABC_191	ERROR ID 191. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS S.M.G.; ASI COMO POR TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE SUBYACENTES REFERIDO AL S.M.G. (FASE ACTIVA) , (AC) EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS S.M.G.; ASI COMO POR TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE SUBYACENTES REFERIDO AL S.M.G. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G.; ASI COMO TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G. (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
191	A	181052

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		191	A	181054	
		191	A	181056	
		191	A	181058	
		191	A	181060	
		191	A	181062	
		191	A	181064	
		191	A	181066	
		191	A	181068	
		191	A	181070	
		191	A	181072	
		191	A	181074	
		191	A	181076	
		191	A	181078	
		191	B	186552	
		191	B	186554	
		191	B	186556	
		191	B	186558	
		191	B	186560	
		191	B	186562	
		191	B	186564	
		191	B	186566	
		191	B	186568	
		191	B	186570	
		191	B	186572	
		191	B	186574	
		191	B	186576	
		191	B	186578	
192	ABC_192	ERROR ID 192. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
192	A	181152
192	B	186602

193 | ABC_193 | ERROR ID 193. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
193	A	181302
193	B	186652

Nivel
Grave

194 | ABC_194 | ERROR ID 194. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL TIPO “FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Nivel
Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
194	A	180052
194	A	180054
194	A	180056
194	A	180058
194	A	180060
194	A	180062
194	A	180064
194	A	180066
194	A	180068
194	A	180070
194	A	180072
194	A	180074
194	A	180076
194	A	180078
194	B	186702
194	B	186704
194	B	186706
194	B	186708
194	B	186710
194	B	186712
194	B	186714
194	B	186716
194	B	186718
194	B	186720
194	B	186722
194	B	186724
194	B	186726
194	B	186728

195	ABC_195	ERROR ID 195. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180102</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180104</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180106</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180108</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180110</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180112</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180114</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180116</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180118</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180120</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180122</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180124</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180126</td></tr>
<tr><td>195</td><td>A</td><td>180128</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186752</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186754</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186756</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186758</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186760</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186762</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186764</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186766</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186768</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186770</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186772</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186774</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186776</td></tr>
<tr><td>195</td><td>B</td><td>186778</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>196</td><td>ABC_196</td><td>ERROR ID 196. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.N. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA), (AC) M.N. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA)
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
196	A	180302
196	A	180304
196	A	180306
196	A	180308
196	A	180310
196	A	180312
196	A	180314
196	A	180316
196	A	180318
196	A	180320
196	A	180322
196	A	180324
196	A	180326
196	A	180328
196	B	186802
196	B	186804
196	B	186806
196	B	186808
196	B	186810
196	B	186812
196	B	186814
196	B	186816
196	B	186818
196	B	186820
196	B	186822
196	B	186824
196	B	186826
196	B	186828

197	ABC_197	ERROR ID 197. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL TIPO “FLOOR" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180352</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180354</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180356</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180358</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180360</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180362</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180364</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180366</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180368</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180370</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180372</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180374</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180376</td></tr>
<tr><td>197</td><td>A</td><td>180378</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186852</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186854</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186856</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186858</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186860</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186862</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186864</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186866</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186868</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186870</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186872</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186874</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186876</td></tr>
<tr><td>197</td><td>B</td><td>186878</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>198</td><td>ABC_198</td><td>ERROR ID 198. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL (FASE ACTIVA), (AC) UDIS A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL.
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180402</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180404</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180406</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180408</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180410</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180412</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180414</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180416</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180418</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180420</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180422</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180424</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180426</td></tr>
<tr><td>198</td><td>A</td><td>180428</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186902</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186904</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186906</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186908</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186910</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186912</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186914</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186916</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186918</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186920</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186922</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186924</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186926</td></tr>
<tr><td>198</td><td>B</td><td>186928</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>199</td><td>ABC_199</td><td>ERROR ID 199. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" (FASE ACTIVA) , (AC) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA)
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS</td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
199	A	180602
199	A	180604
199	A	180606
199	A	180608
199	A	180610
199	A	180612
199	A	180614
199	A	180616
199	A	180618
199	A	180620
199	A	180622
199	A	180624
199	A	180626
199	A	180628
199	B	186952
199	B	186954
199	B	186956
199	B	186958
199	B	186960
199	B	186962
199	B	186964
199	B	186966
199	B	186968
199	B	186970
199	B	186972
199	B	186974
199	B	186976
199	B	186978

200	ABC_200	ERROR ID 200. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO "FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
200	A	180652
200	A	180654
200	A	180656
200	A	180658
200	A	180660
200	A	180662
200	A	180664
200	A	180666
200	A	180668
200	A	180670
200	A	180672
200	A	180674
200	A	180676
200	A	180678
200	B	187002
200	B	187004
200	B	187006
200	B	187008
200	B	187010
200	B	187012
200	B	187014
200	B	187016
200	B	187018
200	B	187020
200	B	187022
200	B	187024
200	B	187026
200	B	187028

201	ABC_201	ERROR ID 201. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR POR EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR POR EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
201	A	180702
201	A	180704
201	A	180706
201	A	180708
201	A	180710
201	A	180712
201	A	180714
201	A	180716
201	A	180718
201	A	180720
201	A	180722
201	A	180724
201	A	180726
201	A	180728
201	B	187052
201	B	187054
201	B	187056
201	B	187058
201	B	187060
201	B	187062
201	B	187064
201	B	187066
201	B	187068
201	B	187070
201	B	187072
201	B	187074
201	B	187076
201	B	187078

202	ABC_202	ERROR ID 202. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
202	A	180752
202	A	180754
202	A	180756
202	A	180758
202	A	180760
202	A	180762
202	A	180764
202	A	180766
202	A	180768
202	A	180770
202	A	180772
202	A	180774
202	A	180776
202	A	180778
202	B	187102
202	B	187104
202	B	187106
202	B	187108
202	B	187110
202	B	187112
202	B	187114
202	B	187116
202	B	187118
202	B	187120
202	B	187122
202	B	187124
202	B	187126
202	B	187128

203	ABC_203	ERROR ID 203. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) M.E. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA), (AC) M.E. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
203	A	181002
203	A	181004
203	A	181006
203	A	181008
203	A	181010
203	A	181012
203	A	181014
203	A	181016
203	A	181018
203	A	181020
203	A	181022
203	A	181024
203	A	181026
203	A	181028
203	B	187152
203	B	187154
203	B	187156
203	B	187158
203	B	187160
203	B	187162
203	B	187164
203	B	187166
203	B	187168
203	B	187170
203	B	187172
203	B	187174
203	B	187176
203	B	187178

204	ABC_204	ERROR ID 204. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) , (AC) EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		|A-B|<=2 **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC18** 204 / A / 181102 204 / B / 187202	
205	ABC_205	ERROR ID 205. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (AC) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC18** 205 / A / 181252 205 / B / 187252	Grave
206	ABC_206	ERROR ID 206. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) , (AC) TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
206	A	181202
206	B	187302

b) (PB) Pasivo Bruto, (PC) Pasivo Compensable

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
60	ABC_60	ERROR ID 60. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) MONEDA A ENTREGAR POR OPERACIONES FECHA-VALOR DE COMPRA DE DIVISAS, VALORES Y REPORTOS , (PC) COMPENSACION DE DINERO EN COMPRA-VENTA DE VALORES Y DIVISAS, ASI COMO REPORTOS DE TITULOS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave
61	ABC_61	ERROR ID 61. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO , (PC) COMPENSACIONES DE MONEDA A ENTREGAR EN REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
60	A	13240	43195
60	A		43197
60	A	13400	43400
60	A	13402	43402
60	A	13450	43450
60	B	18145	48145
60	B	18147	48146

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
61	A	13750	43750
61	A	13752	43752
61	A	13754	43754
61	A	13756	43756
61	A	13758	43758
61	A	13760	43760
61	A	13762	43762
61	A	13764	43764
61	A	13766	43766
61	A	13768	43768
61	A	13770	43770
61	A	13772	43772
61	A	13774	43774
61	A	13776	43776
61	B	18150	48150
61	B	18152	48152
61	B	18154	48154
61	B	18156	48156
61	B	18158	48158
61	B	18160	48160
61	B	18162	48162
61	B	18164	48164
61	B	18166	48166
61	B	18168	48168
61	B	18170	48170
61	B	18172	48172
61	B	18174	48174
61	B	18176	48176

62	ABC_62	ERROR ID 62. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TITULOS A ENTREGAR POR OPERACIONES FECHA-VALOR DE REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO, VENTA DE VALORES Y PRÉSTAMOS , (PC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC02	RC11
62	A	13500	33500	43500	23500	113500
62	A	13502	33502	43502	23502	113502
62	A	13504	33504	43504	23504	113504
62	A	13506	33506	43506	23506	113506
62	A	13508	33508	43508	23508	113508
62	A	13510	33510	43510	23510	113510
62	A	13512	33512	43512	23512	113512
62	A	13514	33514	43514	23514	113514
62	A	13516	33516	43516	23516	113516
62	A	13518	33518	43518	23518	113518
62	A	13520	33520	43520	23520	113520
62	A	13522	33522	43522	23522	113522
62	A	13524	33524	43524	23524	113524
62	A	13526	33526	43526	23526	113526
62	A	13550	33550	43550	23550	113550
62	A	13552	33552	43552	23552	113552
62	A	13554	33554	43554	23554	113554
62	A	13556	33556	43556	23556	113556
62	A	13558	33558	43558	23558	113558
62	A	13560	33560	43560	23560	113560
62	A	13562	33562	43562	23562	113562
62	A	13564	33564	43564	23564	113564
62	A	13566	33566	43566	23566	113566
62	A	13568	33568	43568	23568	113568
62	A	13570	33570	43570	23570	113570
62	A	13572	33572	43572	23572	113572
62	A	13574	33574	43574	23574	113574
62	A	13576	33576	43576	23576	113576
62	A	13600	33600	43600	23600	113600
62	A	13602	33602	43602	23602	113602
62	A	13604	33604	43604	23604	113604
62	A	13606	33606	43606	23606	113606
62	A	13608	33608	43608	23608	113608
62	A	13610	33610	43610	23610	113610
62	A	13612	33612	43612	23612	113612
62	A	13614	33614	43614	23614	113614
62	A	13616	33616	43616	23616	113616

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
	62	A	13618	33618	43618	23618	113618	
	62	A	13620	33620	43620	23620	113620	
	62	A	13622	33622	43622	23622	113622	
	62	A	13624	33624	43624	23624	113624	
	62	A	13626	33626	43626	23626	113626	
	62	A	13650	33650	43650	23650	113650	
	62	A	13652	33652	43652	23652	113652	
	62	A	13654	33654	43654	23654	113654	
	62	A	13656	33656	43656	23656	113656	
	62	A	13658	33658	43658	23658	113658	
	62	A	13660	33660	43660	23660	113660	
	62	A	13662	33662	43662	23662	113662	
	62	A	13664	33664	43664	23664	113664	
	62	A	13666	33666	43666	23666	113666	
	62	A	13668	33668	43668	23668	113668	
	62	A	13670	33670	43670	23670	113670	
	62	A	13672	33672	43672	23672	113672	
	62	A	13674	33674	43674	23674	113674	
	62	A	13676	33676	43676	23676	113676	
	62	A	13700	33700	43700	23700	113700	
	62	A	13702	33702	43702	23702	113702	
	62	A	13704	33704	43704	23704	113704	
	62	A	13706	33706	43706	23706	113706	
	62	A	13708	33708	43708	23708	113708	
	62	A	13710	33710	43710	23710	113710	
	62	A	13712	33712	43712	23712	113712	
	62	A	13714	33714	43714	23714	113714	
	62	A	13716	33716	43716	23716	113716	
	62	A	13718	33718	43718	23718	113718	
	62	A	13720	33720	43720	23720	113720	
	62	A	13722	33722	43722	23722	113722	
	62	A	13724	33724	43724	23724	113724	
	62	A	13726	33726	43726	23726	113726	
	62	B	18180	38180	48180	27000	118180	
	62	B	18182	38182	48182	27002	118182	
	62	B	18184	38184	48184	27004	118184	
	62	B	18186	38186	48186	27006	118186	
	62	B	18188	38188	48188	27008	118188	
	62	B	18190	38190	48190	27010	118190	
	62	B	18192	38192	48192	27012	118192	
	62	B	18194	38194	48194	27014	118194	
	62	B	18196	38196	48196	27016	118196	
	62	B	18198	38198	48198	27018	118198	
	62	B	18200	38200	48200	27020	118200	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
	62	B	18202	38202	48202	27022	118202	
	62	B	18204	38204	48204	27024	118204	
	62	B	18206	38206	48206	27026	118206	
	62	B	18210	38210	48210		-	
	62	B	18212	38212	48212		-	
	62	B	18214	38214	48214		-	
	62	B	18216	38216	48216		-	
	62	B	18218	38218	48218		-	
	62	B	18220	38220	48220		-	
	62	B	18222	38222	48222		-	
	62	B	18224	38224	48224		-	
	62	B	18226	38226	48226		-	
	62	B	18228	38228	48228		-	
	62	B	18230	38230	48230		-	
	62	B	18232	38232	48232		-	
	62	B	18234	38234	48234		-	
	62	B	18236	38236	48236		-	
	62	B	18810	38810	48870			
	62	B	18812	38812	48872			
	62	B	18814	38814	48874			
	62	B	18816	38816	48876			
	62	B	18818	38818	48878			
	62	B	18820	38820	48880			
	62	B	18822	38822	48882			
	62	B	18824	38824	48884			
	62	B	18826	38826	48886			
	62	B	18828	38828	48888			
	62	B	18830	38830	48890			
	62	B	18832	38832	48892			
	62	B	18834	38834	48894			
	62	B	18836	38836	48896			
	62	B	18840	38840	48900			
	62	B	18842	38842	48902			
	62	B	18844	38844	48904			
	62	B	18846	38846	48906			
	62	B	18848	38848	48908			
	62	B	18850	38850	48910			
	62	B	18852	38852	48912			
	62	B	18854	38854	48914			
	62	B	18856	38856	48916			
	62	B	18858	38858	48918			
	62	B	18860	38860	48920			
	62	B	18862	38862	48922			
	62	B	18864	38864	48924			

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
		62	B	18866	38866	48926		

63 ABC_63 ERROR ID 63. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01,RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
63	A	13780	33780	43780
63	A	13782	33782	43782
63	A	13784	33784	43784
63	A	13786	33786	43786
63	A	13788	33788	43788
63	A	13790	33790	43790
63	A	13792	33792	43792
63	A	13794	33794	43794
63	A	13796	33796	43796
63	A	13798	33798	43798
63	A	13800	33800	43800
63	A	13802	33802	43802
63	A	13804	33804	43804
63	A	13806	33806	43806
63	A	13840	33840	43840
63	A	13842	33842	43842
63	A	13844	33844	43844
63	A	13846	33846	43846
63	A	13848	33848	43848
63	A	13850	33850	43850
63	A	13852	33852	43852
63	A	13854	33854	43854
63	A	13856	33856	43856
63	A	13858	33858	43858
63	A	13860	33860	43860
63	A	13862	33862	43862

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		63	A	13864	33864	43864
		63	A	13866	33866	43866
		63	B	18240	38240	48240
		63	B	18242	38242	48242
		63	B	18244	38244	48244
		63	B	18246	38246	48246
		63	B	18248	38248	48248
		63	B	18250	38250	48250
		63	B	18252	38252	48252
		63	B	18254	38254	48254
		63	B	18256	38256	48256
		63	B	18258	38258	48258
		63	B	18260	38260	48260
		63	B	18262	38262	48262
		63	B	18264	38264	48264
		63	B	18266	38266	48266
64	ABC_64	ERROR ID 64. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
64	A	13810	33810	43810
64	A	13812	33812	43812
64	A	13814	33814	43814
64	A	13816	33816	43816
64	A	13818	33818	43818
64	A	13820	33820	43820
64	A	13822	33822	43822
64	A	13824	33824	43824
64	A	13826	33826	43826
64	A	13828	33828	43828
64	A	13830	33830	43830
64	A	13832	33832	43832

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		64	A	13834	33834	43834	
		64	A	13836	33836	43836	
		64	A	13870	33870	43870	
		64	A	13872	33872	43872	
		64	A	13874	33874	43874	
		64	A	13876	33876	43876	
		64	A	13878	33878	43878	
		64	A	13880	33880	43880	
		64	A	13882	33882	43882	
		64	A	13884	33884	43884	
		64	A	13886	33886	43886	
		64	A	13888	33888	43888	
		64	A	13890	33890	43890	
		64	A	13892	33892	43892	
		64	A	13894	33894	43894	
		64	A	13896	33896	43896	
		64	B	18270	38270	48270	
		64	B	18272	38272	48272	
		64	B	18274	38274	48274	
		64	B	18276	38276	48276	
		64	B	18278	38278	48278	
		64	B	18280	38280	48280	
		64	B	18282	38282	48282	
		64	B	18284	38284	48284	
		64	B	18286	38286	48286	
		64	B	18288	38288	48288	
		64	B	18290	38290	48290	
		64	B	18292	38292	48292	
		64	B	18294	38294	48294	
		64	B	18296	38296	48296	
65	ABC_65	ERROR ID 65. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	65	A	13900	43900	
	65	A	13902	43902	
	65	A	13904	43904	
	65	A	13906	43906	
	65	A	13908	43908	
	65	A	13910	43910	
	65	A	13912	43912	
	65	A	13914	43914	
	65	A	13916	43916	
	65	A	13918	43918	
	65	A	13920	43920	
	65	A	13922	43922	
	65	A	13924	43924	
	65	A	13926	43926	
	65	A	13930	43960	
	65	A	13932	43962	
	65	A	13934	43964	
	65	A	13936	43966	
	65	A	13938	43968	
	65	A	13940	43970	
	65	A	13942	43972	
	65	A	13944	43974	
	65	A	13946	43976	
	65	A	13948	43978	
	65	A	13950	43980	
	65	A	13952	43982	
	65	A	13954	43984	
	65	A	13956	43986	
	65	B	18300	48300	
	65	B	18302	48302	
	65	B	18304	48304	
	65	B	18306	48306	
	65	B	18308	48308	
	65	B	18310	48310	
	65	B	18312	48312	
	65	B	18314	48314	
	65	B	18316	48316	
	65	B	18318	48318	
	65	B	18320	48320	
	65	B	18322	48322	
	65	B	18324	48324	
	65	B	18326	48326	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
66	ABC_66	ERROR ID 66. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
66	A	14956	33960	44956	113780
66	A	14957	33962	44957	113782
66	A	14958	33964	44958	113784
66	A	14959	33966	44959	113786
66	A	14960	33968	44960	113788
66	A	14961	33970	44961	113790
66	A	14962	33972	44962	113792
66	A	14963	33974	44963	113794
66	A	14964	33976	44964	113796
66	A	14965	33978	44965	113798
66	A	14966	33980	44966	113800
66	A	14967	33982	44967	113802
66	A	14968	33984	44968	113804
66	A	14969	33986	44969	113806
66	A	15016	34020	45016	
66	A	15017	34022	45017	
66	A	15018	34024	45018	
66	A	15019	34026	45019	
66	A	15020	34028	45020	
66	A	15021	34030	45021	
66	A	15022	34032	45022	
66	A	15023	34034	45023	
66	A	15024	34036	45024	
66	A	15025	34038	45025	
66	A	15026	34040	45026	
66	A	15027	34042	45027	
66	A	15028	34044	45028	
66	A	15029	34046	45029	
66	B	18037	38330	49326	118240
66	B	18038	38332	49327	118242

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
		66	B	18039	38334	49328	118244	
		66	B	18040	38336	49329	118246	
		66	B	18041	38338	49330	118248	
		66	B	18042	38340	49331	118250	
		66	B	18043	38342	49332	118252	
		66	B	18044	38344	49333	118254	
		66	B	18045	38346	49334	118256	
		66	B	18046	38348	49335	118258	
		66	B	18047	38350	49336	118260	
		66	B	18048	38352	49337	118262	
		66	B	18049	38354	49338	118264	
		66	B	18050	38356	49339	118266	
67	ABC_67	ERROR ID 67. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES						Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
67	A	14971	33990	44971	113810
67	A	14972	33992	44972	113812
67	A	14973	33994	44973	113814
67	A	14974	33996	44974	113816
67	A	14975	33998	44975	113818
67	A	14976	34000	44976	113820
67	A	14977	34002	44977	113822
67	A	14978	34004	44978	113824
67	A	14979	34006	44979	113826
67	A	14980	34008	44980	113828
67	A	14981	34010	44981	113830
67	A	14982	34012	44982	113832
67	A	14983	34014	44983	113834
67	A	14984	34016	44984	113836
67	A	15031	34050	45031	
67	A	15032	34052	45032	
67	A	15033	34054	45033	
67	A	15034	34056	45034	
67	A	15035	34058	45035	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

67	A	15036	34060	45036		
67	A	15037	34062	45037		
67	A	15038	34064	45038		
67	A	15039	34066	45039		
67	A	15040	34068	45040		
67	A	15041	34070	45041		
67	A	15042	34072	45042		
67	A	15043	34074	45043		
67	A	15044	34076	45044		
67	B	18052	38360	49341	118270	
67	B	18053	38362	49342	118272	
67	B	18054	38364	49343	118274	
67	B	18055	38366	49344	118276	
67	B	18056	38368	49345	118278	
67	B	18057	38370	49346	118280	
67	B	18058	38372	49347	118282	
67	B	18059	38374	49348	118284	
67	B	18060	38376	49349	118286	
67	B	18061	38378	49350	118288	
67	B	18062	38380	49351	118290	
67	B	18063	38382	49352	118292	
67	B	18064	38384	49353	118294	
67	B	18065	38386	49354	118296	

68 ABC_68 ERROR ID 68. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) PAQUETES DE CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
68	A	14080	34080	44140
68	A	14082	34082	44142
68	A	14084	34084	44144
68	A	14086	34086	44146

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	68	A	14088	34088	44148	
	68	A	14090	34090	44150	
	68	A	14092	34092	44152	
	68	A	14094	34094	44154	
	68	A	14096	34096	44156	
	68	A	14098	34098	44158	
	68	A	14100	34100	44160	
	68	A	14102	34102	44162	
	68	A	14104	34104	44164	
	68	A	14106	34106	44166	
	68	A	14140	34140	44200	
	68	A	14142	34142	44202	
	68	A	14144	34144	44204	
	68	A	14146	34146	44206	
	68	A	14148	34148	44208	
	68	A	14150	34150	44210	
	68	A	14152	34152	44212	
	68	A	14154	34154	44214	
	68	A	14156	34156	44216	
	68	A	14158	34158	44218	
	68	A	14160	34160	44220	
	68	A	14162	34162	44222	
	68	A	14164	34164	44224	
	68	A	14166	34166	44226	
	68	B	18390	38390	48420	
	68	B	18392	38392	48422	
	68	B	18394	38394	48424	
	68	B	18396	38396	48426	
	68	B	18398	38398	48428	
	68	B	18400	38400	48430	
	68	B	18402	38402	48432	
	68	B	18404	38404	48434	
	68	B	18406	38406	48436	
	68	B	18408	38408	48438	
	68	B	18410	38410	48440	
	68	B	18412	38412	48442	
	68	B	18414	38414	48444	
	68	B	18416	38416	48446	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
69	ABC_69	ERROR ID 69. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) PAQUETES DE CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES, (PC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
69	A	14110	34110	44170
69	A	14112	34112	44172
69	A	14114	34114	44174
69	A	14116	34116	44176
69	A	14118	34118	44178
69	A	14120	34120	44180
69	A	14122	34122	44182
69	A	14124	34124	44184
69	A	14126	34126	44186
69	A	14128	34128	44188
69	A	14130	34130	44190
69	A	14132	34132	44192
69	A	14134	34134	44194
69	A	14136	34136	44196
69	A	14170	34170	44230
69	A	14172	34172	44232
69	A	14174	34174	44234
69	A	14176	34176	44236
69	A	14178	34178	44238
69	A	14180	34180	44240
69	A	14182	34182	44242
69	A	14184	34184	44244
69	A	14186	34186	44246
69	A	14188	34188	44248
69	A	14190	34190	44250
69	A	14192	34192	44252
69	A	14194	34194	44254

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	69	A	14196	34196	44256	
	69	B	18420	38420	48450	
	69	B	18422	38422	48452	
	69	B	18424	38424	48454	
	69	B	18426	38426	48456	
	69	B	18428	38428	48458	
	69	B	18430	38430	48460	
	69	B	18432	38432	48462	
	69	B	18434	38434	48464	
	69	B	18436	38436	48466	
	69	B	18438	38438	48468	
	69	B	18440	38440	48470	
	69	B	18442	38442	48472	
	69	B	18444	38444	48474	
	69	B	18446	38446	48476	
	69	B	18450	38450	48480	
	69	B	18452	38452	48482	
	69	B	18454	38454	48484	
	69	B	18456	38456	48486	
	69	B	18458	38458	48488	
	69	B	18460	38460	48490	
	69	B	18462	38462	48492	
	69	B	18464	38464	48494	
	69	B	18466	38466	48496	
	69	B	18468	38468	48498	
	69	B	18470	38470	48500	
	69	B	18472	38472	48502	
	69	B	18474	38474	48504	
	69	B	18476	38476	48506	
	69	B	18960	38870	48930	
	69	B	18962	38872	48932	
	69	B	18964	38874	48934	
	69	B	18966	38876	48936	
	69	B	18968	38878	48938	
	69	B	18970	38880	48940	
	69	B	18972	38882	48942	
	69	B	18974	38884	48944	
	69	B	18976	38886	48946	
	69	B	18978	38888	48948	
	69	B	18980	38890	48950	
	69	B	18982	38892	48952	
	69	B	18984	38894	48954	
	69	B	18986	38896	48956	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
70	ABC_70	ERROR ID 70. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE OTROS SUBYACENTES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
70	A	15076	34200	45076	114230
70	A	15077	34202	45077	114232
70	A	15078	34204	45078	114234
70	A	15079	34206	45079	114236
70	A	15080	34208	45080	114238
70	A	15081	34210	45081	114240
70	A	15082	34212	45082	114242
70	A	15083	34214	45083	114244
70	A	15084	34216	45084	114246
70	A	15085	34218	45085	114248
70	A	15086	34220	45086	114250
70	A	15087	34222	45087	114252
70	A	15088	34224	45088	114254
70	A	15089	34226	45089	114256
70	B	18097	38480	49386	118510
70	B	18098	38482	49387	118512
70	B	18099	38484	49388	118514
70	B	18100	38486	49389	118516
70	B	18101	38488	49390	118518
70	B	18102	38490	49391	118520
70	B	18103	38492	49392	118522
70	B	18104	38494	49393	118524
70	B	18105	38496	49394	118526
70	B	18106	38498	49395	118528
70	B	18107	38500	49396	118530
70	B	18108	38502	49397	118532
70	B	18109	38504	49398	118534

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		70	B	18110	38506	49399	118536	

71 ABC_71 ERROR ID 71. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE TASA DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES FIJA — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
71	A	14230	34230	44290
71	A	14232	34232	44292
71	A	14234	34234	44294
71	A	14236	34236	44296
71	A	14238	34238	44298
71	A	14240	34240	44300
71	A	14242	34242	44302
71	A	14244	34244	44304
71	A	14246	34246	44306
71	A	14248	34248	44308
71	A	14250	34250	44310
71	A	14252	34252	44312
71	A	14254	34254	44314
71	A	14256	34256	44316
71	B	18510	38510	48540
71	B	18512	38512	48542
71	B	18514	38514	48544
71	B	18516	38516	48546
71	B	18518	38518	48548
71	B	18520	38520	48550
71	B	18522	38522	48552
71	B	18524	38524	48554
71	B	18526	38526	48556
71	B	18528	38528	48558
71	B	18530	38530	48560
71	B	18532	38532	48562

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		71	B	18534	38534	48564
		71	B	18536	38536	48566
		71	B	18540	38540	48570
		71	B	18542	38542	48572
		71	B	18544	38544	48574
		71	B	18546	38546	48576
		71	B	18548	38548	48578
		71	B	18550	38550	48580
		71	B	18552	38552	48582
		71	B	18554	38554	48584
		71	B	18556	38556	48586
		71	B	18558	38558	48588
		71	B	18560	38560	48590
		71	B	18562	38562	48592
		71	B	18564	38564	48594
		71	B	18566	38566	48596
		71	B	18990	38900	48960
		71	B	18992	38902	48962
		71	B	18994	38904	48964
		71	B	18996	38906	48966
		71	B	18998	38908	48968
		71	B	19000	38910	48970
		71	B	19002	38912	48972
		71	B	19004	38914	48974
		71	B	19006	38916	48976
		71	B	19008	38918	48978
		71	B	19010	38920	48980
		71	B	19012	38922	48982
		71	B	19014	38924	48984
		71	B	19016	38926	48986
72	ABC_72	ERROR ID 72. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) INTERCAMBIO DE FLUJOS DE DINERO ("SWAPS") DE TASA DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES VARIABLE ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
72	A	14260	34260	44320
72	A	14262	34262	44322
72	A	14264	34264	44324
72	A	14266	34266	44326
72	A	14268	34268	44328
72	A	14270	34270	44330
72	A	14272	34272	44332
72	A	14274	34274	44334
72	A	14276	34276	44336
72	A	14278	34278	44338
72	A	14280	34280	44340
72	A	14282	34282	44342
72	A	14284	34284	44344
72	A	14286	34286	44346
72	B	18570	38570	48600
72	B	18572	38572	48602
72	B	18574	38574	48604
72	B	18576	38576	48606
72	B	18578	38578	48608
72	B	18580	38580	48610
72	B	18582	38582	48612
72	B	18584	38584	48614
72	B	18586	38586	48616
72	B	18588	38588	48618
72	B	18590	38590	48620
72	B	18592	38592	48622
72	B	18594	38594	48624
72	B	18596	38596	48626

73	ABC_73	ERROR ID 73. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES CON OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
73	A	14290	34290	44350
73	A	14292	34292	44352
73	A	14294	34294	44354
73	A	14296	34296	44356
73	A	14298	34298	44358
73	A	14300	34300	44360
73	A	14302	34302	44362
73	A	14304	34304	44364
73	A	14306	34306	44366
73	A	14308	34308	44368
73	A	14310	34310	44370
73	A	14312	34312	44372
73	A	14314	34314	44374
73	A	14316	34316	44376
73	B	18600	38600	48630
73	B	18602	38602	48632
73	B	18604	38604	48634
73	B	18606	38606	48636
73	B	18608	38608	48638
73	B	18610	38610	48640
73	B	18612	38612	48642
73	B	18614	38614	48644
73	B	18616	38616	48646
73	B	18618	38618	48648
73	B	18620	38620	48650
73	B	18622	38622	48652
73	B	18624	38624	48654
73	B	18626	38626	48656

74	ABC_74	ERROR ID 74. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE TASAS DE INTERES CON OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
74	A	14650	34530	44620
74	A	14652	34532	44622
74	A	14654	34534	44624
74	A	14656	34536	44626
74	A	14658	34538	44628
74	A	14660	34540	44630
74	A	14662	34542	44632
74	A	14664	34544	44634
74	A	14666	34546	44636
74	A	14668	34548	44638
74	A	14670	34550	44640
74	A	14672	34552	44642
74	A	14674	34554	44644
74	A	14676	34556	44646
74	B	19020	38930	48990
74	B	19022	38932	48992
74	B	19024	38934	48994
74	B	19026	38936	48996
74	B	19028	38938	48998
74	B	19030	38940	49000
74	B	19032	38942	49002
74	B	19034	38944	49004
74	B	19036	38946	49006
74	B	19038	38948	49008
74	B	19040	38950	49010
74	B	19042	38952	49012
74	B	19044	38954	49014
74	B	19046	38956	49016

75	ABC_75	ERROR ID 75. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE TASAS DE INTERES CON TENENCIA DE VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
75	A	14320	34320	44380
75	A	14322	34322	44382
75	A	14324	34324	44384
75	A	14326	34326	44386
75	A	14328	34328	44388
75	A	14330	34330	44390
75	A	14332	34332	44392
75	A	14334	34334	44394
75	A	14336	34336	44396
75	A	14338	34338	44398
75	A	14340	34340	44400
75	A	14342	34342	44402
75	A	14344	34344	44404
75	A	14346	34346	44406
75	B	18630	38630	48660
75	B	18632	38632	48662
75	B	18634	38634	48664
75	B	18636	38636	48666
75	B	18638	38638	48668
75	B	18640	38640	48670
75	B	18642	38642	48672
75	B	18644	38644	48674
75	B	18646	38646	48676
75	B	18648	38648	48678
75	B	18650	38650	48680
75	B	18652	38652	48682
75	B	18654	38654	48684
75	B	18656	38656	48686

76	ABC_76	ERROR ID 76. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES CON EMISIÓN DE COMPRA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
76	A	14680	34560	44650
76	A	14682	34562	44652
76	A	14684	34564	44654
76	A	14686	34566	44656
76	A	14688	34568	44658
76	A	14690	34570	44660
76	A	14692	34572	44662
76	A	14694	34574	44664
76	A	14696	34576	44666
76	A	14698	34578	44668
76	A	14700	34580	44670
76	A	14702	34582	44672
76	A	14704	34584	44674
76	A	14706	34586	44676
76	B	19050	38960	49020
76	B	19052	38962	49022
76	B	19054	38964	49024
76	B	19056	38966	49026
76	B	19058	38968	49028
76	B	19060	38970	49030
76	B	19062	38972	49032
76	B	19064	38974	49034
76	B	19066	38976	49036
76	B	19068	38978	49038
76	B	19070	38980	49040
76	B	19072	38982	49042
76	B	19074	38984	49044
76	B	19076	38986	49046

77	ABC_77	ERROR ID 77. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE DIVISAS CON OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
77	A	14350	44440
77	A	14352	44442
77	A	14354	44444
77	A	14356	44446
77	A	14358	44448
77	A	14360	44450
77	A	14362	44452
77	A	14364	44454
77	A	14366	44456
77	A	14368	44458
77	A	14370	44460
77	A	14372	44462
77	A	14374	44464
77	A	14376	44466
77	B	18660	48720
77	B	18662	48722
77	B	18664	48724
77	B	18666	48726
77	B	18668	48728
77	B	18670	48730
77	B	18672	48732
77	B	18674	48734
77	B	18676	48736
77	B	18678	48738
77	B	18680	48740
77	B	18682	48742
77	B	18684	48744
77	B	18686	48746

78	ABC_78	ERROR ID 78. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE DIVISAS CON OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
78	A	14710	44710
78	A	14712	44712
78	A	14714	44714
78	A	14716	44716
78	A	14718	44718
78	A	14720	44720
78	A	14722	44722
78	A	14724	44724
78	A	14726	44726
78	A	14728	44728
78	A	14730	44730
78	A	14732	44732
78	A	14734	44734
78	A	14736	44736
78	B	19080	49080
78	B	19082	49082
78	B	19084	49084
78	B	19086	49086
78	B	19088	49088
78	B	19090	49090
78	B	19092	49092
78	B	19094	49094
78	B	19096	49096
78	B	19098	49098
78	B	19100	49100
78	B	19102	49102
78	B	19104	49104
78	B	19106	49106

79	ABC_79	ERROR ID 79. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON TENENCIA DE COMPRA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
79	A	15121	34380	45121	114290
79	A	15122	34382	45122	114292
79	A	15123	34384	45123	114294
79	A	15124	34386	45124	114296
79	A	15125	34388	45125	114298
79	A	15126	34390	45126	114300
79	A	15127	34392	45127	114302
79	A	15128	34394	45128	114304
79	A	15129	34396	45129	114306
79	A	15130	34398	45130	114308
79	A	15131	34400	45131	114310
79	A	15132	34402	45132	114312
79	A	15133	34404	45133	114314
79	A	15134	34406	45134	114316
79	B	19351	38690	49431	118600
79	B	19352	38692	49432	118602
79	B	19353	38694	49433	118604
79	B	19354	38696	49434	118606
79	B	19355	38698	49435	118608
79	B	19356	38700	49436	118610
79	B	19357	38702	49437	118612
79	B	19358	38704	49438	118614
79	B	19359	38706	49439	118616
79	B	19360	38708	49440	118618
79	B	19361	38710	49441	118620
79	B	19362	38712	49442	118622
79	B	19363	38714	49443	118624
79	B	19364	38716	49444	118626

80	ABC_80	ERROR ID 80. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON EMISIÓN DE VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
80	A	15286	34590	45196
80	A	15287	34592	45197
80	A	15288	34594	45198
80	A	15289	34596	45199
80	A	15290	34598	45200
80	A	15291	34600	45201
80	A	15292	34602	45202
80	A	15293	34604	45203
80	A	15294	34606	45204
80	A	15295	34608	45205
80	A	15296	34610	45206
80	A	15297	34612	45207
80	A	15298	34614	45208
80	A	15299	34616	45209
80	B	19501	38990	49491
80	B	19502	38992	49492
80	B	19503	38994	49493
80	B	19504	38996	49494
80	B	19505	38998	49495
80	B	19506	39000	49496
80	B	19507	39002	49497
80	B	19508	39004	49498
80	B	19509	39006	49499
80	B	19510	39008	49500
80	B	19511	39010	49501
80	B	19512	39012	49502
80	B	19513	39014	49503
80	B	19514	39016	49504

81	ABC_81	ERROR ID 81. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON TENENCIA DE VENTA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
81	A	15136	34410	45136	114320
81	A	15137	34412	45137	114322
81	A	15138	34414	45138	114324
81	A	15139	34416	45139	114326
81	A	15140	34418	45140	114328
81	A	15141	34420	45141	114330
81	A	15142	34422	45142	114332
81	A	15143	34424	45143	114334
81	A	15144	34426	45144	114336
81	A	15145	34428	45145	114338
81	A	15146	34430	45146	114340
81	A	15147	34432	45147	114342
81	A	15148	34434	45148	114344
81	A	15149	34436	45149	114346
81	B	19366	38720	49446	118630
81	B	19367	38722	49447	118632
81	B	19368	38724	49448	118634
81	B	19369	38726	49449	118636
81	B	19370	38728	49450	118638
81	B	19371	38730	49451	118640
81	B	19372	38732	49452	118642
81	B	19373	38734	49453	118644
81	B	19374	38736	49454	118646
81	B	19375	38738	49455	118648
81	B	19376	38740	49456	118650
81	B	19377	38742	49457	118652
81	B	19378	38744	49458	118654
81	B	19379	38746	49459	118656

82	ABC_82	ERROR ID 82. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON EMISIÓN DE COMPRA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
82	A	15301	34620	45211
82	A	15302	34622	45212
82	A	15303	34624	45213
82	A	15304	34626	45214
82	A	15305	34628	45215
82	A	15306	34630	45216
82	A	15307	34632	45217
82	A	15308	34634	45218
82	A	15309	34636	45219
82	A	15310	34638	45220
82	A	15311	34640	45221
82	A	15312	34642	45222
82	A	15313	34644	45223
82	A	15314	34646	45224
82	B	19516	39020	49506
82	B	19517	39022	49507
82	B	19518	39024	49508
82	B	19519	39026	49509
82	B	19520	39028	49510
82	B	19521	39030	49511
82	B	19522	39032	49512
82	B	19523	39034	49513
82	B	19524	39036	49514
82	B	19525	39038	49515
82	B	19526	39040	49516
82	B	19527	39042	49517
82	B	19528	39044	49518
82	B	19529	39046	49519

83	ABC_83	ERROR ID 83. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL, (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
83	A	14440	34440	44530	114440
83	A	14442	34442	44532	114442
83	A	14444	34444	44534	114444
83	A	14446	34446	44536	114446
83	A	14448	34448	44538	114448
83	A	14450	34450	44540	114450
83	A	14452	34452	44542	114452
83	A	14454	34454	44544	114454
83	A	14456	34456	44546	114456
83	A	14458	34458	44548	114458
83	A	14460	34460	44550	114460
83	A	14462	34462	44552	114462
83	A	14464	34464	44554	114464
83	A	14466	34466	44556	114466
83	B	18750	38750	48810	118750
83	B	18752	38752	48812	118752
83	B	18754	38754	48814	118754
83	B	18756	38756	48816	118756
83	B	18758	38758	48818	118758
83	B	18760	38760	48820	118760
83	B	18762	38762	48822	118762
83	B	18764	38764	48824	118764
83	B	18766	38766	48826	118766
83	B	18768	38768	48828	118768
83	B	18770	38770	48830	118770
83	B	18772	38772	48832	118772
83	B	18774	38774	48834	118774
83	B	18776	38776	48836	118776

84	ABC_84	ERROR ID 84. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO , (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
84	A	14470	34470	44560	114470
84	A	14472	34472	44562	114472
84	A	14474	34474	44564	114474
84	A	14476	34476	44566	114476
84	A	14478	34478	44568	114478
84	A	14480	34480	44570	114480
84	A	14482	34482	44572	114482
84	A	14484	34484	44574	114484
84	A	14486	34486	44576	114486
84	A	14488	34488	44578	114488
84	A	14490	34490	44580	114490
84	A	14492	34492	44582	114492
84	A	14494	34494	44584	114494
84	A	14496	34496	44586	114496
84	B	18780	38780	48840	118780
84	B	18782	38782	48842	118782
84	B	18784	38784	48844	118784
84	B	18786	38786	48846	118786
84	B	18788	38788	48848	118788
84	B	18790	38790	48850	118790
84	B	18792	38792	48852	118792
84	B	18794	38794	48854	118794
84	B	18796	38796	48856	118796
84	B	18798	38798	48858	118798
84	B	18800	38800	48860	118800
84	B	18802	38802	48862	118802
84	B	18804	38804	48864	118804
84	B	18806	38806	48866	118806

85	ABC_85	ERROR ID 85. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
85	A	14590
85	A	14592
85	A	14594
85	A	14596
85	A	14598
85	A	14600
85	A	14602
85	A	14604
85	A	14606
85	A	14608
85	A	14610
85	A	14612
85	A	14614
85	A	14616
85	A	15181
85	A	15182
85	A	15183
85	A	15184
85	A	15185
85	A	15186
85	A	15187
85	A	15188
85	A	15189
85	A	15190
85	A	15191
85	A	15192
85	A	15193
85	A	15194
85	B	19381
85	B	19382
85	B	19383
85	B	19384
85	B	19385
85	B	19386
85	B	19387

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		85	B	19388	
		85	B	19389	
		85	B	19390	
		85	B	19391	
		85	B	19392	
		85	B	19393	
		85	B	19394	
86	ABC_86	ERROR ID 86. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TÍTULOS A ENTREGAR POR FUTUROS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS (FASE PASIVA) ASI COMO OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA TASA FIJA); COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR [OPERACIONES CON TÍTULOS DE DEUDA A TASA FIJA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS (FASE ACTIVA)]			Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
86	A	14620
86	A	14622
86	A	14624
86	A	14626
86	A	14628
86	A	14630
86	A	14632
86	A	14634
86	A	14636
86	A	14638
86	A	14640
86	A	14642
86	A	14644
86	A	14646
86	A	15196
86	A	15197
86	A	15198
86	A	15199
86	A	15200

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		86	A	15201	
		86	A	15202	
		86	A	15203	
		86	A	15204	
		86	A	15205	
		86	A	15206	
		86	A	15207	
		86	A	15208	
		86	A	15209	
		86	B	19411	
		86	B	19412	
		86	B	19413	
		86	B	19414	
		86	B	19415	
		86	B	19416	
		86	B	19417	
		86	B	19418	
		86	B	19419	
		86	B	19420	
		86	B	19421	
		86	B	19422	
		86	B	19423	
		86	B	19424	
		86	B	19441	
		86	B	19442	
		86	B	19443	
		86	B	19444	
		86	B	19445	
		86	B	19446	
		86	B	19447	
		86	B	19448	
		86	B	19449	
		86	B	19450	
		86	B	19451	
		86	B	19452	
		86	B	19453	
		86	B	19454	
87	ABC_87	ERROR ID 87. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL			Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
87	A	14530
87	A	14532
87	A	14534
87	A	14536
87	A	14538
87	A	14540
87	A	14542
87	A	14544
87	A	14546
87	A	14548
87	A	14550
87	A	14552
87	A	14554
87	A	14556
87	B	19290
87	B	19292
87	B	19294
87	B	19296
87	B	19298
87	B	19300
87	B	19302
87	B	19304
87	B	19306
87	B	19308
87	B	19310
87	B	19312
87	B	19314
87	B	19316

88	ABC_88	ERROR ID 88. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
88	A	14560
88	A	14562
88	A	14564
88	A	14566
88	A	14568
88	A	14570
88	A	14572
88	A	14574
88	A	14576
88	A	14578
88	A	14580
88	A	14582
88	A	14584
88	A	14586
88	B	19320
88	B	19322
88	B	19324
88	B	19326
88	B	19328
88	B	19330
88	B	19332
88	B	19334
88	B	19336
88	B	19338
88	B	19340
88	B	19342
88	B	19344
88	B	19346

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
89	ABC_89	ERROR ID 89. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
89	A	43930
89	A	43932
89	A	43934
89	A	43936
89	A	43938
89	A	43940
89	A	43942
89	A	43944
89	A	43946
89	A	43948
89	A	43950
89	A	43952
89	A	43954
89	A	43956
89	A	43990
89	A	43992
89	A	43994
89	A	43996
89	A	43998
89	A	44000
89	A	44002
89	A	44004
89	A	44006
89	A	44008
89	A	44010
89	A	44012
89	A	44014
89	A	44016
89	B	48330
89	B	48332
89	B	48334
89	B	48336
89	B	48338

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="3">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48340</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48342</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48344</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48346</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48348</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48350</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48352</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48354</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>89</td><td>B</td><td>48356</td><td></td></tr>
<tr><td>90</td><td>ABC_90</td><td colspan="3">ERROR ID 90. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA DIVISAS CON TENENCIA DE COMPRA
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td></td><td></td><td colspan="3"><table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44410</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44412</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44414</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44416</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44418</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44420</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44422</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44424</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44426</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44428</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44430</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44432</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44434</td></tr>
<tr><td>90</td><td>A</td><td>44436</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48690</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48692</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48694</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48696</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48698</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48700</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48702</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48704</td></tr>
<tr><td>90</td><td>B</td><td>48706</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="3">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>90</td><td>B</td><td>48708</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>90</td><td>B</td><td>48710</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>90</td><td>B</td><td>48712</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>90</td><td>B</td><td>48714</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>90</td><td>B</td><td>48716</td><td></td></tr>
<tr><td>91</td><td>ABC_91</td><td colspan="3">ERROR ID 91. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE VENTA SOBRE DIVISAS CON EMISIÓN DE VENTA
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
91	A	44680
91	A	44682
91	A	44684
91	A	44686
91	A	44688
91	A	44690
91	A	44692
91	A	44694
91	A	44696
91	A	44698
91	A	44700
91	A	44702
91	A	44704
91	A	44706
91	B	49050
91	B	49052
91	B	49054
91	B	49056
91	B	49058
91	B	49060
91	B	49062
91	B	49064
91	B	49066
91	B	49068
91	B	49070
91	B	49072
91	B	49074

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

91	B	49076

92 ABC_92 ERROR ID 92. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA), (PC) EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES, COMPENSADA, CON TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL. AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
92	A	14800	34650	44800
92	A	14802	34652	44802
92	A	14804	34654	44804
92	A	14806	34656	44806
92	A	14808	34658	44808
92	A	14810	34660	44810
92	A	14812	34662	44812
92	A	14814	34664	44814
92	A	14816	34666	44816
92	A	14818	34668	44818
92	A	14820	34670	44820
92	A	14822	34672	44822
92	A	14824	34674	44824
92	A	14826	34676	44826
92	B	19170	39050	49170
92	B	19172	39052	49172
92	B	19174	39054	49174
92	B	19176	39056	49176
92	B	19178	39058	49178
92	B	19180	39060	49180
92	B	19182	39062	49182
92	B	19184	39064	49184
92	B	19186	39066	49186
92	B	19188	39068	49188
92	B	19190	39070	49190
92	B	19192	39072	49192

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		92	B	19194	39074	49194
		92	B	19196	39076	49196
93	ABC_93	ERROR ID 93. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES , COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL, AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
93	A	14830	34680	44830
93	A	14832	34682	44832
93	A	14834	34684	44834
93	A	14836	34686	44836
93	A	14838	34688	44838
93	A	14840	34690	44840
93	A	14842	34692	44842
93	A	14844	34694	44844
93	A	14846	34696	44846
93	A	14848	34698	44848
93	A	14850	34700	44850
93	A	14852	34702	44852
93	A	14854	34704	44854
93	A	14856	34706	44856
93	B	19200	39080	49200
93	B	19202	39082	49202
93	B	19204	39084	49204
93	B	19206	39086	49206
93	B	19208	39088	49208
93	B	19210	39090	49210
93	B	19212	39092	49212
93	B	19214	39094	49214
93	B	19216	39096	49216
93	B	19218	39098	49218
93	B	19220	39100	49220

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		93	B	19222	39102	49222
		93	B	19224	39104	49224
		93	B	19226	39106	49226
94	ABC_94	ERROR ID 94. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA), (PC) EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES, COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES. AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
94	A	14860	34710	44860
94	A	14862	34712	44862
94	A	14864	34714	44864
94	A	14866	34716	44866
94	A	14868	34718	44868
94	A	14870	34720	44870
94	A	14872	34722	44872
94	A	14874	34724	44874
94	A	14876	34726	44876
94	A	14878	34728	44878
94	A	14880	34730	44880
94	A	14882	34732	44882
94	A	14884	34734	44884
94	A	14886	34736	44886
94	B	19230	39110	49230
94	B	19232	39112	49232
94	B	19234	39114	49234
94	B	19236	39116	49236
94	B	19238	39118	49238
94	B	19240	39120	49240
94	B	19242	39122	49242
94	B	19244	39124	49244
94	B	19246	39126	49246
94	B	19248	39128	49248
94	B	19250	39130	49250

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		94	B	19252	39132	49252
		94	B	19254	39134	49254
		94	B	19256	39136	49256
95	ABC_95	ERROR ID 95. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES , DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES , COMPENSADA EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL, AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR"				Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
95	A	14890	34740	44890
95	A	14892	34742	44892
95	A	14894	34744	44894
95	A	14896	34746	44896
95	A	14898	34748	44898
95	A	14900	34750	44900
95	A	14902	34752	44902
95	A	14904	34754	44904
95	A	14906	34756	44906
95	A	14908	34758	44908
95	A	14910	34760	44910
95	A	14912	34762	44912
95	A	14914	34764	44914
95	A	14916	34766	44916
95	B	19260	39140	49260
95	B	19262	39142	49262
95	B	19264	39144	49264
95	B	19266	39146	49266
95	B	19268	39148	49268
95	B	19270	39150	49270
95	B	19272	39152	49272

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		95	B	19274	39154	49274
		95	B	19276	39156	49276
		95	B	19278	39158	49278
		95	B	19280	39160	49280
		95	B	19282	39162	49282
		95	B	19284	39164	49284
		95	B	19286	39166	49286

96 ABC_96 ERROR ID 96. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (OPERACIONES FECHA VALOR 24,48,72 Y 96 HRS, PENDIENTESDE LIQUIDAR) , (PC) COMPRA DE ACCIONES, TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES, Y TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A INDICES ACCIONARIOS (FECHA VALOR PENDIENTES DE LIQUIDAR) — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
96	A	14921	44921
96	A	14922	44922
96	B	18002	49291
96	B	18003	49292

97 ABC_97 ERROR ID 97. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) COMPRA AL CONTADO DE MERCANCIAS , (PC) COMPENSACIÓN DE COMPRA AL CONTADO DE MERCANCIAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
97	A	14924	44924
97	B	18005	49294

98 ABC_98

ERROR ID 98. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) "FORWARDS" DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) , (PC) FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
98	A	14926	44926
98	A	14927	44927
98	A	14928	44928
98	A	14929	44929
98	A	14930	44930
98	A	14931	44931
98	A	14932	44932
98	A	14933	44933
98	A	14934	44934
98	A	14935	44935
98	A	14936	44936
98	A	14937	44937
98	A	14938	44938
98	A	14939	44939
98	A	14986	44986
98	A	14987	44987
98	A	14988	44988
98	A	14989	44989

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		98	A	14990	44990	
		98	A	14991	44991	
		98	A	14992	44992	
		98	A	14993	44993	
		98	A	14994	44994	
		98	A	14995	44995	
		98	A	14996	44996	
		98	A	14997	44997	
		98	A	14998	44998	
		98	A	14999	44999	
		98	B	18007	49296	
		98	B	18008	49297	
		98	B	18009	49298	
		98	B	18010	49299	
		98	B	18011	49300	
		98	B	18012	49301	
		98	B	18013	49302	
		98	B	18014	49303	
		98	B	18015	49304	
		98	B	18016	49305	
		98	B	18017	49306	
		98	B	18018	49307	
		98	B	18019	49308	
		98	B	18020	49309	
99	ABC_99	ERROR ID 99. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) “FORWARDS" DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA). , (PC) FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*		Nivel
99	A	14941	44941	
99	A	14942	44942	
99	A	14943	44943	
99	A	14944	44944	
99	A	14945	44945	
99	A	14946	44946	
99	A	14947	44947	
99	A	14948	44948	
99	A	14949	44949	
99	A	14950	44950	
99	A	14951	44951	
99	A	14952	44952	
99	A	14953	44953	
99	A	14954	44954	
99	A	15001	45001	
99	A	15002	45002	
99	A	15003	45003	
99	A	15004	45004	
99	A	15005	45005	
99	A	15006	45006	
99	A	15007	45007	
99	A	15008	45008	
99	A	15009	45009	
99	A	15010	45010	
99	A	15011	45011	
99	A	15012	45012	
99	A	15013	45013	
99	A	15014	45014	
99	B	18022	49311	
99	B	18023	49312	
99	B	18024	49313	
99	B	18025	49314	
99	B	18026	49315	
99	B	18027	49316	
99	B	18028	49317	
99	B	18029	49318	
99	B	18030	49319	
99	B	18031	49320	
99	B	18032	49321	
99	B	18033	49322	
99	B	18034	49323	
99	B	18035	49324	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
100	ABC_100	ERROR ID 100. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) SWAPS RELATIVOS A: ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) , (PC) COMPENSACIÓN DE SWAPS RELATIVOS A ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA)	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
100	A	15046	45046
100	A	15047	45047
100	A	15048	45048
100	A	15049	45049
100	A	15050	45050
100	A	15051	45051
100	A	15052	45052
100	A	15053	45053
100	A	15054	45054
100	A	15055	45055
100	A	15056	45056
100	A	15057	45057
100	A	15058	45058
100	A	15059	45059
100	B	18067	49356
100	B	18068	49357

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		100	B	18069	49358
		100	B	18070	49359
		100	B	18071	49360
		100	B	18072	49361
		100	B	18073	49362
		100	B	18074	49363
		100	B	18075	49364
		100	B	18076	49365
		100	B	18077	49366
		100	B	18078	49367
		100	B	18079	49368
		100	B	18080	49369
101	ABC_101	ERROR ID 101. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) COMPENSACIÓN DE SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
101	A	15061	45061
101	A	15062	45062
101	A	15063	45063
101	A	15064	45064
101	A	15065	45065
101	A	15066	45066
101	A	15067	45067
101	A	15068	45068
101	A	15069	45069
101	A	15070	45070
101	A	15071	45071
101	A	15072	45072
101	A	15073	45073
101	A	15074	45074
101	B	18082	49371

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		101	B	18083	49372
		101	B	18084	49373
		101	B	18085	49374
		101	B	18086	49375
		101	B	18087	49376
		101	B	18088	49377
		101	B	18089	49378
		101	B	18090	49379
		101	B	18091	49380
		101	B	18092	49381
		101	B	18093	49382
		101	B	18094	49383
		101	B	18095	49384
102	ABC_102	ERROR ID 102. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA), (PC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
102	A	15091	45091
102	A	15092	45092
102	A	15093	45093
102	A	15094	45094
102	A	15095	45095
102	A	15096	45096
102	A	15097	45097
102	A	15098	45098
102	A	15099	45099
102	A	15100	45100
102	A	15101	45101
102	A	15102	45102
102	A	15103	45103
102	A	15104	45104

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		102	B	18112	49401	
		102	B	18113	49402	
		102	B	18114	49403	
		102	B	18115	49404	
		102	B	18116	49405	
		102	B	18117	49406	
		102	B	18118	49407	
		102	B	18119	49408	
		102	B	18120	49409	
		102	B	18121	49410	
		102	B	18122	49411	
		102	B	18123	49412	
		102	B	18124	49413	
		102	B	18125	49414	
103	ABC_103	ERROR ID 103. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA), (PC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
103	A	15106	45106
103	A	15107	45107
103	A	15108	45108
103	A	15109	45109
103	A	15110	45110
103	A	15111	45111
103	A	15112	45112
103	A	15113	45113
103	A	15114	45114
103	A	15115	45115
103	A	15116	45116
103	A	15117	45117
103	A	15118	45118
103	A	15119	45119

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		103	B	18127	49416	
		103	B	18128	49417	
		103	B	18129	49418	
		103	B	18130	49419	
		103	B	18131	49420	
		103	B	18132	49421	
		103	B	18133	49422	
		103	B	18134	49423	
		103	B	18135	49424	
		103	B	18136	49425	
		103	B	18137	49426	
		103	B	18138	49427	
		103	B	18139	49428	
		103	B	18140	49429	
104	ABC_104	ERROR ID 104. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) FUTUROS DE COMPRA DE TÍTULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) , (PC) FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA)				Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
104	A	15151
104	A	15152
104	A	15153
104	A	15154
104	A	15155
104	A	15156
104	A	15157
104	A	15158
104	A	15159
104	A	15160
104	A	15161
104	A	15162
104	A	15163
104	A	15164
104	A	15211

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		104	A	15212	
		104	A	15213	
		104	A	15214	
		104	A	15215	
		104	A	15216	
		104	A	15217	
		104	A	15218	
		104	A	15219	
		104	A	15220	
		104	A	15221	
		104	A	15222	
		104	A	15223	
		104	A	15224	
		104	B	19396	
		104	B	19397	
		104	B	19398	
		104	B	19399	
		104	B	19400	
		104	B	19401	
		104	B	19402	
		104	B	19403	
		104	B	19404	
		104	B	19405	
		104	B	19406	
		104	B	19407	
		104	B	19408	
		104	B	19409	
105	ABC_105	ERROR ID 105. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
105	A	15166

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*		Nivel
	105	A	15167	
	105	A	15168	
	105	A	15169	
	105	A	15170	
	105	A	15171	
	105	A	15172	
	105	A	15173	
	105	A	15174	
	105	A	15175	
	105	A	15176	
	105	A	15177	
	105	A	15178	
	105	A	15179	
	105	A	15226	
	105	A	15227	
	105	A	15228	
	105	A	15229	
	105	A	15230	
	105	A	15231	
	105	A	15232	
	105	A	15233	
	105	A	15234	
	105	A	15235	
	105	A	15236	
	105	A	15237	
	105	A	15238	
	105	A	15239	
	105	B	19426	
	105	B	19427	
	105	B	19428	
	105	B	19429	
	105	B	19430	
	105	B	19431	
	105	B	19432	
	105	B	19433	
	105	B	19434	
	105	B	19435	
	105	B	19436	
	105	B	19437	
	105	B	19438	
	105	B	19439	
	105	B	19456	
	105	B	19457	
	105	B	19458	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		105	B	19459	
		105	B	19460	
		105	B	19461	
		105	B	19462	
		105	B	19463	
		105	B	19464	
		105	B	19465	
		105	B	19466	
		105	B	19467	
		105	B	19468	
		105	B	19469	
107	ABC_107	ERROR ID 107. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS. (FASE PASIVA), (PC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA). COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
107	A	15241	45151
107	A	15242	45152
107	A	15243	45153
107	A	15244	45154
107	A	15245	45155
107	A	15246	45156
107	A	15247	45157
107	A	15248	45158
107	A	15249	45159
107	A	15250	45160
107	A	15251	45161

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		107	A	15252	45162	
		107	A	15253	45163	
		107	A	15254	45164	
		107	A	15256	45166	
		107	A	15257	45167	
		107	A	15258	45168	
		107	A	15259	45169	
		107	A	15260	45170	
		107	A	15261	45171	
		107	A	15262	45172	
		107	A	15263	45173	
		107	A	15264	45174	
		107	A	15265	45175	
		107	A	15266	45176	
		107	A	15267	45177	
		107	A	15268	45178	
		107	A	15269	45179	
		107	B	19471	49461	
		107	B	19472	49462	
		107	B	19473	49463	
		107	B	19474	49464	
		107	B	19475	49465	
		107	B	19476	49466	
		107	B	19477	49467	
		107	B	19478	49468	
		107	B	19479	49469	
		107	B	19480	49470	
		107	B	19481	49471	
		107	B	19482	49472	
		107	B	19483	49473	
		107	B	19484	49474	
108	ABC_108	ERROR ID 108. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA), (PC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA). COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**				Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
108	A	15271	45181
108	A	15272	45182
108	A	15273	45183
108	A	15274	45184
108	A	15275	45185
108	A	15276	45186
108	A	15277	45187
108	A	15278	45188
108	A	15279	45189
108	A	15280	45190
108	A	15281	45191
108	A	15282	45192
108	A	15283	45193
108	A	15284	45194
108	B	19486	49476
108	B	19487	49477
108	B	19488	49478
108	B	19489	49479
108	B	19490	49480
108	B	19491	49481
108	B	19492	49482
108	B	19493	49483
108	B	19494	49484
108	B	19495	49485
108	B	19496	49486
108	B	19497	49487
108	B	19498	49488
108	B	19499	49489

109	ABC_109	ERROR ID 109. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “CAP” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
109	A	183052
109	A	183054
109	A	183056
109	A	183058
109	A	183060
109	A	183062
109	A	183064
109	A	183066
109	A	183068
109	A	183070
109	A	183072
109	A	183074
109	A	183076
109	A	183078
109	B	186052
109	B	186054
109	B	186056
109	B	186058
109	B	186060
109	B	186062
109	B	186064
109	B	186066
109	B	186068
109	B	186070
109	B	186072
109	B	186074
109	B	186076
109	B	186078

110	ABC_110	ERROR ID 110. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
110	A	183102
110	A	183104
110	A	183106
110	A	183108
110	A	183110
110	A	183112
110	A	183114
110	A	183116
110	A	183118
110	A	183120
110	A	183122
110	A	183124
110	A	183126
110	A	183128
110	B	186102
110	B	186104
110	B	186106
110	B	186108
110	B	186110
110	B	186112
110	B	186114
110	B	186116
110	B	186118
110	B	186120
110	B	186122
110	B	186124
110	B	186126
110	B	186128

111	ABC_111	ERROR ID 111. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183252</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183254</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183256</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183258</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183260</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183262</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183264</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183266</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183268</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183270</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183272</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183274</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183276</td></tr>
<tr><td>111</td><td>A</td><td>183278</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186152</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186154</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186156</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186158</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186160</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186162</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186164</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186166</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186168</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186170</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186172</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186174</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186176</td></tr>
<tr><td>111</td><td>B</td><td>186178</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>112</td><td>ABC_112</td><td>ERROR ID 112. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA), (PC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL TIPO "CAP” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA)</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
112	A	183352
112	A	183354
112	A	183356
112	A	183358
112	A	183360
112	A	183362
112	A	183364
112	A	183366
112	A	183368
112	A	183370
112	A	183372
112	A	183374
112	A	183376
112	A	183378
112	B	186202
112	B	186204
112	B	186206
112	B	186208
112	B	186210
112	B	186212
112	B	186214
112	B	186216
112	B	186218
112	B	186220
112	B	186222
112	B	186224
112	B	186226
112	B	186228

113	ABC_113	ERROR ID 113. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL, (PC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
113	A	183402
113	A	183404
113	A	183406
113	A	183408
113	A	183410
113	A	183412
113	A	183414
113	A	183416
113	A	183418
113	A	183420
113	A	183422
113	A	183424
113	A	183426
113	A	183428
113	B	186252
113	B	186254
113	B	186256
113	B	186258
113	B	186260
113	B	186262
113	B	186264
113	B	186266
113	B	186268
113	B	186270
113	B	186272
113	B	186274
113	B	186276
113	B	186278

114	ABC_114	ERROR ID 114. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) , (PC) UDIS A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
114	A	183552
114	A	183554
114	A	183556
114	A	183558
114	A	183560
114	A	183562
114	A	183564
114	A	183566
114	A	183568
114	A	183570
114	A	183572
114	A	183574
114	A	183576
114	A	183578
114	B	186302
114	B	186304
114	B	186306
114	B	186308
114	B	186310
114	B	186312
114	B	186314
114	B	186316
114	B	186318
114	B	186320
114	B	186322
114	B	186324
114	B	186326
114	B	186328

115	ABC_115	ERROR ID 115. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA). , (PC) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO “CAP” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO "CAP", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA). ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
115	A	183652
115	A	183654
115	A	183656
115	A	183658
115	A	183660
115	A	183662
115	A	183664
115	A	183666
115	A	183668
115	A	183670
115	A	183672
115	A	183674
115	A	183676
115	A	183678
115	B	186352
115	B	186354
115	B	186356
115	B	186358
115	B	186360
115	B	186362
115	B	186364
115	B	186366
115	B	186368
115	B	186370
115	B	186372
115	B	186374
115	B	186376
115	B	186378

116	ABC_116	ERROR ID 116. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE DIVISAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
116	A	183702
116	A	183704
116	A	183706
116	A	183708
116	A	183710
116	A	183712
116	A	183714
116	A	183716
116	A	183718
116	A	183720
116	A	183722
116	A	183724
116	A	183726
116	A	183728
116	B	186402
116	B	186404
116	B	186406
116	B	186408
116	B	186410
116	B	186412
116	B	186414
116	B	186416
116	B	186418
116	B	186420
116	B	186422
116	B	186424
116	B	186426
116	B	186428

117	ABC_117	ERROR ID 117. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
117	A	183752
117	A	183754
117	A	183756
117	A	183758
117	A	183760
117	A	183762
117	A	183764
117	A	183766
117	A	183768
117	A	183770
117	A	183772
117	A	183774
117	A	183776
117	A	183778
117	B	186452
117	B	186454
117	B	186456
117	B	186458
117	B	186460
117	B	186462
117	B	186464
117	B	186466
117	B	186468
117	B	186470
117	B	186472
117	B	186474
117	B	186476
117	B	186478

118	ABC_118	ERROR ID 118. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E.; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "CAP" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES DE COMPRA DE TASA DE INTERES EN M.E.; DISTINTOS A LAS OPCIONES DE COMPRA TIPO "CAP" (FASE PASIVA)	Grave

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
118	A	183952
118	A	183954
118	A	183956
118	A	183958
118	A	183960
118	A	183962
118	A	183964
118	A	183966
118	A	183968
118	A	183970
118	A	183972
118	A	183974
118	A	183976
118	A	183978
118	B	186502
118	B	186504
118	B	186506
118	B	186508
118	B	186510
118	B	186512
118	B	186514
118	B	186516
118	B	186518
118	B	186520
118	B	186522
118	B	186524
118	B	186526
118	B	186528

119	ABC_119	ERROR ID 119. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G.; ASI COMO TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G. (FASE PASIVA) , (PC) EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS S.M.G.; ASI COMO POR TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE SUBYACENTES REFERIDO AL S.M.G. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISION DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE COMPRA DE	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G.; ASI COMO TENENCIA DE OPCIONES Y TITULOS OPCIONALES DE VENTA DE SUBYACENTES REFERIDOS AL S.M.G. (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
119	A	184052
119	A	184054
119	A	184056
119	A	184058
119	A	184060
119	A	184062
119	A	184064
119	A	184066
119	A	184068
119	A	184070
119	A	184072
119	A	184074
119	A	184076
119	A	184078
119	B	186552
119	B	186554
119	B	186556
119	B	186558
119	B	186560
119	B	186562
119	B	186564
119	B	186566
119	B	186568
119	B	186570
119	B	186572
119	B	186574
119	B	186576
119	B	186578

120	ABC_120	ERROR ID 120. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA)	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
120	A	184102
120	B	186602

121	ABC_121	ERROR ID 121. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON EMISIÓN DE OPCIONES DE COMPRA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
121	A	184252
121	B	186652

122	ABC_122	ERROR ID 122. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL TIPO “FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS NOMINAL TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>INTERES NOMINAL TIPO “FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA)
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC18</th></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183152</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183154</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183156</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183158</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183160</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183162</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183164</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183166</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183168</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183170</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183172</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183174</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183176</td></tr>
<tr><td>122</td><td>A</td><td>183178</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186702</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186704</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186706</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186708</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186710</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186712</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186714</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186716</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186718</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186720</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186722</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186724</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186726</td></tr>
<tr><td>122</td><td>B</td><td>186728</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>123</td><td>ABC_123</td><td>ERROR ID 123. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA)
Algoritmo:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
123	A	183202
123	A	183204
123	A	183206
123	A	183208
123	A	183210
123	A	183212
123	A	183214
123	A	183216
123	A	183218
123	A	183220
123	A	183222
123	A	183224
123	A	183226
123	A	183228
123	B	186752
123	B	186754
123	B	186756
123	B	186758
123	B	186760
123	B	186762
123	B	186764
123	B	186766
123	B	186768
123	B	186770
123	B	186772
123	B	186774
123	B	186776
123	B	186778

124	ABC_124	ERROR ID 124. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA), (PC) M.N. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.N. A ENTREGAR,	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL, DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
124	A	183302
124	A	183304
124	A	183306
124	A	183308
124	A	183310
124	A	183312
124	A	183314
124	A	183316
124	A	183318
124	A	183320
124	A	183322
124	A	183324
124	A	183326
124	A	183328
124	B	186802
124	B	186804
124	B	186806
124	B	186808
124	B	186810
124	B	186812
124	B	186814
124	B	186816
124	B	186818
124	B	186820
124	B	186822
124	B	186824
124	B	186826
124	B	186828

125	ABC_125	ERROR ID 125. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL TIPO “FLOOR" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA), (PC) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL TIPO “FLOOR" A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
125	A	183452
125	A	183454
125	A	183456
125	A	183458
125	A	183460
125	A	183462
125	A	183464
125	A	183466
125	A	183468
125	A	183470
125	A	183472
125	A	183474
125	A	183476
125	A	183478
125	B	186852
125	B	186854
125	B	186856
125	B	186858
125	B	186860
125	B	186862
125	B	186864
125	B	186866
125	B	186868
125	B	186870
125	B	186872
125	B	186874
125	B	186876
125	B	186878

126	ABC_126	ERROR ID 126. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL. , (PC) UDIS A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASA DE INTERES REAL.	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
126	A	183502
126	A	183504
126	A	183506
126	A	183508
126	A	183510
126	A	183512
126	A	183514
126	A	183516
126	A	183518
126	A	183520
126	A	183522
126	A	183524
126	A	183526
126	A	183528
126	B	186902
126	B	186904
126	B	186906
126	B	186908
126	B	186910
126	B	186912
126	B	186914
126	B	186916
126	B	186918
126	B	186920
126	B	186922
126	B	186924
126	B	186926
126	B	186928

127	ABC_127	ERROR ID 127. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA) , (PC) UDIS A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON UDIS A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES REAL DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA)

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
127	A	183602
127	A	183604
127	A	183606
127	A	183608
127	A	183610
127	A	183612
127	A	183614
127	A	183616
127	A	183618
127	A	183620
127	A	183622
127	A	183624
127	A	183626
127	A	183628
127	B	186952
127	B	186954
127	B	186956
127	B	186958
127	B	186960
127	B	186962
127	B	186964
127	B	186966
127	B	186968
127	B	186970
127	B	186972
127	B	186974
127	B	186976
127	B	186978

128	ABC_128	ERROR ID 128. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO “FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS EN M.E. TIPO “FLOOR” A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. TIPO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

"FLOOR", A LOS QUE SE REFIERE EL TERCER PARRAFO DEL DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
128	A	183802
128	A	183804
128	A	183806
128	A	183808
128	A	183810
128	A	183812
128	A	183814
128	A	183816
128	A	183818
128	A	183820
128	A	183822
128	A	183824
128	A	183826
128	A	183828
128	B	187002
128	B	187004
128	B	187006
128	B	187008
128	B	187010
128	B	187012
128	B	187014
128	B	187016
128	B	187018
128	B	187020
128	B	187022
128	B	187024
128	B	187026
128	B	187028

129	ABC_129	ERROR ID 129. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR POR EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE DIVISAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		|A-B|<=2 **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
129	A	183852
129	A	183854
129	A	183856
129	A	183858
129	A	183860
129	A	183862
129	A	183864
129	A	183866
129	A	183868
129	A	183870
129	A	183872
129	A	183874
129	A	183876
129	A	183878
129	B	187052
129	B	187054
129	B	187056
129	B	187058
129	B	187060
129	B	187062
129	B	187064
129	B	187066
129	B	187068
129	B	187070
129	B	187072
129	B	187074
129	B	187076
129	B	187078

130	ABC_130	ERROR ID 130. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA)	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
130	A	183902
130	A	183904
130	A	183906
130	A	183908
130	A	183910
130	A	183912
130	A	183914
130	A	183916
130	A	183918
130	A	183920
130	A	183922
130	A	183924
130	A	183926
130	A	183928
130	B	187102
130	B	187104
130	B	187106
130	B	187108
130	B	187110
130	B	187112
130	B	187114
130	B	187116
130	B	187118
130	B	187120
130	B	187122
130	B	187124
130	B	187126
130	B	187128

131	ABC_131	ERROR ID 131. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) M.E. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA), (PC) M.E. A RECIBIR, POR EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E. DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO “FLOOR" (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON M.E. A ENTREGAR, POR	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES EN M.E., DISTINTAS A LAS OPCIONES DE VENTA TIPO "FLOOR" (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
131	A	184002
131	A	184004
131	A	184006
131	A	184008
131	A	184010
131	A	184012
131	A	184014
131	A	184016
131	A	184018
131	A	184020
131	A	184022
131	A	184024
131	A	184026
131	A	184028
131	B	187152
131	B	187154
131	B	187156
131	B	187158
131	B	187160
131	B	187162
131	B	187164
131	B	187166
131	B	187168
131	B	187170
131	B	187172
131	B	187174
131	B	187176
131	B	187178

132	ABC_132	ERROR ID 132. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) , (PC) EMISIÓN DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES,	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC18** 132 / A / 184152 132 / B / 187202	
133	ABC_133	ERROR ID 133. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) EMISIÓN DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE MERCANCIAS, SOBRE O REFERIDOS A MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** *APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC18** 133 / A / 184302 133 / B / 187252	
134	ABC_134	ERROR ID 134. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, SOBRE	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE ACTIVA) COMPENSADAS CON TENENCIA DE OPCIONES SOBRE FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, SOBRE O REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES E INDICES REFERIDOS A ACCIONES (FASE PASIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC18 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC18
134	A	184202
134	B	187302

c) (AC) Activo Compensable, (PC) Pasivo Compensable

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
800	ABC_800	ERROR ID 800. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACION DE DINERO EN COMPRA-VENTA DE VALORES Y DIVISAS, ASI COMO REPORTOS DE TITULOS , (PC) COMPENSACION DE DINERO EN COMPRA-VENTA DE VALORES Y DIVISAS, ASI COMO REPORTOS DE TITULOS	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
800	A	16145	46145
800	A	16147	46146
800	B	18145	48145
800	B	18147	48146

801	ABC_801	ERROR ID 801. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADOR , (PC) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Algoritmo:

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
801	A	16150	46150
801	A	16152	46152
801	A	16154	46154
801	A	16156	46156
801	A	16158	46158
801	A	16160	46160
801	A	16162	46162
801	A	16164	46164
801	A	16166	46166
801	A	16168	46168
801	A	16170	46170
801	A	16172	46172
801	A	16174	46174
801	A	16176	46176
801	B	18150	48150
801	B	18152	48152
801	B	18154	48154
801	B	18156	48156
801	B	18158	48158
801	B	18160	48160
801	B	18162	48162
801	B	18164	48164
801	B	18166	48166
801	B	18168	48168
801	B	18170	48170
801	B	18172	48172
801	B	18174	48174
801	B	18176	48176

802	ABC_802	ERROR ID 802. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA A RECIBIR , (PC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA A ENTREGAR	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC02	RC11
802	A	16180	36180	46180	26000	116180
802	A	16182	36182	46182	26002	116182
802	A	16184	36184	46184	26004	116184
802	A	16186	36186	46186	26006	116186
802	A	16188	36188	46188	26008	116188
802	A	16190	36190	46190	26010	116190
802	A	16192	36192	46192	26012	116192
802	A	16194	36194	46194	26014	116194
802	A	16196	36196	46196	26016	116196
802	A	16198	36198	46198	26018	116198
802	A	16200	36200	46200	26020	116200
802	A	16202	36202	46202	26022	116202
802	A	16204	36204	46204	26024	116204
802	A	16206	36206	46206	26026	116206
802	B	18180	38180	48180	27000	118180
802	B	18182	38182	48182	27002	118182
802	B	18184	38184	48184	27004	118184
802	B	18186	38186	48186	27006	118186
802	B	18188	38188	48188	27008	118188
802	B	18190	38190	48190	27010	118190
802	B	18192	38192	48192	27012	118192
802	B	18194	38194	48194	27014	118194
802	B	18196	38196	48196	27016	118196
802	B	18198	38198	48198	27018	118198
802	B	18200	38200	48200	27020	118200
802	B	18202	38202	48202	27022	118202
802	B	18204	38204	48204	27024	118204
802	B	18206	38206	48206	27026	118206

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
803	ABC_803	ERROR ID 803. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES FIJA, FUTUROS Y FORWARDS DE BONOS A TASA FIJA, PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE TASAS DE INTERÉS	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
803	A	16210	36210	46210
803	A	16212	36212	46212
803	A	16214	36214	46214
803	A	16216	36216	46216
803	A	16218	36218	46218
803	A	16220	36220	46220
803	A	16222	36222	46222
803	A	16224	36224	46224
803	A	16226	36226	46226
803	A	16228	36228	46228
803	A	16230	36230	46230
803	A	16232	36232	46232
803	A	16234	36234	46234
803	A	16236	36236	46236
803	B	18420	38420	48450
803	B	18422	38422	48452
803	B	18424	38424	48454
803	B	18426	38426	48456
803	B	18428	38428	48458
803	B	18430	38430	48460
803	B	18432	38432	48462
803	B	18434	38434	48464
803	B	18436	38436	48466
803	B	18438	38438	48468
803	B	18440	38440	48470
803	B	18442	38442	48472
803	B	18444	38444	48474
803	B	18446	38446	48476

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
804	ABC_804	ERROR ID 804. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TITULOS A RECIBIR POR COMPRAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRESTAMOS, ASI COMO TENENCIA; COMPENSADOS CON "SWAPS" SOBRE TASA DE INTERES FIJA A ENTREGAR , (PC) SWAPS EN LOS QUE SE ENTREGUE UNA TASA DE INTERES NOMINAL FIJA (FASE PASIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA A TASA FIJA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
804	A	16810	36810	46870
804	A	16812	36812	46872
804	A	16814	36814	46874
804	A	16816	36816	46876
804	A	16818	36818	46878
804	A	16820	36820	46880
804	A	16822	36822	46882
804	A	16824	36824	46884
804	A	16826	36826	46886
804	A	16828	36828	46888
804	A	16830	36830	46890
804	A	16832	36832	46892
804	A	16834	36834	46894
804	A	16836	36836	46896
804	B	18510	38510	48540
804	B	18512	38512	48542
804	B	18514	38514	48544
804	B	18516	38516	48546
804	B	18518	38518	48548
804	B	18520	38520	48550
804	B	18522	38522	48552
804	B	18524	38524	48554
804	B	18526	38526	48556
804	B	18528	38528	48558
804	B	18530	38530	48560
804	B	18532	38532	48562
804	B	18534	38534	48564

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		804	B	18536	38536	48566	
805	ABC_805	ERROR ID 805. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TITULOS A RECIBIR [POR COMPRAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRESTAMOS, ASI COMO TENENCIA POR OTROS DERIVADOS SOBRE TÍTULOS]; COMPENSADOS CON TÍTULOS A ENTREGAR POR [OTROS DERIVADOS SOBRE TITULOS ASÍ COMO POR VENTAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRÉSTAMOS] , (PC) TITULOS A ENTREGAR POR VENTAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRESTAMOS ASI COMO POR OTROS DERIVADOS SOBRE TÍTULOS; COMPENSADOS CON [TÍTULOS A RECIBIR POR OTROS DERIVADOS SOBRE TITULOS ASÍ COMO POR VENTAS FECHAS VALOR,REPORTOS O PRÉSTAMOS, ASI COMO TENENCIA ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
805	A	16840	36840	46900
805	A	16842	36842	46902
805	A	16844	36844	46904
805	A	16846	36846	46906
805	A	16848	36848	46908
805	A	16850	36850	46910
805	A	16852	36852	46912
805	A	16854	36854	46914
805	A	16856	36856	46916
805	A	16858	36858	46918
805	A	16860	36860	46920
805	A	16862	36862	46922
805	A	16864	36864	46924
805	A	16866	36866	46926
805	B	18840	38840	48900
805	B	18842	38842	48902
805	B	18844	38844	48904
805	B	18846	38846	48906
805	B	18848	38848	48908
805	B	18850	38850	48910
805	B	18852	38852	48912
805	B	18854	38854	48914
805	B	18856	38856	48916
805	B	18858	38858	48918
805	B	18860	38860	48920

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		805	B	18862	38862	48922	
		805	B	18864	38864	48924	
		805	B	18866	38866	48926	
806	ABC_806	ERROR ID 806. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) “FORWARDS"Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA), DISTINTOS A LOS PAQUETES A QUE SE REFIERE EL SEGUNDO PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. , (PC) “FORWARDS"Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA), DISTINTOS A LOS PAQUETES A QUE SE REFIERE EL SEGUNDO PARRAFO DE LA FRACCION VII DEL ART. 2 BIS 100 DE LA CUB. ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
806	A	16240	36240	46240
806	A	16242	36242	46242
806	A	16244	36244	46244
806	A	16246	36246	46246
806	A	16248	36248	46248
806	A	16250	36250	46250
806	A	16252	36252	46252
806	A	16254	36254	46254
806	A	16256	36256	46256
806	A	16258	36258	46258
806	A	16260	36260	46260
806	A	16262	36262	46262
806	A	16264	36264	46264
806	A	16266	36266	46266
806	B	18270	38270	48270
806	B	18272	38272	48272
806	B	18274	38274	48274
806	B	18276	38276	48276
806	B	18278	38278	48278
806	B	18280	38280	48280
806	B	18282	38282	48282
806	B	18284	38284	48284
806	B	18286	38286	48286
806	B	18288	38288	48288
806	B	18290	38290	48290

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		806	B	18292	38292	48292	
		806	B	18294	38294	48294	
		806	B	18296	38296	48296	
807	ABC_807	ERROR ID 807. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES) , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES)					Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
807	A	16270	36270	46270
807	A	16272	36272	46272
807	A	16274	36274	46274
807	A	16276	36276	46276
807	A	16278	36278	46278
807	A	16280	36280	46280
807	A	16282	36282	46282
807	A	16284	36284	46284
807	A	16286	36286	46286
807	A	16288	36288	46288
807	A	16290	36290	46290
807	A	16292	36292	46292
807	A	16294	36294	46294
807	A	16296	36296	46296
807	B	18240	38240	48240
807	B	18242	38242	48242
807	B	18244	38244	48244
807	B	18246	38246	48246
807	B	18248	38248	48248
807	B	18250	38250	48250
807	B	18252	38252	48252
807	B	18254	38254	48254
807	B	18256	38256	48256
807	B	18258	38258	48258
807	B	18260	38260	48260
807	B	18262	38262	48262

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		807	B	18264	38264	48264
		807	B	18266	38266	48266
808	ABC_808	ERROR ID 808. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE DIVISAS				Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
808	A	16300	46330
808	A	16302	46332
808	A	16304	46334
808	A	16306	46336
808	A	16308	46338
808	A	16310	46340
808	A	16312	46342
808	A	16314	46344
808	A	16316	46346
808	A	16318	46348
808	A	16320	46350
808	A	16322	46352
808	A	16324	46354
808	A	16326	46356
808	B	18300	48300
808	B	18302	48302
808	B	18304	48304
808	B	18306	48306
808	B	18308	48308
808	B	18310	48310
808	B	18312	48312
808	B	18314	48314
808	B	18316	48316
808	B	18318	48318

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	808	B	18320	48320	
	808	B	18322	48322	
	808	B	18324	48324	
	808	B	18326	48326	

809 ABC_809 ERROR ID 809. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
809	A	16041	36330	47326	116240
809	A	16042	36332	47327	116242
809	A	16043	36334	47328	116244
809	A	16044	36336	47329	116246
809	A	16045	36338	47330	116248
809	A	16046	36340	47331	116250
809	A	16047	36342	47332	116252
809	A	16048	36344	47333	116254
809	A	16049	36346	47334	116256
809	A	16050	36348	47335	116258
809	A	16051	36350	47336	116260
809	A	16052	36352	47337	116262
809	A	16053	36354	47338	116264
809	A	16054	36356	47339	116266
809	B	18052	38360	49341	118270
809	B	18053	38362	49342	118272
809	B	18054	38364	49343	118274
809	B	18055	38366	49344	118276
809	B	18056	38368	49345	118278
809	B	18057	38370	49346	118280
809	B	18058	38372	49347	118282
809	B	18059	38374	49348	118284
809	B	18060	38376	49349	118286

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

809	B	18061	38378	49350	118288	
809	B	18062	38380	49351	118290	
809	B	18063	38382	49352	118292	
809	B	18064	38384	49353	118294	
809	B	18065	38386	49354	118296	

810 ABC_810

ERROR ID 810. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
810	A	16056	36360	47341	116270
810	A	16057	36362	47342	116272
810	A	16058	36364	47343	116274
810	A	16059	36366	47344	116276
810	A	16060	36368	47345	116278
810	A	16061	36370	47346	116280
810	A	16062	36372	47347	116282
810	A	16063	36374	47348	116284
810	A	16064	36376	47349	116286
810	A	16065	36378	47350	116288
810	A	16066	36380	47351	116290
810	A	16067	36382	47352	116292
810	A	16068	36384	47353	116294
810	A	16069	36386	47354	116296
810	B	18037	38330	49326	118240
810	B	18038	38332	49327	118242
810	B	18039	38334	49328	118244
810	B	18040	38336	49329	118246
810	B	18041	38338	49330	118248
810	B	18042	38340	49331	118250
810	B	18043	38342	49332	118252
810	B	18044	38344	49333	118254
810	B	18045	38346	49334	118256

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

810	B	18046	38348	49335	118258	
810	B	18047	38350	49336	118260	
810	B	18048	38352	49337	118262	
810	B	18049	38354	49338	118264	
810	B	18050	38356	49339	118266	

811 ABC_811

ERROR ID 811. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) PAQUETES DE "FORWARDS"Y DE FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA); QUE SE HAYAN COMPENSADO CON OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA A TASA FIJA , (PC) TITULOS A ENTREGAR POR VENTAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRESTAMOS; COMPENSADOS CON PAQUETES DE "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA.

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
811	A	16390	36390	46420
811	A	16392	36392	46422
811	A	16394	36394	46424
811	A	16396	36396	46426
811	A	16398	36398	46428
811	A	16400	36400	46430
811	A	16402	36402	46432
811	A	16404	36404	46434
811	A	16406	36406	46436
811	A	16408	36408	46438
811	A	16410	36410	46440
811	A	16412	36412	46442
811	A	16414	36414	46444
811	A	16416	36416	46446
811	B	18210	38210	48210
811	B	18212	38212	48212
811	B	18214	38214	48214
811	B	18216	38216	48216
811	B	18218	38218	48218
811	B	18220	38220	48220
811	B	18222	38222	48222

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		811	B	18224	38224	48224
		811	B	18226	38226	48226
		811	B	18228	38228	48228
		811	B	18230	38230	48230
		811	B	18232	38232	48232
		811	B	18234	38234	48234
		811	B	18236	38236	48236
812	ABC_812	ERROR ID 812. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (FASE ACTIVA); COMPENSADOS CON PAQUETES DE "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (FASE PASIVA), (PC) PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (FASE PASIVA); COMPENSADOS CON PAQUETES DE "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES. ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
812	A	16420	36420	46450
812	A	16422	36422	46452
812	A	16424	36424	46454
812	A	16426	36426	46456
812	A	16428	36428	46458
812	A	16430	36430	46460
812	A	16432	36432	46462
812	A	16434	36434	46464
812	A	16436	36436	46466
812	A	16438	36438	46468
812	A	16440	36440	46470
812	A	16442	36442	46472
812	A	16444	36444	46474
812	A	16446	36446	46476
812	B	18450	38450	48480
812	B	18452	38452	48482
812	B	18454	38454	48484
812	B	18456	38456	48486
812	B	18458	38458	48488

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		812	B	18460	38460	48490	
		812	B	18462	38462	48492	
		812	B	18464	38464	48494	
		812	B	18466	38466	48496	
		812	B	18468	38468	48498	
		812	B	18470	38470	48500	
		812	B	18472	38472	48502	
		812	B	18474	38474	48504	
		812	B	18476	38476	48506	
813	ABC_813	ERROR ID 813. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (FASE ACTIVA); COMPENSADOS CON "SWAPS", EN LOS QUE SE ENTREGUE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE PASIVA) , (PC) SWAPS EN LOS QUE SE ENTREGUE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE PASIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE COMPRA DE TASA DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
813	A	16960	36870	46930
813	A	16962	36872	46932
813	A	16964	36874	46934
813	A	16966	36876	46936
813	A	16968	36878	46938
813	A	16970	36880	46940
813	A	16972	36882	46942
813	A	16974	36884	46944
813	A	16976	36886	46946
813	A	16978	36888	46948
813	A	16980	36890	46950
813	A	16982	36892	46952
813	A	16984	36894	46954
813	A	16986	36896	46956
813	B	18990	38900	48960
813	B	18992	38902	48962
813	B	18994	38904	48964
813	B	18996	38906	48966
813	B	18998	38908	48968

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		813	B	19000	38910	48970
		813	B	19002	38912	48972
		813	B	19004	38914	48974
		813	B	19006	38916	48976
		813	B	19008	38918	48978
		813	B	19010	38920	48980
		813	B	19012	38922	48982
		813	B	19014	38924	48984
		813	B	19016	38926	48986
814	ABC_814	ERROR ID 814. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
814	A	16450	36450	46480
814	A	16452	36452	46482
814	A	16454	36454	46484
814	A	16456	36456	46486
814	A	16458	36458	46488
814	A	16460	36460	46490
814	A	16462	36462	46492
814	A	16464	36464	46494
814	A	16466	36466	46496
814	A	16468	36468	46498
814	A	16470	36470	46500
814	A	16472	36472	46502
814	A	16474	36474	46504
814	A	16476	36476	46506
814	B	18390	38390	48420
814	B	18392	38392	48422
814	B	18394	38394	48424
814	B	18396	38396	48426
814	B	18398	38398	48428

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

814	B	18400	38400	48430	
814	B	18402	38402	48432	
814	B	18404	38404	48434	
814	B	18406	38406	48436	
814	B	18408	38408	48438	
814	B	18410	38410	48440	
814	B	18412	38412	48442	
814	B	18414	38414	48444	
814	B	18416	38416	48446	

815 ABC_815 ERROR ID 815. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE OTROS SUBYACENTES — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
815	A	16101	36480	47386	116510
815	A	16102	36482	47387	116512
815	A	16103	36484	47388	116514
815	A	16104	36486	47389	116516
815	A	16105	36488	47390	116518
815	A	16106	36490	47391	116520
815	A	16107	36492	47392	116522
815	A	16108	36494	47393	116524
815	A	16109	36496	47394	116526
815	A	16110	36498	47395	116528
815	A	16111	36500	47396	116530
815	A	16112	36502	47397	116532
815	A	16113	36504	47398	116534
815	A	16114	36506	47399	116536
815	B	18097	38480	49386	118510
815	B	18098	38482	49387	118512
815	B	18099	38484	49388	118514
815	B	18100	38486	49389	118516

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

815	B	18101	38488	49390	118518	
815	B	18102	38490	49391	118520	
815	B	18103	38492	49392	118522	
815	B	18104	38494	49393	118524	
815	B	18105	38496	49394	118526	
815	B	18106	38498	49395	118528	
815	B	18107	38500	49396	118530	
815	B	18108	38502	49397	118532	
815	B	18109	38504	49398	118534	
815	B	18110	38506	49399	118536	

816 ABC_816 ERROR ID 816. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) SWAPS EN LOS QUE SE RECIBE UNA TASA DE INTERES NOMINAL FIJA (FASE ACTIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA A TASA FIJA , (PC) TITULOS A ENTREGAR POR VENTAS FECHA VALOR, REPORTOS O PRESTAMOS; COMPENSADOS CON "SWAPS" SOBRE TASA DE INTERES, Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
816	A	16510	36510	46540
816	A	16512	36512	46542
816	A	16514	36514	46544
816	A	16516	36516	46546
816	A	16518	36518	46548
816	A	16520	36520	46550
816	A	16522	36522	46552
816	A	16524	36524	46554
816	A	16526	36526	46556
816	A	16528	36528	46558
816	A	16530	36530	46560
816	A	16532	36532	46562
816	A	16534	36534	46564
816	A	16536	36536	46566
816	B	18810	38810	48870

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		816	B	18812	38812	48872
		816	B	18814	38814	48874
		816	B	18816	38816	48876
		816	B	18818	38818	48878
		816	B	18820	38820	48880
		816	B	18822	38822	48882
		816	B	18824	38824	48884
		816	B	18826	38826	48886
		816	B	18828	38828	48888
		816	B	18830	38830	48890
		816	B	18832	38832	48892
		816	B	18834	38834	48894
		816	B	18836	38836	48896

817 ABC_817

ERROR ID 817. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) SWAPS EN LOS QUE SE RECIBE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE ACTIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON "SWAPS" EN LOS QUE SE ENTREGUE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE PASIVA), (PC) SWAPS EN LOS QUE SE ENTREGUE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE PASIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON "SWAPS" EN LOS QUE SE RECIBE UNA TASA DE INTERES FIJA.

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
817	A	16540	36540	46570
817	A	16542	36542	46572
817	A	16544	36544	46574
817	A	16546	36546	46576
817	A	16548	36548	46578
817	A	16550	36550	46580
817	A	16552	36552	46582
817	A	16554	36554	46584
817	A	16556	36556	46586
817	A	16558	36558	46588
817	A	16560	36560	46590
817	A	16562	36562	46592
817	A	16564	36564	46594

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="5">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>A</td><td>16566</td><td>36566</td><td>46596</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18540</td><td>38540</td><td>48570</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18542</td><td>38542</td><td>48572</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18544</td><td>38544</td><td>48574</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18546</td><td>38546</td><td>48576</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18548</td><td>38548</td><td>48578</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18550</td><td>38550</td><td>48580</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18552</td><td>38552</td><td>48582</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18554</td><td>38554</td><td>48584</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18556</td><td>38556</td><td>48586</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18558</td><td>38558</td><td>48588</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18560</td><td>38560</td><td>48590</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18562</td><td>38562</td><td>48592</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18564</td><td>38564</td><td>48594</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>817</td><td>B</td><td>18566</td><td>38566</td><td>48596</td><td></td></tr>
<tr><td>818</td><td>ABC_818</td><td colspan="5">ERROR ID 818. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) SWAPS EN LOS QUE SE RECIBE UNA TASA DE INTERES FIJA (FASE ACTIVA), QUE SE HAYAN COMPENSADO CON PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (FASE PASIVA) , (PC) PAQUETES DE "FORWARDS" Y DE FUTUROS DE VENTA DE TASA DE INTERES (FASE PASIVA); COMPENSADOS CON "SWAPS", EN LOS QUE SE RECIBE UNA TASA DE INTERES FIJA
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
818	A	16990	36900	46960
818	A	16992	36902	46962
818	A	16994	36904	46964
818	A	16996	36906	46966
818	A	16998	36908	46968
818	A	17000	36910	46970
818	A	17002	36912	46972
818	A	17004	36914	46974
818	A	17006	36916	46976
818	A	17008	36918	46978
818	A	17010	36920	46980
818	A	17012	36922	46982
818	A	17014	36924	46984

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		818	A	17016	36926	46986
		818	B	18960	38870	48930
		818	B	18962	38872	48932
		818	B	18964	38874	48934
		818	B	18966	38876	48936
		818	B	18968	38878	48938
		818	B	18970	38880	48940
		818	B	18972	38882	48942
		818	B	18974	38884	48944
		818	B	18976	38886	48946
		818	B	18978	38888	48948
		818	B	18980	38890	48950
		818	B	18982	38892	48952
		818	B	18984	38894	48954
		818	B	18986	38896	48956
819	ABC_819	ERROR ID 819. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES VARIABLE , (PC) COMPENSACIONES DE SWAPS DE TASA DE INTERES VARIABLE ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
819	A	16570	36570	46600
819	A	16572	36572	46602
819	A	16574	36574	46604
819	A	16576	36576	46606
819	A	16578	36578	46608
819	A	16580	36580	46610
819	A	16582	36582	46612
819	A	16584	36584	46614
819	A	16586	36586	46616
819	A	16588	36588	46618
819	A	16590	36590	46620
819	A	16592	36592	46622
819	A	16594	36594	46624
819	A	16596	36596	46626

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		819	B	18570	38570	48600
		819	B	18572	38572	48602
		819	B	18574	38574	48604
		819	B	18576	38576	48606
		819	B	18578	38578	48608
		819	B	18580	38580	48610
		819	B	18582	38582	48612
		819	B	18584	38584	48614
		819	B	18586	38586	48616
		819	B	18588	38588	48618
		819	B	18590	38590	48620
		819	B	18592	38592	48622
		819	B	18594	38594	48624
		819	B	18596	38596	48626
820	ABC_820	ERROR ID 820. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
820	A	16600	36600	46630
820	A	16602	36602	46632
820	A	16604	36604	46634
820	A	16606	36606	46636
820	A	16608	36608	46638
820	A	16610	36610	46640
820	A	16612	36612	46642
820	A	16614	36614	46644
820	A	16616	36616	46646
820	A	16618	36618	46648
820	A	16620	36620	46650

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		820	A	16622	36622	46652
		820	A	16624	36624	46654
		820	A	16626	36626	46656
		820	B	19050	38960	49020
		820	B	19052	38962	49022
		820	B	19054	38964	49024
		820	B	19056	38966	49026
		820	B	19058	38968	49028
		820	B	19060	38970	49030
		820	B	19062	38972	49032
		820	B	19064	38974	49034
		820	B	19066	38976	49036
		820	B	19068	38978	49038
		820	B	19070	38980	49040
		820	B	19072	38982	49042
		820	B	19074	38984	49044
		820	B	19076	38986	49046
821	ABC_821	ERROR ID 821. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE TASAS DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
821	A	17020	36930	46990
821	A	17022	36932	46992
821	A	17024	36934	46994
821	A	17026	36936	46996
821	A	17028	36938	46998
821	A	17030	36940	47000
821	A	17032	36942	47002
821	A	17034	36944	47004
821	A	17036	36946	47006
821	A	17038	36948	47008
821	A	17040	36950	47010

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

821	A	17042	36952	47012	
821	A	17044	36954	47014	
821	A	17046	36956	47016	
821	B	18630	38630	48660	
821	B	18632	38632	48662	
821	B	18634	38634	48664	
821	B	18636	38636	48666	
821	B	18638	38638	48668	
821	B	18640	38640	48670	
821	B	18642	38642	48672	
821	B	18644	38644	48674	
821	B	18646	38646	48676	
821	B	18648	38648	48678	
821	B	18650	38650	48680	
821	B	18652	38652	48682	
821	B	18654	38654	48684	
821	B	18656	38656	48686	

822 ABC_822

ERROR ID 822. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) M.N. A RECIBIR POR VENTA DE ACCIONES, TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES, Y TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A INDICES ACCIONARIOS (FECHA VALOR PENDIENTES DE LIQUIDAR), (PC) M.N. A ENTREGAR POR COMPRA DE ACCIONES, TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A CANASTAS DE ACCIONES, Y TITULOS DE DEUDA REFERIDOS A INDICES ACCIONARIOS (FECHA VALOR PENDIENTES DE LIQUIDAR)

Grave

Algoritmo:

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
822	A	16006	47291
822	A	16007	47292
822	B	18002	49291
822	B	18003	49292

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>823</td><td>ABC_823</td><td>ERROR ID 823. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) M.N. A RECIBIR POR VENTA AL CONTADO DE MERCANCIAS, (PC) M.N. A ENTREGAR POR COMPRA AL CONTADO DE MERCANCIAS

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>823</td><td>A</td><td>16009</td><td>47294</td></tr>
<tr><td>823</td><td>B</td><td>18005</td><td>49294</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>824</td><td>ABC_824</td><td>ERROR ID 824. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE DIVISAS

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16660</td><td>46690</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16662</td><td>46692</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16664</td><td>46694</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16666</td><td>46696</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16668</td><td>46698</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16670</td><td>46700</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16672</td><td>46702</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16674</td><td>46704</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16676</td><td>46706</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16678</td><td>46708</td></tr>
<tr><td>824</td><td>A</td><td>16680</td><td>46710</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		824	A	16682	46712
		824	A	16684	46714
		824	A	16686	46716
		824	B	19080	49080
		824	B	19082	49082
		824	B	19084	49084
		824	B	19086	49086
		824	B	19088	49088
		824	B	19090	49090
		824	B	19092	49092
		824	B	19094	49094
		824	B	19096	49096
		824	B	19098	49098
		824	B	19100	49100
		824	B	19102	49102
		824	B	19104	49104
		824	B	19106	49106
825	ABC_825	ERROR ID 825. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
825	A	17080	47050
825	A	17082	47052
825	A	17084	47054
825	A	17086	47056
825	A	17088	47058
825	A	17090	47060
825	A	17092	47062
825	A	17094	47064
825	A	17096	47066

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		825	A	17098	47068	
		825	A	17100	47070	
		825	A	17102	47072	
		825	A	17104	47074	
		825	A	17106	47076	
		825	B	18660	48720	
		825	B	18662	48722	
		825	B	18664	48724	
		825	B	18666	48726	
		825	B	18668	48728	
		825	B	18670	48730	
		825	B	18672	48732	
		825	B	18674	48734	
		825	B	18676	48736	
		825	B	18678	48738	
		825	B	18680	48740	
		825	B	18682	48742	
		825	B	18684	48744	
		825	B	18686	48746	
826	ABC_826	ERROR ID 826. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) , (PC) FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
826	A	16011	47296
826	A	16012	47297
826	A	16013	47298
826	A	16014	47299
826	A	16015	47300
826	A	16016	47301
826	A	16017	47302

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		826	A	16018	47303	
		826	A	16019	47304	
		826	A	16020	47305	
		826	A	16021	47306	
		826	A	16022	47307	
		826	A	16023	47308	
		826	A	16024	47309	
		826	B	18007	49296	
		826	B	18008	49297	
		826	B	18009	49298	
		826	B	18010	49299	
		826	B	18011	49300	
		826	B	18012	49301	
		826	B	18013	49302	
		826	B	18014	49303	
		826	B	18015	49304	
		826	B	18016	49305	
		826	B	18017	49306	
		826	B	18018	49307	
		826	B	18019	49308	
		826	B	18020	49309	
827	ABC_827	ERROR ID 827. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
827	A	17516	36990	47491	116600
827	A	17517	36992	47492	116602
827	A	17518	36994	47493	116604
827	A	17519	36996	47494	116606
827	A	17520	36998	47495	116608
827	A	17521	37000	47496	116610
827	A	17522	37002	47497	116612
827	A	17523	37004	47498	116614

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

827	A	17524	37006	47499	116616	
827	A	17525	37008	47500	116618	
827	A	17526	37010	47501	116620	
827	A	17527	37012	47502	116622	
827	A	17528	37014	47503	116624	
827	A	17529	37016	47504	116626	
827	B	19366	38720	49446	118630	
827	B	19367	38722	49447	118632	
827	B	19368	38724	49448	118634	
827	B	19369	38726	49449	118636	
827	B	19370	38728	49450	118638	
827	B	19371	38730	49451	118640	
827	B	19372	38732	49452	118642	
827	B	19373	38734	49453	118644	
827	B	19374	38736	49454	118646	
827	B	19375	38738	49455	118648	
827	B	19376	38740	49456	118650	
827	B	19377	38742	49457	118652	
827	B	19378	38744	49458	118654	
827	B	19379	38746	49459	118656	

828 ABC_828

ERROR ID 828. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
828	A	16026	47311
828	A	16027	47312
828	A	16028	47313
828	A	16029	47314
828	A	16030	47315
828	A	16031	47316

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	828	A	16032	47317	
	828	A	16033	47318	
	828	A	16034	47319	
	828	A	16035	47320	
	828	A	16036	47321	
	828	A	16037	47322	
	828	A	16038	47323	
	828	A	16039	47324	
	828	B	18022	49311	
	828	B	18023	49312	
	828	B	18024	49313	
	828	B	18025	49314	
	828	B	18026	49315	
	828	B	18027	49316	
	828	B	18028	49317	
	828	B	18029	49318	
	828	B	18030	49319	
	828	B	18031	49320	
	828	B	18032	49321	
	828	B	18033	49322	
	828	B	18034	49323	
	828	B	18035	49324	
829	ABC_829	ERROR ID 829. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) SWAPS RELATIVOS A ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) , (PC) SWAPS RELATIVOS A ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
829	A	16071	47356
829	A	16072	47357
829	A	16073	47358
829	A	16074	47359
829	A	16075	47360
829	A	16076	47361
829	A	16077	47362
829	A	16078	47363

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		829	A	16079	47364	
		829	A	16080	47365	
		829	A	16081	47366	
		829	A	16082	47367	
		829	A	16083	47368	
		829	A	16084	47369	
		829	B	18067	49356	
		829	B	18068	49357	
		829	B	18069	49358	
		829	B	18070	49359	
		829	B	18071	49360	
		829	B	18072	49361	
		829	B	18073	49362	
		829	B	18074	49363	
		829	B	18075	49364	
		829	B	18076	49365	
		829	B	18077	49366	
		829	B	18078	49367	
		829	B	18079	49368	
		829	B	18080	49369	
830	ABC_830	ERROR ID 830. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL , (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*						Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
830	A	16750	36750	46810	116750
830	A	16752	36752	46812	116752
830	A	16754	36754	46814	116754
830	A	16756	36756	46816	116756
830	A	16758	36758	46818	116758
830	A	16760	36760	46820	116760
830	A	16762	36762	46822	116762

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		830	A	16764	36764	46824	116764
		830	A	16766	36766	46826	116766
		830	A	16768	36768	46828	116768
		830	A	16770	36770	46830	116770
		830	A	16772	36772	46832	116772
		830	A	16774	36774	46834	116774
		830	A	16776	36776	46836	116776
		830	B	18750	38750	48810	118750
		830	B	18752	38752	48812	118752
		830	B	18754	38754	48814	118754
		830	B	18756	38756	48816	118756
		830	B	18758	38758	48818	118758
		830	B	18760	38760	48820	118760
		830	B	18762	38762	48822	118762
		830	B	18764	38764	48824	118764
		830	B	18766	38766	48826	118766
		830	B	18768	38768	48828	118768
		830	B	18770	38770	48830	118770
		830	B	18772	38772	48832	118772
		830	B	18774	38774	48834	118774
		830	B	18776	38776	48836	118776
831	ABC_831	ERROR ID 831. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO , (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*						Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
831	A	16780	36780	46840	116780
831	A	16782	36782	46842	116782
831	A	16784	36784	46844	116784
831	A	16786	36786	46846	116786
831	A	16788	36788	46848	116788
831	A	16790	36790	46850	116790

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

831	A	16792	36792	46852	116792	
831	A	16794	36794	46854	116794	
831	A	16796	36796	46856	116796	
831	A	16798	36798	46858	116798	
831	A	16800	36800	46860	116800	
831	A	16802	36802	46862	116802	
831	A	16804	36804	46864	116804	
831	A	16806	36806	46866	116806	
831	B	18780	38780	48840	118780	
831	B	18782	38782	48842	118782	
831	B	18784	38784	48844	118784	
831	B	18786	38786	48846	118786	
831	B	18788	38788	48848	118788	
831	B	18790	38790	48850	118790	
831	B	18792	38792	48852	118792	
831	B	18794	38794	48854	118794	
831	B	18796	38796	48856	118796	
831	B	18798	38798	48858	118798	
831	B	18800	38800	48860	118800	
831	B	18802	38802	48862	118802	
831	B	18804	38804	48864	118804	
831	B	18806	38806	48866	118806	

832 ABC_832 ERROR ID 832. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) , (PC) SWAPS RELATIVOS A MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
832	A	16086	47371
832	A	16087	47372
832	A	16088	47373
832	A	16089	47374

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		832	A	16090	47375
		832	A	16091	47376
		832	A	16092	47377
		832	A	16093	47378
		832	A	16094	47379
		832	A	16095	47380
		832	A	16096	47381
		832	A	16097	47382
		832	A	16098	47383
		832	A	16099	47384
		832	B	18082	49371
		832	B	18083	49372
		832	B	18084	49373
		832	B	18085	49374
		832	B	18086	49375
		832	B	18087	49376
		832	B	18088	49377
		832	B	18089	49378
		832	B	18090	49379
		832	B	18091	49380
		832	B	18092	49381
		832	B	18093	49382
		832	B	18094	49383
		832	B	18095	49384
833	ABC_833	ERROR ID 833. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) M.N. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON M.N.A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA), (PC) M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA). COMPENSADA CON M.N. A RECIBIR POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
833	A	16116	47401
833	A	16117	47402

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
	833	A	16118	47403	
	833	A	16119	47404	
	833	A	16120	47405	
	833	A	16121	47406	
	833	A	16122	47407	
	833	A	16123	47408	
	833	A	16124	47409	
	833	A	16125	47410	
	833	A	16126	47411	
	833	A	16127	47412	
	833	A	16128	47413	
	833	A	16129	47414	
	833	B	19471	49461	
	833	B	19472	49462	
	833	B	19473	49463	
	833	B	19474	49464	
	833	B	19475	49465	
	833	B	19476	49466	
	833	B	19477	49467	
	833	B	19478	49468	
	833	B	19479	49469	
	833	B	19480	49470	
	833	B	19481	49471	
	833	B	19482	49472	
	833	B	19483	49473	
	833	B	19484	49474	
834	ABC_834	ERROR ID 834. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) M.N. A RECIBIR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON M.N.A ENTREGAR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) M.N. A ENTREGAR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA). COMPENSADA CON M.N. A RECIBIR POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
834	A	16131	47416
834	A	16132	47417
834	A	16133	47418
834	A	16134	47419
834	A	16135	47420
834	A	16136	47421
834	A	16137	47422
834	A	16138	47423
834	A	16139	47424
834	A	16140	47425
834	A	16141	47426
834	A	16142	47427
834	A	16143	47428
834	A	16144	47429
834	B	19486	49476
834	B	19487	49477
834	B	19488	49478
834	B	19489	49479
834	B	19490	49480
834	B	19491	49481
834	B	19492	49482
834	B	19493	49483
834	B	19494	49484
834	B	19495	49485
834	B	19496	49486
834	B	19497	49487
834	B	19498	49488
834	B	19499	49489

835	ABC_835	ERROR ID 835. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17396</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17397</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17398</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17399</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17400</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17401</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17402</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17403</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17404</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17405</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17406</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17407</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17408</td></tr>
<tr><td>835</td><td>A</td><td>17409</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19426</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19427</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19428</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19429</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19430</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19431</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19432</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19433</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19434</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19435</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19436</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19437</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19438</td></tr>
<tr><td>835</td><td>B</td><td>19439</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>836</td><td>ABC_836</td><td>ERROR ID 836. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE DIVISAS

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
836	A	46300
836	A	46302
836	A	46304
836	A	46306
836	A	46308
836	A	46310
836	A	46312
836	A	46314
836	A	46316
836	A	46318
836	A	46320
836	A	46322
836	A	46324
836	A	46326
836	B	48330
836	B	48332
836	B	48334
836	B	48336
836	B	48338
836	B	48340
836	B	48342
836	B	48344
836	B	48346
836	B	48348
836	B	48350
836	B	48352
836	B	48354
836	B	48356

837	ABC_837	ERROR ID 837. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA), ASI COMO OPERACIONES CON TÍTULO DE DEUDA, COMPENSADOS CON TITULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA), ASI COMO OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA; COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR OPERACIONES CON TÍTULOS DE DEUDA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓNES RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17456</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17457</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17458</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17459</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17460</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17461</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17462</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17463</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17464</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17465</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17466</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17467</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17468</td></tr>
<tr><td>837</td><td>A</td><td>17469</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19456</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19457</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19458</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19459</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19460</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19461</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19462</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19463</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19464</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19465</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19466</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19467</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19468</td></tr>
<tr><td>837</td><td>B</td><td>19469</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>838</td><td>ABC_838</td><td>ERROR ID 838. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA) COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA)
Algoritmo:

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17381</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17382</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17383</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17384</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17385</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17386</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17387</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17388</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17389</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17390</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17391</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17392</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17393</td></tr>
<tr><td>838</td><td>A</td><td>17394</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19411</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19412</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19413</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19414</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19415</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19416</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19417</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19418</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19419</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19420</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19421</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19422</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19423</td></tr>
<tr><td>838</td><td>B</td><td>19424</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>839</td><td>ABC_839</td><td>ERROR ID 839. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA) ASI COMO OPERACIONES CON TÍTULO DE DEUDA COMPENSADOS CON TITULOS A ENTREGAR POR OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA A TASA FIJA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS (FASE PASIVA) , (PC) TÍTULOS DE DEUDA A ENTREGAR POR FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS (FASE PASIVA) ASI COMO OPERACIONES CON TITULOS DE DEUDA TASA FIJA); COMPENSADOS CON TÍTULOS DE DEUDA A RECIBIR POR [OPERACIONES CON TÍTULOS DE DEUDA A TASA FIJA ASI COMO POR FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS (FASE ACTIVA)]
Algoritmo:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17441</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17442</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17443</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17444</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17445</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17446</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17447</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17448</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17449</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17450</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17451</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17452</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17453</td></tr>
<tr><td>839</td><td>A</td><td>17454</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19441</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19442</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19443</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19444</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19445</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19446</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19447</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19448</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19449</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19450</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19451</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19452</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19453</td></tr>
<tr><td>839</td><td>B</td><td>19454</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>840</td><td>ABC_840</td><td>ERROR ID 840. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE SOBRETASAS DE INTERES

Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
840	A	16630	36630	46660
840	A	16632	36632	46662
840	A	16634	36634	46664
840	A	16636	36636	46666
840	A	16638	36638	46668
840	A	16640	36640	46670
840	A	16642	36642	46672
840	A	16644	36644	46674
840	A	16646	36646	46676
840	A	16648	36648	46678
840	A	16650	36650	46680
840	A	16652	36652	46682
840	A	16654	36654	46684
840	A	16656	36656	46686
840	B	19020	38930	48990
840	B	19022	38932	48992
840	B	19024	38934	48994
840	B	19026	38936	48996
840	B	19028	38938	48998
840	B	19030	38940	49000
840	B	19032	38942	49002
840	B	19034	38944	49004
840	B	19036	38946	49006
840	B	19038	38948	49008
840	B	19040	38950	49010
840	B	19042	38952	49012
840	B	19044	38954	49014
840	B	19046	38956	49016

841	ABC_841	ERROR ID 841. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
841	A	17050	36960	47020
841	A	17052	36962	47022
841	A	17054	36964	47024
841	A	17056	36966	47026
841	A	17058	36968	47028
841	A	17060	36970	47030
841	A	17062	36972	47032
841	A	17064	36974	47034
841	A	17066	36976	47036
841	A	17068	36978	47038
841	A	17070	36980	47040
841	A	17072	36982	47042
841	A	17074	36984	47044
841	A	17076	36986	47046
841	B	18600	38600	48630
841	B	18602	38602	48632
841	B	18604	38604	48634
841	B	18606	38606	48636
841	B	18608	38608	48638
841	B	18610	38610	48640
841	B	18612	38612	48642
841	B	18614	38614	48644
841	B	18616	38616	48646
841	B	18618	38618	48648
841	B	18620	38620	48650
841	B	18622	38622	48652
841	B	18624	38624	48654
841	B	18626	38626	48656

842	ABC_842	ERROR ID 842. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
842	A	17170	37050	47170
842	A	17172	37052	47172
842	A	17174	37054	47174
842	A	17176	37056	47176
842	A	17178	37058	47178
842	A	17180	37060	47180
842	A	17182	37062	47182
842	A	17184	37064	47184
842	A	17186	37066	47186
842	A	17188	37068	47188
842	A	17190	37070	47190
842	A	17192	37072	47192
842	A	17194	37074	47194
842	A	17196	37076	47196
842	B	19200	39080	49200
842	B	19202	39082	49202
842	B	19204	39084	49204
842	B	19206	39086	49206
842	B	19208	39088	49208
842	B	19210	39090	49210
842	B	19212	39092	49212
842	B	19214	39094	49214
842	B	19216	39096	49216
842	B	19218	39098	49218
842	B	19220	39100	49220
842	B	19222	39102	49222
842	B	19224	39104	49224
842	B	19226	39106	49226

843	ABC_843	ERROR ID 843. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES ***Algoritmo*:**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
843	A	17200	37080	47200
843	A	17202	37082	47202
843	A	17204	37084	47204
843	A	17206	37086	47206
843	A	17208	37088	47208
843	A	17210	37090	47210
843	A	17212	37092	47212
843	A	17214	37094	47214
843	A	17216	37096	47216
843	A	17218	37098	47218
843	A	17220	37100	47220
843	A	17222	37102	47222
843	A	17224	37104	47224
843	A	17226	37106	47226
843	B	19170	39050	49170
843	B	19172	39052	49172
843	B	19174	39054	49174
843	B	19176	39056	49176
843	B	19178	39058	49178
843	B	19180	39060	49180
843	B	19182	39062	49182
843	B	19184	39064	49184
843	B	19186	39066	49186
843	B	19188	39068	49188
843	B	19190	39070	49190
843	B	19192	39072	49192
843	B	19194	39074	49194
843	B	19196	39076	49196

844	ABC_844	ERROR ID 844. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Algoritmo:

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
844	A	17230	37110	47230
844	A	17232	37112	47232
844	A	17234	37114	47234
844	A	17236	37116	47236
844	A	17238	37118	47238
844	A	17240	37120	47240
844	A	17242	37122	47242
844	A	17244	37124	47244
844	A	17246	37126	47246
844	A	17248	37128	47248
844	A	17250	37130	47250
844	A	17252	37132	47252
844	A	17254	37134	47254
844	A	17256	37136	47256
844	B	19260	39140	49260
844	B	19262	39142	49262
844	B	19264	39144	49264
844	B	19266	39146	49266
844	B	19268	39148	49268
844	B	19270	39150	49270
844	B	19272	39152	49272
844	B	19274	39154	49274
844	B	19276	39156	49276
844	B	19278	39158	49278
844	B	19280	39160	49280
844	B	19282	39162	49282
844	B	19284	39164	49284
844	B	19286	39166	49286

845	ABC_845	ERROR ID 845. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL, COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES , AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR , (PC) EMISION DE	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL,COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES DE VENTA DE TASA DE INTERES NOMINAL. AMBOS DISTINTOS A LAS OPCIONES TIPO "FLOOR"
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC03</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17260</td><td>37140</td><td>47260</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17262</td><td>37142</td><td>47262</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17264</td><td>37144</td><td>47264</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17266</td><td>37146</td><td>47266</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17268</td><td>37148</td><td>47268</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17270</td><td>37150</td><td>47270</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17272</td><td>37152</td><td>47272</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17274</td><td>37154</td><td>47274</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17276</td><td>37156</td><td>47276</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17278</td><td>37158</td><td>47278</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17280</td><td>37160</td><td>47280</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17282</td><td>37162</td><td>47282</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17284</td><td>37164</td><td>47284</td></tr>
<tr><td>845</td><td>A</td><td>17286</td><td>37166</td><td>47286</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19230</td><td>39110</td><td>49230</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19232</td><td>39112</td><td>49232</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19234</td><td>39114</td><td>49234</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19236</td><td>39116</td><td>49236</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19238</td><td>39118</td><td>49238</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19240</td><td>39120</td><td>49240</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19242</td><td>39122</td><td>49242</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19244</td><td>39124</td><td>49244</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19246</td><td>39126</td><td>49246</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19248</td><td>39128</td><td>49248</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19250</td><td>39130</td><td>49250</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19252</td><td>39132</td><td>49252</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19254</td><td>39134</td><td>49254</td></tr>
<tr><td>845</td><td>B</td><td>19256</td><td>39136</td><td>49256</td></tr>
</table>
</td></tr>
<tr><td>846</td><td>ABC_846</td><td>ERROR ID 846. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
846	A	17351	36690	47431
846	A	17352	36692	47432
846	A	17353	36694	47433
846	A	17354	36696	47434
846	A	17355	36698	47435
846	A	17356	36700	47436
846	A	17357	36702	47437
846	A	17358	36704	47438
846	A	17359	36706	47439
846	A	17360	36708	47440
846	A	17361	36710	47441
846	A	17362	36712	47442
846	A	17363	36714	47443
846	A	17364	36716	47444
846	B	19516	39020	49506
846	B	19517	39022	49507
846	B	19518	39024	49508
846	B	19519	39026	49509
846	B	19520	39028	49510
846	B	19521	39030	49511
846	B	19522	39032	49512
846	B	19523	39034	49513
846	B	19524	39036	49514
846	B	19525	39038	49515
846	B	19526	39040	49516
846	B	19527	39042	49517
846	B	19528	39044	49518
846	B	19529	39046	49519

847	ABC_847	ERROR ID 847. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA) , (PC) TENENCIA DE	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON EMISIÓN DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA)
Algoritmo:
|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS
Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC03</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17366</td><td>36720</td><td>47446</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17367</td><td>36722</td><td>47447</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17368</td><td>36724</td><td>47448</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17369</td><td>36726</td><td>47449</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17370</td><td>36728</td><td>47450</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17371</td><td>36730</td><td>47451</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17372</td><td>36732</td><td>47452</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17373</td><td>36734</td><td>47453</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17374</td><td>36736</td><td>47454</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17375</td><td>36738</td><td>47455</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17376</td><td>36740</td><td>47456</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17377</td><td>36742</td><td>47457</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17378</td><td>36744</td><td>47458</td></tr>
<tr><td>847</td><td>A</td><td>17379</td><td>36746</td><td>47459</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19501</td><td>38990</td><td>49491</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19502</td><td>38992</td><td>49492</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19503</td><td>38994</td><td>49493</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19504</td><td>38996</td><td>49494</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19505</td><td>38998</td><td>49495</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19506</td><td>39000</td><td>49496</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19507</td><td>39002</td><td>49497</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19508</td><td>39004</td><td>49498</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19509</td><td>39006</td><td>49499</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19510</td><td>39008</td><td>49500</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19511</td><td>39010</td><td>49501</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19512</td><td>39012</td><td>49502</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19513</td><td>39014</td><td>49503</td></tr>
<tr><td>847</td><td>B</td><td>19514</td><td>39016</td><td>49504</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>848</td><td>ABC_848</td><td>ERROR ID 848. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) M.N. A RECIBIR, POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA) COMPENSADA CON M.N A ENTREGAR POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

SUBYACENTES (FASE PASIVA) , (PC) M.N. A ENTREGAR, POR EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON M.N. A RECIBIR POR TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (FASE ACTIVA)

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2

Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01, RC03, RC04 Y RC11 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
848	A	17531	37020	47506	116630
848	A	17532	37022	47507	116632
848	A	17533	37024	47508	116634
848	A	17534	37026	47509	116636
848	A	17535	37028	47510	116638
848	A	17536	37030	47511	116640
848	A	17537	37032	47512	116642
848	A	17538	37034	47513	116644
848	A	17539	37036	47514	116646
848	A	17540	37038	47515	116648
848	A	17541	37040	47516	116650
848	A	17542	37042	47517	116652
848	A	17543	37044	47518	116654
848	A	17544	37046	47519	116656
848	B	19351	38690	49431	118600
848	B	19352	38692	49432	118602
848	B	19353	38694	49433	118604
848	B	19354	38696	49434	118606
848	B	19355	38698	49435	118608
848	B	19356	38700	49436	118610
848	B	19357	38702	49437	118612
848	B	19358	38704	49438	118614
848	B	19359	38706	49439	118616
848	B	19360	38708	49440	118618
848	B	19361	38710	49441	118620
848	B	19362	38712	49442	118622
848	B	19363	38714	49443	118624
848	B	19364	38716	49444	118626

849	ABC_849	ERROR ID 849. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES TENENCIA DE	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

VENTA SOBRE DE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE DIVISAS

***Algoritmo*:**

|A-B|<=2
Con tolerancia de 2

APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
849	A	46720
849	A	46722
849	A	46724
849	A	46726
849	A	46728
849	A	46730
849	A	46732
849	A	46734
849	A	46736
849	A	46738
849	A	46740
849	A	46742
849	A	46744
849	A	46746
849	B	49050
849	B	49052
849	B	49054
849	B	49056
849	B	49058
849	B	49060
849	B	49062
849	B	49064
849	B	49066
849	B	49068
849	B	49070
849	B	49072
849	B	49074
849	B	49076

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
850	ABC_850	ERROR ID 850. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE COMPRA SOBRE DIVISAS , (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA DE COMPRA SOBRE DIVISAS ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04
850	A	47080
850	A	47082
850	A	47084
850	A	47086
850	A	47088
850	A	47090
850	A	47092
850	A	47094
850	A	47096
850	A	47098
850	A	47100
850	A	47102
850	A	47104
850	A	47106
850	B	48690
850	B	48692
850	B	48694
850	B	48696
850	B	48698
850	B	48700
850	B	48702
850	B	48704
850	B	48706
850	B	48708
850	B	48710
850	B	48712
850	B	48714
850	B	48716

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
851	ABC_851	ERROR ID 851. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA), COMPENSADOS CON FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) , (PC) FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA (FASE PASIVA) COMPENSADOS CON FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
851	A	17411
851	A	17412
851	A	17413
851	A	17414
851	A	17415
851	A	17416
851	A	17417
851	A	17418
851	A	17419
851	A	17420
851	A	17421
851	A	17422
851	A	17423
851	A	17424
851	B	19381
851	B	19382
851	B	19383
851	B	19384
851	B	19385
851	B	19386
851	B	19387
851	B	19388
851	B	19389
851	B	19390
851	B	19391
851	B	19392

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*		Nivel
		851	B	19393
		851	B	19394
852	ABC_852	ERROR ID 852. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA), COMPENSADOS CON FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA) , (PC) FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TITULOS DE DEUDA, EXCEPTO BONOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
852	A	17426
852	A	17427
852	A	17428
852	A	17429
852	A	17430
852	A	17431
852	A	17432
852	A	17433
852	A	17434
852	A	17435
852	A	17436
852	A	17437
852	A	17438
852	A	17439
852	B	19396
852	B	19397
852	B	19398
852	B	19399
852	B	19400
852	B	19401
852	B	19402
852	B	19403
852	B	19404
852	B	19405
852	B	19406

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		852	B	19407	
		852	B	19408	
		852	B	19409	
853	ABC_853	ERROR ID 853. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS ACCIONARIAS, E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA) , (PC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE ACCIONES, CANASTAS DE ACCIONES E INDICES ACCIONARIOS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
853	A	17471	47461
853	A	17472	47462
853	A	17473	47463
853	A	17474	47464
853	A	17475	47465
853	A	17476	47466
853	A	17477	47467
853	A	17478	47468
853	A	17479	47469
853	A	17480	47470
853	A	17481	47471
853	A	17482	47472
853	A	17483	47473
853	A	17484	47474
853	B	18112	49401
853	B	18113	49402
853	B	18114	49403
853	B	18115	49404
853	B	18116	49405
853	B	18117	49406
853	B	18118	49407
853	B	18119	49408
853	B	18120	49409
853	B	18121	49410

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		853	B	18122	49411
		853	B	18123	49412
		853	B	18124	49413
		853	B	18125	49414
854	ABC_854	ERROR ID 854. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA) , (PC) EMISION DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE PASIVA), COMPENSADOS CON TENENCIA DE OPCIONES Y WARRANTS DE VENTA DE MERCANCIAS, CANASTAS DE MERCANCIAS E INDICES REFERIDOS A MERCANCIAS (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
854	A	17501	47476
854	A	17502	47477
854	A	17503	47478
854	A	17504	47479
854	A	17505	47480
854	A	17506	47481
854	A	17507	47482
854	A	17508	47483
854	A	17509	47484
854	A	17510	47485
854	A	17511	47486
854	A	17512	47487
854	A	17513	47488
854	A	17514	47489
854	B	18127	49416
854	B	18128	49417
854	B	18129	49418
854	B	18130	49419
854	B	18131	49420
854	B	18132	49421
854	B	18133	49422
854	B	18134	49423
854	B	18135	49424

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		854	B	18136	49425	
		854	B	18137	49426	
		854	B	18138	49427	
		854	B	18139	49428	
		854	B	18140	49429	
855	ABC_855	ERROR ID 855. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE VENTA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA) , (PC) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
855	A	17290
855	A	17292
855	A	17294
855	A	17296
855	A	17298
855	A	17300
855	A	17302
855	A	17304
855	A	17306
855	A	17308
855	A	17310
855	A	17312
855	A	17314
855	A	17316
855	B	19320
855	B	19322
855	B	19324
855	B	19326
855	B	19328
855	B	19330
855	B	19332
855	B	19334
855	B	19336

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		855	B	19338	
		855	B	19340	
		855	B	19342	
		855	B	19344	
		855	B	19346	
856	ABC_856	ERROR ID 856. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA) , (PC) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE PASIVA), COMPENSADA CON FUTUROS DE VENTA DE SWAPS, RELATIVOS A UNA TASA DE INTERES NOMINAL (FASE ACTIVA) ***Algoritmo*:** **|A-B|<=2** **Con tolerancia de 2** *APLICA A LA SECCIÓN RC01 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS* *Dónde:*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
856	A	17320
856	A	17322
856	A	17324
856	A	17326
856	A	17328
856	A	17330
856	A	17332
856	A	17334
856	A	17336
856	A	17338
856	A	17340
856	A	17342
856	A	17344
856	A	17346
856	B	19290
856	B	19292
856	B	19294
856	B	19296
856	B	19298
856	B	19300
856	B	19302
856	B	19304
856	B	19306

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*		Nivel
	856	B	19308	
	856	B	19310	
	856	B	19312	
	856	B	19314	
	856	B	19316	

Contenido

iii. Validaciones por sección en riesgo de crédito

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC05 RELATIVO A OPERACIONES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
597	ABC_597	ERROR IDVALIDACION 597 RC05: VALIDA LA SUMA DE LOS MONTOS QUE SE COMPENSAN AL DETERMINAR LA POSICIÓN NETA ***Algoritmo*:** **|A-B|=0** *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3329	A	55105
3329	A	55106
3329	A	55107
3329	A	55108
3329	A	55109
3329	B	55104

598	ABC_598	ERROR IDVALIDACION 598 RC05: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN TOTAL LARGA ***Algoritmo:*** **|A-B|=0** *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><td>3330</td><td>A</td><td>55112</td></tr>
<tr><td>3330</td><td>A</td><td>55113</td></tr>
<tr><td>3330</td><td>A</td><td>55114</td></tr>
<tr><td>3330</td><td>A</td><td>55115</td></tr>
<tr><td>3330</td><td>A</td><td>55116</td></tr>
<tr><td>3330</td><td>B</td><td>55111</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>599</td><td>ABC_599</td><td>ERROR IDVALIDACION 599 RC05: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN TOTAL CORTA

Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3331</td><td>A</td><td>55118</td></tr>
<tr><td>3331</td><td>A</td><td>55119</td></tr>
<tr><td>3331</td><td>A</td><td>55120</td></tr>
<tr><td>3331</td><td>A</td><td>55121</td></tr>
<tr><td>3331</td><td>A</td><td>55122</td></tr>
<tr><td>3331</td><td>B</td><td>55117</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>600</td><td>ABC_600</td><td>ERROR IDVALIDACION 600 RC05: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN NETA DEL PORTAFOLIO

Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3332</td><td>A</td><td>55124</td></tr>
<tr><td>3332</td><td>A</td><td>55125</td></tr>
<tr><td>3332</td><td>A</td><td>55126</td></tr>
<tr><td>3332</td><td>A</td><td>55127</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3332	A	55128
3332	B	55123

655

Error Id Valiación 655 RC05 El importe total a compensar no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones y certificados bursátiles.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0
Tolerancia +-0.5

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

Dónde:

ABC_655

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
655	A	55002
655	A	55003
655	A	55004
655	A	55005
655	A	55006
655	A	55007
655	A	55008
655	A	55009
655	A	55010
655	A	55011
655	A	55012
655	A	55013
655	B	55105
655	B	55112

656

Error Id Valiación 656 RC05 El importe total de la posicón total larga no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones y certificados bursátiles.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

ABC_656

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

656	A	55015
656	A	55016
656	A	55017
656	A	55018
656	A	55019
656	A	55020
656	A	55021
656	A	55022
656	A	55023
656	A	55024
656	A	55025
656	A	55026
656	B	55106
656	B	55113

ABC_657

Error Id Valiación 657 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones sobre referidos a índices accionarios (posición larga).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
657	A	55028
657	A	55029
657	A	55030
657	A	55031
657	A	55032
657	A	55033
657	A	55034
657	A	55035
657	A	55036
657	A	55037
657	A	55038
657	A	55039
657	B	55107
657	B	55114

ABC_658

Error Id Valiación 658 RC05 El importe total de certificados bursátiles que otorguen créditos o inviertan en financiamientos no corresponde a la suma de los montos de cada uno de los certificados bursátiles que integran el rubro(posición larga).

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
658	A	55042
658	A	55043
658	A	55044
658	A	55045
658	B	55041

ABC_659

Error Id Valiación 659 RC05 El importe total de certificados bursátiles que no otorguen créditos o inviertan en financiamientos no corresponde a la suma de los montos de cada uno de los certificados bursátiles que integran el rubro (posición larga).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
659	A	55047
659	A	55048
659	A	55049
659	A	55050
659	B	55046

ABC_660

Error Id Valiación 660 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de certificados bursátiles que otorguen créditos o inviertan en financiamientos (posición larga).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
660	A	55042
660	A	55043
660	A	55044
660	A	55045

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

660	B	55108
660	B	55115

ABC_661

Error Id Valiación 661 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de certificados bursátiles que no otorguen créditos o inviertan en financiamientos (posición larga).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
661	A	55047
661	A	55048
661	A	55049
661	A	55050
661	B	55109
661	B	55116

ABC_662

Error Id Valiación 662 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones con acciones o sobre acciones (posición corta).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
662	A	55054
662	A	55055
662	A	55056
662	A	55057
662	A	55058
662	A	55059
662	A	55060
662	A	55061
662	A	55062
662	A	55063
662	A	55064
662	B	55105

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

662	B	55118

Error Id Valiación 663 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones sobre referidos a canastas accionarias (posición corta).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

ABC_663

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
663	A	55066
663	A	55067
663	A	55068
663	A	55069
663	A	55070
663	A	55071
663	A	55072
663	A	55073
663	A	55074
663	A	55075
663	A	55076
663	A	55077
663	B	55106
663	B	55119

Error Id Valiación 664 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de cada serie en operaciones sobre referidos a índices accionarios (posición corta).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

ABC_664

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
664	A	55079
664	A	55080
664	A	55081
664	A	55082
664	A	55083

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

664	A	55084
664	A	55085
664	A	55086
664	A	55087
664	A	55088
664	A	55089
664	A	55090
664	B	55107
664	B	55120

ABC_665

Error Id Valiación 665 RC05 El importe total de certificados bursátiles que otorguen créditos o inviertan en financiamientos no corresponde a la suma de los montos de cada uno de los certificados bursátiles que integran el rubro (posición corta).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
665	A	55093
665	A	55094
665	A	55095
665	A	55096
665	B	55092

ABC_666

Error Id Valiación 666 RC05 El importe total de certificados bursátiles que no otorguen créditos o inviertan en financiamientos no corresponde a la suma de los montos de cada uno de los certificados bursátiles que integran el rubro (posición corta).

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
666	A	55098
666	A	55099
666	A	55100
666	A	55101
666	B	55097

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td>ABC_667</td><td>Error Id Valiación 667 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de certificados bursátiles que otorguen créditos o inviertan en financiamientos (posición corta).
Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>667</td><td>A</td><td>55093</td></tr><tr><td>667</td><td>A</td><td>55094</td></tr><tr><td>667</td><td>A</td><td>55095</td></tr><tr><td>667</td><td>A</td><td>55096</td></tr><tr><td>667</td><td>B</td><td>55108</td></tr><tr><td>667</td><td>B</td><td>55121</td></tr></table></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>ABC_668</td><td>Error Id Valiación 668 RC05 El importe de los conceptos para determinar el requerimiento y el monto a compensar no corresponde a la suma de los montos de certificados bursátiles que no otorguen créditos o inviertan en financiamientos (posición corta).
Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>668</td><td>A</td><td>55098</td></tr><tr><td>668</td><td>A</td><td>55099</td></tr><tr><td>668</td><td>A</td><td>55100</td></tr><tr><td>668</td><td>A</td><td>55101</td></tr><tr><td>668</td><td>B</td><td>55109</td></tr><tr><td>668</td><td>B</td><td>55122</td></tr></table></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>ABC_669</td><td>Error Id Valiación 669 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta.
Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES</td><td></td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
669	A	55111
669	B	55117
669	B	55123

ABC_670

Error Id Valiación 670 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta correspondiente a operaciones de acciones y sobre acciones.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
670	A	55112
670	B	55118
670	B	55124

ABC_671

Error Id Valiación 671 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta correspondiente a operaciones referidas a canastas de acciones.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
671	A	55113
671	B	55119
671	B	55125

ABC_672

Error Id Valiación 672 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta correspondiente a operaciones referidas a índices accionarios.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
672	A	55114
672	B	55120
672	B	55126

Error Id Valiación 673 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta correspondiente a En certificados bursátiles que otorgan créditos o inviertan en financiamientos.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

ABC_673

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
673	A	55115
673	B	55121
673	B	55127

Error Id Valiación 674 RC05 El importe total de la posición neta del portafolio no corresponde a la posición total larga menos la posicón total corta correspondiente a certificado bursátiles que no otorgan créditos o inviertan en financiamientos.

***Algoritmo*:**

|A-B|=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES

ABC_674

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
674	A	55116
674	B	55122
674	B	55128

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

RC07 RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO DE LA ENTIDAD EMISORA

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>197</td><td>ABC_197</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 197_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: I [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS
Algoritmo:
|A-B|>=0
APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2
Dónde:
<table>
<tr><th rowspan="2">IDENTIFICADOR</th><th rowspan="2">ELEMENTO</th><th rowspan="2">CONCEPTO</th><th colspan="5">APARTADO</th></tr>
<tr><th>I</th><th>II</th><th>III</th><th>IV</th><th>VI</th></tr>
<tr><td>2784</td><td>A</td><td>2</td><td>77000</td><td>77484</td><td>77968</td><td>78452</td><td>79108</td></tr>
<tr><td>2784</td><td>A</td><td>292</td><td>794082</td><td>794202</td><td>794322</td><td>794442</td><td></td></tr>
<tr><td>2784</td><td>A</td><td>4</td><td>77004</td><td>77488</td><td>77972</td><td>78456</td><td>79112</td></tr>
<tr><td>2784</td><td>B</td><td>294</td><td>794084</td><td>794204</td><td>794324</td><td>794444</td><td></td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>198</td><td>ABC_198</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 198_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: II [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS
Algoritmo:
|A-B|>=0
APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2
Dónde:
<table>
<tr><th rowspan="2">IDENTIFICADOR</th><th rowspan="2">ELEMENTO</th><th rowspan="2">CONCEPTO</th><th colspan="5">APARTADO</th></tr>
<tr><th>I</th><th>II</th><th>III</th><th>IV</th><th>VI</th></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>8</td><td>77012</td><td>77496</td><td>77980</td><td>78464</td><td>79120</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>9</td><td>77014</td><td>77498</td><td>77982</td><td>78466</td><td>79122</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>10</td><td>77016</td><td>77500</td><td>77984</td><td>78468</td><td>79124</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>11</td><td>77018</td><td>77502</td><td>77986</td><td>78470</td><td>79126</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>12</td><td>77020</td><td>77504</td><td>77988</td><td>78472</td><td>79128</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>13</td><td>77022</td><td>77506</td><td>77990</td><td>78474</td><td>79130</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>15</td><td>77026</td><td>77510</td><td>77994</td><td>78478</td><td>79134</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>16</td><td>77028</td><td>77512</td><td>77996</td><td>78480</td><td>79136</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>17</td><td>77030</td><td>77514</td><td>77998</td><td>78482</td><td>79138</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>18</td><td>77032</td><td>77516</td><td>78000</td><td>78484</td><td>79140</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>19</td><td>77034</td><td>77518</td><td>78002</td><td>78486</td><td>79142</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>20</td><td>77036</td><td>77520</td><td>78004</td><td>78488</td><td>79144</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>297</td><td>794087</td><td>794207</td><td>794327</td><td>794447</td><td></td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>298</td><td>794088</td><td>794208</td><td>794328</td><td>794448</td><td></td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>299</td><td>794089</td><td>794209</td><td>794329</td><td>794449</td><td></td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>300</td><td>794090</td><td>794210</td><td>794330</td><td>794450</td><td></td></tr>
<tr><td>2785</td><td>A</td><td>301</td><td>794091</td><td>794211</td><td>794331</td><td>794451</td><td></td></tr>
<tr><td>2785</td><td>B</td><td>38</td><td>77072</td><td>77556</td><td>78040</td><td>78524</td><td>79180</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>B</td><td>39</td><td>77074</td><td>77558</td><td>78042</td><td>78526</td><td>79182</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>B</td><td>40</td><td>77076</td><td>77560</td><td>78044</td><td>78528</td><td>79184</td></tr>
<tr><td>2785</td><td>B</td><td>41</td><td>77078</td><td>77562</td><td>78046</td><td>78530</td><td>79186</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*								Nivel
		2785	B	42	77080	77564	78048	78532	79188	
		2785	B	43	77082	77566	78050	78534	79190	
		2785	B	45	77086	77570	78054	78538	79194	
		2785	B	46	77088	77572	78056	78540	79196	
		2785	B	47	77090	77574	78058	78542	79198	
		2785	B	48	77092	77576	78060	78544	79200	
		2785	B	49	77094	77578	78062	78546	79202	
		2785	B	50	77096	77580	78064	78548	79204	
		2785	B	311	794101	794221	794341	794461		
		2785	B	312	794102	794222	794342	794462		
		2785	B	313	794103	794223	794343	794463		
		2785	B	314	794104	794224	794344	794464		
		2785	B	315	794105	794225	794345	794465		
199	ABC_199	ERROR IDVALIDACIÓN 199_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: III [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2* *Dónde:*								Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2786	A	54	77104	77588	78072	78556	79212
2786	A	55	77106	77590	78074	78558	79214
2786	A	56	77108	77592	78076	78560	79216
2786	A	57	77110	77594	78078	78562	79218
2786	A	258	79593	79620	79647	79674	79710
2786	A	259	79594	79621	79648	79675	79711
2786	A	260	79595	79622	79649	79676	79712
2786	A	261	79596	79623	79650	79677	79713
2786	A	67	77130	77614	78098	78582	79238
2786	A	69	77134	77618	78102	78586	79242
2786	A	71	77138	77622	78106	78590	79246
2786	A	73	77142	77626	78110	78594	79250
2786	A	75	77146	77630	78114	78598	79254
2786	A	78	77152	77636	78120	78604	79260
2786	A	319	794109	794229	794349	794469	
2786	A	320	794110	794230	794350	794470	
2786	A	321	794111	794231	794351	794471	
2786	A	322	794112	794232	794352	794472	
2786	A	323	794113	794233	794353	794473	
2786	A	319	794109	794229	794349	794469	
2786	B	110	77216	77700	78184	78668	79324
2786	B	111	77218	77702	78186	78670	79326
2786	B	112	77220	77704	78188	78672	79328
2786	B	113	77222	77706	78190	78674	79330
2786	B	266	79601	79628	79655	79682	79718

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

2786	B	267	79602	79629	79656	79683	79719	
2786	B	268	79603	79630	79657	79684	79720	
2786	B	269	79604	79631	79658	79685	79721	
2786	B	123	77242	77726	78210	78694	79350	
2786	B	125	77246	77730	78214	78698	79354	
2786	B	127	77250	77734	78218	78702	79358	
2786	B	129	77254	77738	78222	78706	79362	
2786	B	131	77258	77742	78226	78710	79366	
2786	B	134	77264	77748	78232	78716	79372	
2786	B	331	794121	794241	794361	794481	2786	
2786	B	332	794122	794242	794362	794482	2786	
2786	B	333	794123	794243	794363	794483	2786	
2786	B	334	794124	794244	794364	794484	2786	
2786	B	335	794125	794245	794365	794485	2786	

200 ABC_200 ERROR IDVALIDACIÓN 200_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IV [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2787	A	141	77270	77754	78238	78722	79378
2787	A	341	794131	794251	794371	794491	
2787	B	143	77274	77758	78242	78726	79382
2787	B	343	794133	794253	794373	794493	

201 ABC_201 ERROR IDVALIDACIÓN 201_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: V [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2788	A	279	772800	777640	782480	787320	793880
2788	A	146	77280	77764	78248	78732	79388
2788	A	147	77282	77766	78250	78734	79390
2788	A	148	77284	77768	78252	78736	79392
2788	A	149	77286	77770	78254	78738	79394
2788	A	346	794136	794256	794376	794496	
2788	A	347	794137	794257	794377	794497	
2788	A	348	794138	794258	794378	794498	
2788	A	349	794139	794259	794379	794499	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

2788	A	350	794140	794260	794380	794500		
2788	B	280	773000	777840	782680	787520	794080	
2788	B	156	77300	77784	78268	78752	79408	
2788	B	157	77302	77786	78270	78754	79410	
2788	B	158	77304	77788	78272	78756	79412	
2788	B	159	77306	77790	78274	78758	79414	
2788	B	358	794148	794268	794388	794508		
2788	B	359	794149	794269	794389	794509		
2788	B	360	794150	794270	794390	794510		
2788	B	361	794151	794271	794391	794511		
2788	B	362	794152	794272	794392	794512		

202 ABC_202 ERROR IDVALIDACIÓN 202_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: VII-A [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

Algoritmo:

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2789	A	163	77314	77798	78282	78766	79422
2789	A	164	77316	77800	78284	78768	79424
2789	A	270	79605	79632	79659	79686	79722
2789	A	167*	77364	77848	78306	78816	79446
2789	A	271*	79606	79633	79660	79687	79723
2789	A	170*	77324	77808	78292	78776	79432
2789	A	171	77326	77810	78294	78778	79434
2789	A	272	79607	79634	79661	79688	79724
2789	A	175	77334	77818	78302	78786	79442
2789	A	178	77340	77824	78308	78792	79448
2789	A	180	77344	77828	78312	78796	79452
2789	A	182	77348	77832	78316	78800	79456
2789	A	184	77352	77836	78320	78804	79460
2789	A	186	77356	77840	78324	78808	79464
2789	A	188	77360	77844	78328	78812	79468
2789	A	279**	79800	79812	79824	79836	79852
2789	A	280**	79801	79813	79825	79837	79853
2789	A	281**	79802	79814	79826	79838	79854
2789	A	282**	79803	79815	79827	79839	79855
2789	A	365***	794155	794275	794395	794515	
2789	A	366***	794156	794276	794396	794516	
2789	A	367***	794157	794277	794397	794517	
2789	A	368***	794158	794278	794398	794518	
2789	A	369***	794159	794279	794399	794519	
2789	A	370***	794160	794280	794400	794520	
2789	A	387***	794177	794297	794417	794537	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*							Nivel
		2789	A	388***	794178	794298	794418	794538		
		2789	A	389***	794179	794299	794419	794539		
		2789	A	390***	794180	794300	794420	794540		
		2789	A	391***	794181	794301	794421	794541		
		2789	A	392***	794182	794302	794422	794542		
		2789	B	221	77422	77906	78390	78874	79530	
		2789	B	222	77424	77908	78392	78876	79532	
		2789	B	276	79611	79638	79665	79692	79728	
		2789	B	225*	77446	77930	78414	78898	79554	
		2789	B	277*	79612	79639	79666	79693	79729	
		2789	B	228*	77432	77916	78400	78884	79540	
		2789	B	229	77434	77918	78402	78886	79542	
		2789	B	278	79613	79640	79667	79694	79730	
		2789	B	233	77442	77926	78410	78894	79550	
		2789	B	236	77448	77932	78416	78900	79556	
		2789	B	238	77452	77936	78420	78904	79560	
		2789	B	240	77456	77940	78424	78908	79564	
		2789	B	242	77460	77944	78428	78912	79568	
		2789	B	244	77464	77948	78432	78916	79572	
		2789	B	287**	79808	79820	79832	79844	79860	
		2789	B	288**	79809	79821	79833	79845	79861	
		2789	B	289**	79810	79822	79834	79846	79862	
		2789	B	290**	79811	79823	79835	79847	79863	
		2789	B	246***	77468	77952	78436	78920		
		2789	B	379***	794169	794289	794409	794529		
		2789	B	380***	794170	794290	794410	794530		
		2789	B	381***	794171	794291	794411	794531		
		2789	B	382***	794172	794292	794412	794532		
		2789	B	383***	794173	794293	794413	794533		
		2789	B	384***	794174	794294	794414	794534		
		2789	B	401***	794191	794311	794431	794551		
		2789	B	402***	794192	794312	794432	794552		
		2789	B	403***	794193	794313	794433	794553		
		2789	B	404***	794194	794314	794434	794554		
		2789	B	405***	794195	794315	794435	794555		
		* Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 *** Aplica a partir de marzo 2026								
203	ABC_203	ERROR IDVALIDACIÓN 203_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IX [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2* *Dónde:*								Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2790	A	249	77474	77958	78442	78926	79582
2790	A	408	794198	794318	794438	794558	
2790	B	251	77478	77962	78446	78930	79586
2790	B	410	794200	794320	794440	794560	

204 ABC_204 ERROR IDVALIDACIÓN 204_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: I [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2791	A	3	77002	77486	77970	78454	79110
2791	A	293	794083	794203	794323	794443	
2791	B	4	77004	77488	77972	78456	79112
2791	B	294	794084	794204	794324	794444	

205 ABC_205 ERROR IDVALIDACIÓN 205_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: II [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2792	A	23	77042	77526	78010	78494	79150
2792	A	24	77044	77528	78012	78496	79152
2792	A	25	77046	77530	78014	78498	79154
2792	A	26	77048	77532	78016	78500	79156
2792	A	27	77050	77534	78018	78502	79158
2792	A	28	77052	77536	78020	78504	79160
2792	A	30	77056	77540	78024	78508	79164
2792	A	31	77058	77542	78026	78510	79166
2792	A	32	77060	77544	78028	78512	79168

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

2792	A	33	77062	77546	78030	78514	79170	
2792	A	34	77064	77548	78032	78516	79172	
2792	A	35	77066	77550	78034	78518	79174	
2792	B	38	77072	77556	78040	78524	79180	
2792	A	304	794094	794214	794334	794454		
2792	A	305	794095	794215	794335	794455		
2792	A	306	794096	794216	794336	794456		
2792	A	307	794097	794217	794337	794457		
2792	A	308	794098	794218	794338	794458		
2792	A	309	794099	794219	794339	794459		
2792	B	39	77074	77558	78042	78526	79182	
2792	B	40	77076	77560	78044	78528	79184	
2792	B	41	77078	77562	78046	78530	79186	
2792	B	42	77080	77564	78048	78532	79188	
2792	B	43	77082	77566	78050	78534	79190	
2792	B	45	77086	77570	78054	78538	79194	
2792	B	46	77088	77572	78056	78540	79196	
2792	B	47	77090	77574	78058	78542	79198	
2792	B	48	77092	77576	78060	78544	79200	
2792	B	49	77094	77578	78062	78546	79202	
2792	B	50	77096	77580	78064	78548	79204	
2792	B	311	794101	794221	794341	794461		
2792	B	312	794102	794222	794342	794462		
2792	B	313	794103	794223	794343	794463		
2792	B	314	794104	794224	794344	794464		
2792	B	315	794105	794225	794345	794465		
2792	B	316	794106	794226	794346	794466		

206 ABC_206 ERROR IDVALIDACIÓN 206_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: III [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2793	A	82	77160	77644	78128	78612	79268
2793	A	83	77162	77646	78130	78614	79270
2793	A	84	77164	77648	78132	78616	79272
2793	A	85	77166	77650	78134	78618	79274

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*								Nivel
		2793	A	262	79597	79624	79651	79678	79714	
		2793	A	263	79598	79625	79652	79679	79715	
		2793	A	264	79599	79626	79653	79680	79716	
		2793	A	265	79600	79627	79654	79681	79717	
		2793	A	95	77186	77670	78154	78638	79294	
		2793	A	97	77190	77674	78158	78642	79298	
		2793	A	99	77194	77678	78162	78646	79302	
		2793	A	101	77198	77682	78166	78650	79306	
		2793	A	103	77202	77686	78170	78654	79310	
		2793	A	106	77208	77692	78176	78660	79316	
		2793	A	325	794115	794235	794355	794475		
		2793	A	326	794116	794236	794356	794476		
		2793	A	327	794117	794237	794357	794477		
		2793	A	328	794118	794238	794358	794478		
		2793	A	329	794119	794239	794359	794479		
		2793	B	110	77216	77700	78184	78668	79324	
		2793	B	111	77218	77702	78186	78670	79326	
		2793	B	112	77220	77704	78188	78672	79328	
		2793	B	113	77222	77706	78190	78674	79330	
		2793	B	266	79601	79628	79655	79682	79718	
		2793	B	267	79602	79629	79656	79683	79719	
		2793	B	268	79603	79630	79657	79684	79720	
		2793	B	269	79604	79631	79658	79685	79721	
		2793	B	123	77242	77726	78210	78694	79350	
		2793	B	125	77246	77730	78214	78698	79354	
		2793	B	127	77250	77734	78218	78702	79358	
		2793	B	129	77254	77738	78222	78706	79362	
		2793	B	131	77258	77742	78226	78710	79366	
		2793	B	134	77264	77748	78232	78716	79372	
		2793	B	331	794121	794241	794361	794481		
		2793	B	332	794122	794242	794362	794482		
		2793	B	333	794123	794243	794363	794483		
		2793	B	334	794124	794244	794364	794484		
		2793	B	335	794125	794245	794365	794485		
207	ABC_207	ERROR IDVALIDACIÓN 207_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IV [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0**								Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2794	A	142	77272	77756	78240	78724	79380
2794	A	342	794132	794252	794372	794492	
2794	B	143	77274	77758	78242	78726	79382
2794	B	343	794133	794253	794373	794493	

208	ABC_208	ERROR IDVALIDACIÓN 208_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: V [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2795	A	281	772900	777740	782580	787420	793980
2795	A	151	77290	77774	78258	78742	79398
2795	A	152	77292	77776	78260	78744	79400
2795	A	153	77294	77778	78262	78746	79402
2795	A	154	77296	77780	78264	78748	79404
2795	A	352	794142	794262	794382	794502	
2795	A	353	794143	794263	794383	794503	
2795	A	354	794144	794264	794384	794504	
2795	A	355	794145	794265	794385	794505	
2795	A	356	794146	794266	794386	794506	
2795	B	280	773000	777840	782680	787520	794080
2795	B	156	77300	77784	78268	78752	79408
2795	B	157	77302	77786	78270	78754	79410
2795	B	158	77304	77788	78272	78756	79412
2795	B	159	77306	77790	78274	78758	79414
2795	B	358	794148	794268	794388	794508	
2795	B	359	794149	794269	794389	794509	
2795	B	360	794150	794270	794390	794510	
2795	B	361	794151	794271	794391	794511	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

2795	B	362	794152	794272	794392	794512		

209 ABC_209 ERROR IDVALIDACIÓN 209_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: VII-A[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

Algoritmo:

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2796	A	192	77368	77852	78336	78820	79476
2796	A	193	77370	77854	78338	78822	79478
2796	A	273	79608	79635	79662	79689	79725
2796	A	196*	77418	77902	78386	78870	74500
2796	A	274*	79609	79636	79663	79690	79726
2796	A	199*	77378	77862	78346	78830	79486
2796	A	283**	79804	79816	79828	79840	79856
2796	A	284**	79805	79817	79829	79841	79857
2796	A	285**	79806	79818	79830	79842	79858
2796	A	286**	79807	79819	79831	79843	79859
2796	A	200	77380	77864	78348	78832	79488
2796	A	275	79610	79637	79664	79691	79727
2796	A	204	77388	77872	78356	78840	79496
2796	A	207	77394	77878	78362	78846	79502
2796	A	209	77398	77882	78366	78850	79506
2796	A	211	77402	77886	78370	78854	79510
2796	A	213	77406	77890	78374	78858	79514
2796	A	215	77410	77894	78378	78862	79518
2796	A	217	77414	77898	78382	78866	79522
2796	A	372***	794162	794282	794402	794522	
2796	A	373***	794163	794283	794403	794523	
2796	A	374***	794164	794284	794404	794524	
2796	A	375***	794165	794285	794405	794525	
2796	A	376***	794166	794286	794406	794526	
2796	A	377***	794167	794287	794407	794527	
2796	A	394***	794184	794304	794424	794544	
2796	A	395***	794185	794305	794425	794545	
2796	A	396***	794186	794306	794426	794546	
2796	A	397***	794187	794307	794427	794547	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*							Nivel
		2796	A	398***	794188	794308	794428	794548	
		2796	A	399***	794189	794309	794429	794549	
		2796	B	221	77422	77906	78390	78874	79530
		2796	B	222	77424	77908	78392	78876	79532
		2796	B	276	79611	79638	79665	79692	79728
		2796	B*	225	77446	77930	78414	78898	79554
		2796	B*	277	79612	79639	79666	79693	79729
		2796	B*	228	77432	77916	78400	78884	79540
		2796	B**	287	79808	79820	79832	79844	79860
		2796	B**	288	79809	79821	79833	79845	79861
		2796	B**	289	79810	79822	79834	79846	79862
		2796	B**	290	79811	79823	79835	79847	79863
		2796	B	229	77434	77918	78402	78886	79542
		2796	B	278	79613	79640	79667	79694	79730
		2796	B	233	77442	77926	78410	78894	79550
		2796	B	236	77448	77932	78416	78900	79556
		2796	B	238	77452	77936	78420	78904	79560
		2796	B	240	77456	77940	78424	78908	79564
		2796	B	242	77460	77944	78428	78912	79568
		2796	B	244	77464	77948	78432	78916	79572
		2796	B	379***	794169	794289	794409	794529	
		2796	B	380***	794170	794290	794410	794530	
		2796	B	381***	794171	794291	794411	794531	
		2796	B	382***	794172	794292	794412	794532	
		2796	B	383***	794173	794293	794413	794533	
		2796	B	384***	794174	794294	794414	794534	
		2796	B	401***	794191	794311	794431	794551	
		2796	B	402***	794192	794312	794432	794552	
		2796	B	403***	794193	794313	794433	794553	
		2796	B	404***	794194	794314	794434	794554	
		2796	B	405***	794195	794315	794435	794555	
		2796	B	406***	794196	794316	794436	794556	

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025
*** Aplica a partir de marzo 2026

210	ABC_210	ERROR IDVALIDACIÓN 210_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IX [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo***: **|A-B|>=0** *APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2* *Dónde:*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2797	A	250	77476	77960	78444	78928	79584
2797	A	409	794199	794319	794439	794559	
2797	B	251	77478	77962	78446	78930	79586
2797	B	410	794200	794320	794440	794560	

326 ABC_326 ERROR IDVALIDACIÓN 326_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IV [POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2
Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
2913	A	137	77308	77792	78276	78760	79416
2913	A	337	794127	794247	794367	794487	
2913	B	139	77312	77796	78280	78764	79420
2913	B	339	794129	794249	794369	794489	

541 ABC_541 ERROR IDVALIDACIÓN 541_RC07:OPERACIONES DEL APARTADO [I-III] EMITIDOS POR EL GRUPO: IV [POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA SOBRE LOS IMPORTES 1 Y 2
Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO	APARTADO				
			I	II	III	IV	VI
3084	A	138	77310	77794	78278	78762	79418
3084	A	338	794128	794248	794368	794488	
3084	B	139	77312	77796	78280	78764	79420
3084	B	339	794129	794249	794369	794489	

Contenido

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>226</td><td>ABC_226</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 226_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 0%

Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2799</td><td>A</td><td>82000</td></tr>
<tr><td>2799</td><td>B</td><td>82100</td></tr>
<tr><td>2799</td><td>B</td><td>82200</td></tr>
<tr><td>2799</td><td>B</td><td>82300</td></tr>
<tr><td>2799</td><td>B</td><td>82400</td></tr>
<tr><td>2799</td><td>B</td><td>82625</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>227</td><td>ABC_227</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 227_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 20%

Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2800</td><td>A</td><td>82002</td></tr>
<tr><td>2800</td><td>B</td><td>82102</td></tr>
<tr><td>2800</td><td>B</td><td>82202</td></tr>
<tr><td>2800</td><td>B</td><td>82301</td></tr>
<tr><td>2800</td><td>B</td><td>82402</td></tr>
<tr><td>2800</td><td>B</td><td>82626</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>228</td><td>ABC_228</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 228_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 50%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2801</td><td>A</td><td>82005</td></tr>
<tr><td>2801</td><td>B</td><td>82105</td></tr>
<tr><td>2801</td><td>B</td><td>82205</td></tr>
<tr><td>2801</td><td>B</td><td>82305</td></tr>
<tr><td>2801</td><td>B</td><td>82405</td></tr>
<tr><td>2801</td><td>B</td><td>82627</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>229</td><td>ABC_229</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 229_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 100%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2802</td><td>A</td><td>82010</td></tr>
<tr><td>2802</td><td>B</td><td>82110</td></tr>
<tr><td>2802</td><td>B</td><td>82210</td></tr>
<tr><td>2802</td><td>B</td><td>82310</td></tr>
<tr><td>2802</td><td>B</td><td>82410</td></tr>
<tr><td>2802</td><td>B</td><td>82628</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>230</td><td>ABC_230</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 230_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 120%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2803</td><td>A</td><td>82012</td></tr>
<tr><td>2803</td><td>B</td><td>82113</td></tr>
<tr><td>2803</td><td>B</td><td>82212</td></tr>
<tr><td>2803</td><td>B</td><td>82312</td></tr>
<tr><td>2803</td><td>B</td><td>82413</td></tr>
<tr><td>2803</td><td>B</td><td>82629</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>231</td><td>ABC_231</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 231_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 150%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2804</td><td>A</td><td>82015</td></tr>
<tr><td>2804</td><td>B</td><td>82117</td></tr>
<tr><td>2804</td><td>B</td><td>82215</td></tr>
<tr><td>2804</td><td>B</td><td>82315</td></tr>
<tr><td>2804</td><td>B</td><td>82415</td></tr>
<tr><td>2804</td><td>B</td><td>82630</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>237</td><td>ABC_237</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 237_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 100%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2808</td><td>A</td><td>83010</td></tr>
<tr><td>2808</td><td>B</td><td>83110</td></tr>
<tr><td>2808</td><td>B</td><td>83210</td></tr>
<tr><td>2808</td><td>B</td><td>83310</td></tr>
<tr><td>2808</td><td>B</td><td>83410</td></tr>
<tr><td>2808</td><td>B</td><td>83627</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>239</td><td>ABC_239</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 239_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 120%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2809</td><td>A</td><td>83012</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

2809	B	83112
2809	B	83212
2809	B	83312
2809	B	83412
2809	B	83628

241 ABC_241 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 241_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 150%

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2810	A	83015
2810	B	83115
2810	B	83215
2810	B	83315
2810	B	83415
2810	B	83629

244 ABC_244 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 244_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND0%

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2812	A	84210
2812	B	84273

246 ABC_246 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 246_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND 20%

***Algoritmo*:**

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2814</td><td>A</td><td>84010</td></tr>
<tr><td>2814</td><td>B</td><td>84020</td></tr>
<tr><td>2814</td><td>B</td><td>84030</td></tr>
<tr><td>2814</td><td>B</td><td>84040</td></tr>
<tr><td>2814</td><td>B</td><td>84050</td></tr>
<tr><td>2814</td><td>B</td><td>84073</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>248</td><td>ABC_248</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 248_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 10%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2816</td><td>A</td><td>80714</td></tr>
<tr><td>2816</td><td>B</td><td>80737</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>249</td><td>ABC_249</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 249_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 10%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2817</td><td>A</td><td>81106</td></tr>
<tr><td>2817</td><td>B</td><td>81112</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>250</td><td>ABC_250</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 250_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 20%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2818</td><td>A</td><td>81214</td></tr>
<tr><td>2818</td><td>B</td><td>81222</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>251</td><td>ABC_251</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 251_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 20%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2819</td><td>A</td><td>85000</td></tr>
<tr><td>2819</td><td>B</td><td>85005</td></tr>
<tr><td>2819</td><td>B</td><td>85010</td></tr>
<tr><td>2819</td><td>B</td><td>85015</td></tr>
<tr><td>2819</td><td>B</td><td>85020</td></tr>
<tr><td>2819</td><td>B</td><td>85031</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

USO LIMITADO

253 ABC_253 ERROR IDVALIDACIÓN 253_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 50% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2821	A	85070
2821	B	85075
2821	B	85080
2821	B	85085
2821	B	85090
2821	B	85101

255 ABC_255 ERROR IDVALIDACIÓN 255_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 115% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2823	A	85140
2823	B	85150
2823	B	85160
2823	B	85170
2823	B	85180
2823	B	85201

257 ABC_257 ERROR IDVALIDACIÓN 257_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 150% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2825	A	85240

2825	B	85245
2825	B	85250
2825	B	85255
2825	B	85260
2825	B	85271

261 ABC_261 ERROR IDVALIDACIÓN 261_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% P_NC — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2829	A	86012
2829	B	860120
2829	B	860121
2829	B	860122
2829	B	860123
2829	B	86017

263 ABC_263 ERROR IDVALIDACIÓN 263_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% AB_NC — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2831	A	86024
2831	B	860240
2831	B	860241

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		2831	B	860242	
		2831	B	860243	
		2831	B	86027	
265	ABC_265	ERROR IDVALIDACIÓN 265_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% O_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2833	A	86036	
		2833	B	860360	
		2833	B	860361	
		2833	B	860362	
		2833	B	860363	
		2833	B	86041	
267	ABC_267	ERROR IDVALIDACIÓN 267_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 20% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2835	A	86052	
		2835	B	861381	
		2835	B	861389	
		2835	B	861397	
		2835	B	861405	
		2835	B	86226	
268	ABC_268	ERROR IDVALIDACIÓN 268_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2836	A	86055	
		2836	B	861382	
		2836	B	861390	

		2836	B	861398	
		2836	B	861406	
		2836	B	86227	
269	ABC_269	ERROR IDVALIDACIÓN 269_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2837	A	86060	
		2837	B	861383	
		2837	B	861391	
		2837	B	861399	
		2837	B	861407	
		2837	B	86228	
270	ABC_270	ERROR IDVALIDACIÓN 270_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 120% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2838	A	86062	
		2838	B	861384	
		2838	B	861392	
		2838	B	861400	
		2838	B	861408	
		2838	B	86229	
271	ABC_271	ERROR IDVALIDACIÓN 271_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2839	A	86065	
		2839	B	861385	

		2839	B	861393	
		2839	B	861401	
		2839	B	861409	
		2839	B	86230	
273	ABC_273	ERROR IDVALIDACIÓN 273_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 20% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2841	A	86302	
		2841	B	861421	
		2841	B	861429	
		2841	B	861437	
		2841	B	861445	
		2841	B	86466	
274	ABC_274	ERROR IDVALIDACIÓN 274_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2842	A	86305	
		2842	B	861422	
		2842	B	861430	
		2842	B	861438	
		2842	B	861446	
		2842	B	86467	
275	ABC_275	ERROR IDVALIDACIÓN 275_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		2843	A	86310	
		2843	B	861423	
		2843	B	861431	
		2843	B	861439	

		2843	B	861447	
		2843	B	86468	
276	ABC_276	ERROR IDVALIDACIÓN 276_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 120% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2844	A	86312
2844	B	861424
2844	B	861432
2844	B	861440
2844	B	861448
2844	B	86469

280	ABC_280	ERROR IDVALIDACIÓN 280_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 20% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2848	A	87002
2848	B	87102
2848	B	87202
2848	B	87302
2848	B	87402
2848	B	87695

286	ABC_286	ERROR IDVALIDACIÓN 286_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 120% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2851	A	87012
2851	B	87112
2851	B	87212
2851	B	87312
2851	B	87412
2851	B	87699

291	ABC_291	ERROR IDVALIDACIÓN 291_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 20% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2854	A	87627
2854	B	87682
2854	B	87737
2854	B	87792
2854	B	87847
2854	B	88011

297	ABC_297	ERROR IDVALIDACIÓN 297_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 120% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2857	A	87657
2857	B	87712
2857	B	87767
2857	B	87822
2857	B	87877
2857	B	88014

302	ABC_302	ERROR IDVALIDACIÓN 302_RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO9 POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 2860 / A / 89000 2860 / B / 89010 2860 / B / 89020 2860 / B / 89030 2860 / B / 89040 2860 / B / 89061	Grave
498	ABC_3085	ERROR IDVALIDACIÓN 542_RC08:UYA TENENCIA DERIVE DE CAPITALIZACIONES DE ADEUDOS O QUE SE HAYAN RECIBIDO COMO DACIÓN EN PAGO DEBE SER LA SUMA DE [ACCIONES CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA MÁS DE 5 AÑOS+ CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA NO MÁS DE 5 AÑOS] ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** **Con tolerancia de ± 2** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3085 / A / 89140 3085 / B / 89145 3085 / B / 89150	Grave
540	ABC_3271	ERROR IDVALIDACION 3271 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 0% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3271 / A / 82025 3271 / B / 82124 3271 / B / 82224 3271 / B / 82324 3271 / B / 82424 3271 / B / 82632	Grave

<table>
<tr>
<td>541</td>
<td>ABC_3272</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3272 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 115%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3272</td><td>A</td><td>82026</td></tr>
<tr><td>3272</td><td>B</td><td>82125</td></tr>
<tr><td>3272</td><td>B</td><td>82225</td></tr>
<tr><td>3272</td><td>B</td><td>82325</td></tr>
<tr><td>3272</td><td>B</td><td>82425</td></tr>
<tr><td>3272</td><td>B</td><td>82633</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>542</td>
<td>ABC_3273</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3273 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO II POND 150%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3273</td><td>A</td><td>82027</td></tr>
<tr><td>3273</td><td>B</td><td>82126</td></tr>
<tr><td>3273</td><td>B</td><td>82226</td></tr>
<tr><td>3273</td><td>B</td><td>82326</td></tr>
<tr><td>3273</td><td>B</td><td>82426</td></tr>
<tr><td>3273</td><td>B</td><td>82634</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>543</td>
<td>ABC_3274</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3274 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 20%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3274</td><td>A</td><td>83027</td></tr>
<tr><td>3274</td><td>B</td><td>83033</td></tr>
<tr><td>3274</td><td>B</td><td>83039</td></tr>
<tr><td>3274</td><td>B</td><td>83045</td></tr>
<tr><td>3274</td><td>B</td><td>83051</td></tr>
<tr><td>3274</td><td>B</td><td>83057</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

544	ABC_3275	ERROR IDVALIDACION 3275 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3275 / A / 83028 3275 / B / 83034 3275 / B / 83040 3275 / B / 83046 3275 / B / 83052 3275 / B / 83058	Grave
545	ABC_3276	ERROR IDVALIDACION 3276 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3276 / A / 83029 3276 / B / 83035 3276 / B / 83041 3276 / B / 83047 3276 / B / 83053 3276 / B / 83059	Grave
546	ABC_3277	ERROR IDVALIDACION 3277 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3277	A	83030
3277	B	83036
3277	B	83042
3277	B	83048
3277	B	83054
3277	B	83060

547	ABC_3278	ERROR IDVALIDACION 3278 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3278	A	83031
3278	B	83037
3278	B	83043
3278	B	83049
3278	B	83055
3278	B	83061

548	ABC_3279	ERROR IDVALIDACION 3279 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO III POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3279	A	83032
3279	B	83038
3279	B	83044
3279	B	83050
3279	B	83056
3279	B	83062

549 ABC_3280 ERROR IDVALIDACION 3280 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND 115% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3280	A	84275
3280	B	84276

550 ABC_3281 ERROR IDVALIDACION 3281 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND 150% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3281	A	84278
3281	B	84279

551 ABC_3282 ERROR IDVALIDACION 3282 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND 115% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3282	A	84283
3282	B	84284
3282	B	84285
3282	B	84286
3282	B	84287
3282	B	84288

552	ABC_3283	ERROR IDVALIDACION 3283 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO IV POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3283	A	84290
3283	B	84291
3283	B	84292
3283	B	84293
3283	B	84294
3283	B	84295

553	ABC_3284	ERROR IDVALIDACION 3284 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3284	A	85309
3284	B	85310
3284	B	85311
3284	B	85312
3284	B	85313
3284	B	85314

554 ABC_3285 ERROR IDVALIDACION 3285 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 150% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3285	A	85316
3285	B	85317
3285	B	85318
3285	B	85319
3285	B	85320
3285	B	85321

555 ABC_3286 ERROR IDVALIDACION 3286 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 115% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3286	A	85323
3286	B	85324
3286	B	85325
3286	B	85326
3286	B	85327
3286	B	85328

556 ABC_3287 ERROR IDVALIDACION 3287 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 150% Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3287	A	85330

		3287	B	85331	
		3287	B	85332	
		3287	B	85333	
		3287	B	85334	
		3287	B	85335	
557	ABC_3288	ERROR IDVALIDACION 3288 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3288	A	85337	
		3288	B	85338	
		3288	B	85339	
		3288	B	85340	
		3288	B	85341	
		3288	B	85342	
558	ABC_3289	ERROR IDVALIDACION 3289 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3289	A	85344	
		3289	B	85345	
		3289	B	85346	
		3289	B	85347	
		3289	B	85348	
		3289	B	85349	
559	ABC_3290	ERROR IDVALIDACION 3290 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2*			Grave

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3290	A	85351
3290	B	85352
3290	B	85353
3290	B	85354
3290	B	85355
3290	B	85356

560	ABC_3291	ERROR IDVALIDACION 3291 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO5 POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2**	Grave

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3291	A	85358
3291	B	85359
3291	B	85360
3291	B	85361
3291	B	85362
3291	B	85363

561	ABC_3292	ERROR IDVALIDACION 3292 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% TC_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3292	A	86106
3292	B	861060
3292	B	861061
3292	B	861062
3292	B	861063
3292	B	86107

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

562 ABC_3293 ERROR IDVALIDACION 3293 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% TC_NC Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3293	A	86109
3293	B	861090
3293	B	861091
3293	B	861092
3293	B	861093
3293	B	86116

563 ABC_3294 ERROR IDVALIDACION 3294 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% P_NC Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3294	A	86118
3294	B	861180
3294	B	861181
3294	B	861182
3294	B	861183
3294	B	86119

564 ABC_3295 ERROR IDVALIDACION 3295 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% P_NC Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3295	A	86121
3295	B	861210
3295	B	861211
3295	B	861212
3295	B	861213

		3295	B	86124	

565	ABC_3296	ERROR IDVALIDACION 3296 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% AB_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3296	A	86126
3296	B	861260
3296	B	861261
3296	B	861262
3296	B	861263
3296	B	86127

566	ABC_3297	ERROR IDVALIDACION 3297 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% AB_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3297	A	86129
3297	B	861290
3297	B	861291
3297	B	861292
3297	B	861293
3297	B	86130

567	ABC_3298	ERROR IDVALIDACION 3298 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% O_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3298	A	86132
3298	B	861320
3298	B	861321
3298	B	861322

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

		3298	B	861323	
		3298	B	86133	
568	ABC_3299	ERROR IDVALIDACION 3299 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% O_NC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3299 / A / 86135 3299 / B / 861350 3299 / B / 861351 3299 / B / 861352 3299 / B / 861353 3299 / B / 86136			Grave
569	ABC_3300	ERROR IDVALIDACION 3300 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3300 / A / 86137 3300 / B / 861386 3300 / B / 861394 3300 / B / 861402 3300 / B / 861410 3300 / B / 86139			Grave
570	ABC_3301	ERROR IDVALIDACION 3301 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% TC ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3301 / A / 86138 3301 / B / 861387 3301 / B / 861395 3301 / B / 861403			Grave

		3301	B	861411	
		3301	B	86140	
571	ABC_3302	ERROR IDVALIDACION 3302 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3302	A	86141	
		3302	B	861426	
		3302	B	861434	
		3302	B	861442	
		3302	B	861450	
		3302	B	86143	
572	ABC_3303	ERROR IDVALIDACION 3303 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3303	A	86142	
		3303	B	861427	
		3303	B	861435	
		3303	B	861443	
		3303	B	861451	
		3303	B	86144	
573	ABC_3304	ERROR IDVALIDACION 3304 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE NO CUENTEN CON GARANTÍAS NI SEGUROS DE CRÉDITO, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3304	A	86515	

		3304	B	86526

574	ABC_3305	ERROR IDVALIDACION 3305 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE NO CUENTEN CON GARANTÍAS NI SEGUROS DE CRÉDITO, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3305 / A / 86540 3305 / B / 86551	Grave
575	ABC_3306	ERROR IDVALIDACION 3306 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE CUENTEN CON UN SEGURO DE CRÉDITO Y/O GARANTÍAS DE PASO Y MEDIDA, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3306 / A / 86570 3306 / B / 86581	Grave
576	ABC_3307	ERROR IDVALIDACION 3307 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE CUENTEN CON UN SEGURO DE CRÉDITO Y/O GARANTÍAS DE PASO Y MEDIDA, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3307 / A / 86600 3307 / B / 86611	Grave
577	ABC_3308	ERROR IDVALIDACION 3308 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE CUENTEN CON GARANTÍAS O SEGURO DE PRIMERAS PÉRDIDAS, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3308 / A / 86645 3308 / B / 86656	Grave

<table>
<tr>
<td>578</td>
<td>ABC_3309</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3309 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS QUE CUENTEN CON GARANTÍAS O SEGURO DE PRIMERAS PÉRDIDAS, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3309</td><td>A</td><td>86685</td></tr>
<tr><td>3309</td><td>B</td><td>86696</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>579</td>
<td>ABC_3310</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3310 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS OTORGADOS BAJO EL ESQUEMA DE "APOYO INFONAVIT", "COFINANCIAMIENTO INFONAVIT" Y/O "COFINANCIAMIENTO FOVISSSTE", DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3310</td><td>A</td><td>86730</td></tr>
<tr><td>3310</td><td>B</td><td>86741</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>580</td>
<td>ABC_3311</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3311 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS OTORGADOS BAJO EL ESQUEMA DE "APOYO INFONAVIT", "COFINANCIAMIENTO INFONAVIT" Y/O "COFINANCIAMIENTO FOVISSSTE", DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3311</td><td>A</td><td>86775</td></tr>
<tr><td>3311</td><td>B</td><td>86786</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>581</td>
<td>ABC_3312</td>
<td>ERROR IDVALIDACION 3312 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS OTORGADOS A PARTIR DEL 1 DE JUNIO DE 2000, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3312</td><td>A</td><td>86820</td></tr>
<tr><td>3312</td><td>B</td><td>86831</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
</table>

582	ABC_3313	ERROR IDVALIDACION 3313 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS OTORGADOS A PARTIR DEL 1 DE JUNIO DE 2000, DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3313 / A / 86865 3313 / B / 86876	Grave
583	ABC_3314	ERROR IDVALIDACION 3314 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3314 / A / 86880 3314 / B / 86891	Grave
584	ABC_3315	ERROR IDVALIDACION 3315 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 115% V ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3315 / A / 86921 3315 / B / 86922 3315 / B / 86923 3315 / B / 86924	Grave
585	ABC_3316	ERROR IDVALIDACION 3316 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 150% V	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2
Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3316	A	86926
3316	B	86927
3316	B	86928
3316	B	86929

586	ABC_3317	ERROR IDVALIDACION 3317 RC08: EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* Aplica hasta noviembre 2025	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3317	A	87024
3317	B	87123
3317	B	87223
3317	B	87323
3317	B	87423
3317	B	87703

587	ABC_3318	ERROR IDVALIDACION 3318 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* Aplica hasta noviembre 2025	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3318	A	87025
3318	B	87124
3318	B	87224
3318	B	87324
3318	B	87424
3318	B	87704

588	ABC_3319	ERROR IDVALIDACION 3319 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3319 / A / 87026 3319 / B / 87125 3319 / B / 87225 3319 / B / 87325 3319 / B / 87425 3319 / B / 87705	Grave
589	ABC_3320	ERROR IDVALIDACION 3320 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 115%% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:* **IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO** 3320 / A / 87027 3320 / B / 87126 3320 / B / 87226 3320 / B / 87326 3320 / B / 87426 3320 / B / 87706	Grave
590	ABC_3321	ERROR IDVALIDACION 3321 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3321	A	87028
3321	B	87127
3321	B	87227
3321	B	87327
3321	B	87427
3321	B	87707

591	ABC_3322	ERROR IDVALIDACION 3322 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* Aplica hasta noviembre 2025	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3322	A	87638
3322	B	87713
3322	B	87748
3322	B	87803
3322	B	87858
3322	B	88017

592	ABC_3323	ERROR IDVALIDACION 3323 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* Aplica hasta noviembre 2025	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3323	A	87639
3323	B	87714
3323	B	87749
3323	B	87804
3323	B	87859
3323	B	88018

593	ABC_3324	ERROR IDVALIDACION 3324 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0**	Grave

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3324	A	87640
3324	B	87715
3324	B	87750
3324	B	87805
3324	B	87860
3324	B	88019

594	ABC_3325	ERROR IDVALIDACION 3325 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3325	A	87641
3325	B	87716
3325	B	87751
3325	B	87806
3325	B	87861
3325	B	88020

595	ABC_3326	ERROR IDVALIDACION 3326 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VII POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3326	A	87642
3326	B	87717
3326	B	87752

		3326	B	87807	
		3326	B	87862	
		3326	B	88021	
596	ABC_3327	ERROR IDVALIDACION 3327 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO9 POND 115% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3327	A	89158	
		3327	B	89159	
		3327	B	89160	
		3327	B	89161	
		3327	B	89162	
		3327	B	89163	
597	ABC_3328	ERROR IDVALIDACION 3328 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO9 POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3328	A	89165	
		3328	B	89166	
		3328	B	89167	
		3328	B	89168	
		3328	B	89169	
		3328	B	89170	

USO LIMITADO

627	ABC_3359	ERROR IDVALIDACION 3359 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 50% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3359	A	86936
3359	B	86939

628	ABC_3360	ERROR IDVALIDACION 3360 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 75% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3360	A	86941
3360	B	86944

629	ABC_3361	ERROR IDVALIDACION 3361 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO VI POND 100% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3361	A	86946
3361	B	86949

630	ABC_2827	ERROR IDVALIDACION 2827 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA CRÉDITO DE TARJETA DE CRÉDITO, NO CALIFICADOS ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2827	A	86000
2827	B	860000
2827	B	860001
2827	B	860002
2827	B	860003
2827	B	86003

631	ABC_3363	ERROR ID VALIDACION 3363 RC08 INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DE TODOS LOS GRUPOS ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3363	A	84303
3363	B	843030
3363	B	843031
3363	B	843038
3363	B	843044
3363	B	843047
3363	B	843061
3363	B	843067
3363	B	843073

632	ABC_3364	ERROR ID VALIDACION 3364 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO II ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3364 / A / 843031 3364 / B / 843032 3364 / B / 843033 3364 / B / 843034 3364 / B / 843035 3364 / B / 843036 3364 / B / 843037	Grave
633	ABC_3365	ERROR ID VALIDACION 3365 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO III ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3365 / A / 843038 3365 / B / 843039 3365 / B / 843040 3365 / B / 843041 3365 / B / 843042 3365 / B / 843043	Grave
634	ABC_3366	ERROR ID VALIDACION 3366 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO IV ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO**	Grave

		3366	A	843044	
		3366	B	843045	
		3366	B	843046	
635	ABC_3367	ERROR ID VALIDACION 3367 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO V ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3367	A	843047	
		3367	B	843048	
		3367	B	843049	
		3367	B	843050	
		3367	B	843051	
		3367	B	843052	
636	ABC_3368	ERROR ID VALIDACION 3368 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO VII_A ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* ** Aplica a partir de diciembre 2025			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3368	A	843061	
		3368	B	843062	
		3368	B	843063	
		3368	B	843064	
		3368	B	843065	
		3368	B	843066	
		3368	B**	843075	
637	ABC_3369	ERROR ID VALIDACION 3369 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO VII_B ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* ** Aplica a partir de diciembre 2025			Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3369	A	843067
3369	B	843068
3369	B	843069
3369	B	843070
3369	B	843071
3369	B	843072
3369	B**	843076

638 ABC_3370 ERROR ID VALIDACION 3370 RC08_INTEGRACIÓN DE LAS CUENTAS POR COBRAR DEL GRUPO IX Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3370	A	843073
3370	B	843074

639 ABC_3371 ERROR IDVALIDACION 3371 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GRUPO V POND 0%

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3371	A	85402
3371	B	85403
3371	B	85404
3371	B	85405
3371	B	85406
3371	B	85407

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

640	ABC_3372	ERROR IDVALIDACION 3372 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO V POND 115% **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3372	A	85412
3372	B	85413
3372	B	85414
3372	B	85415
3372	B	85416
3372	B	85417

641	ABC_3373	ERROR IDVALIDACION 3373 RC08:EL IMPORTE INSOLUTO DE LOS CRÉDITOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO PARA EL GPO V POND 150% **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 2* **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2** *Dónde:*

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3373	A	85423
3373	B	85424
3373	B	85425
3373	B	85426
3373	B	85427

3373	B	85428

Error Id Validación 3379 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-A POND 20%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

3379 3379

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3379	A	87029
3379	B	87034
3379	B	87039
3379	B	87044
3379	B	87049
3379	B	87054

Error Id Validación 3380 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-A POND 50%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

3380 3380 **A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2**

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3380	A	87030

		3380	B	87035
		3380	B	87040
		3380	B	87045
		3380	B	87050
		3380	B	87055

Error Id Validación 3381 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-A POND 50%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

3381 3381

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3381	A	87031
3381	B	87036
3381	B	87041
3381	B	87046
3381	B	87051
3381	B	87056

Error Id Validación 3382 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-A POND 75%

3382 3382

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3382	A	87032
3382	B	87037
3382	B	87042
3382	B	87047
3382	B	87052
3382	B	87057

Error Id Validación 3383 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-A POND 100%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

3383 3383

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3383	A	87033
3383	B	87038
3383	B	87043
3383	B	87048
3383	B	87053

3383	B	87058

Error Id Validación 3384 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-B POND 20%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

3384 3384

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3384	A	87059
3384	B	87064
3384	B	87069
3384	B	87074
3384	B	87079
3384	B	87084

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Error Id Validación 3385 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-B POND 50%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

		IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3385	**3385**	3385	A	87060
		3385	B	87065
		3385	B	87070
		3385	B	87075
		3385	B	87080
		3385	B	87085

Error Id Validación 3386 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-B POND 50%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

3386 3386

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3386	A	87061
3386	B	87066

		3386	B	87071
		3386	B	87076
		3386	B	87081
		3386	B	87086

Error Id Validación 3387 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-B POND 75%

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

		IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3387	3387	3387	A	87062
		3387	B	87067
		3387	B	87072
		3387	B	87077
		3387	B	87082
		3387	B	87087

Error Id Validación 3388 RC08: El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el Grupo VII-B POND 100%

3388 3388

|A-B|>=0

Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3388	A	87063
3388	B	87068
3388	B	87073
3388	B	87078
3388	B	87083
3388	B	87088

RC08 RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR DEPÓSITOS Y PRÉSTAMOS

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
678	ABC_678	Error Id Valiación 678 RC08:Proveniente de Cargos diferidos, pagos anticipados y demás partidas, con excepción de los impuestos diferidos activos así como pagos provisionales de ISR, que impliquen el diferimiento de la aplicación de gastos o costos en el capital de la Institución, que no se resten del capital básico (ponderados al 100 por ciento)debe ser la suma de [Pagos anticipados cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.y cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año.] ***Algoritmo*:** **|A-B|=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	**Grave**

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
678	A	84903
678	B	84904
678	B	84906

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>679</td><td>ABC_679</td><td>Error Id Valiación 679 El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el GPO9 que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y cuenten con la garantía hipotecaria de dichos inmuebles.POND 100%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
A partir de marzo 2026, se aplicará sobre el importe 1 e importe 2

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>679</td><td>A</td><td>88024</td></tr>
<tr><td>679</td><td>B</td><td>88025</td></tr>
<tr><td>679</td><td>B</td><td>88026</td></tr>
<tr><td>679</td><td>B</td><td>88027</td></tr>
<tr><td>679</td><td>B</td><td>88028</td></tr>
<tr><td>679</td><td>B</td><td>88029</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>680</td><td>ABC_680</td><td>Error Id Valiación 680 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el GPO9 que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y cuenten con la garantía hipotecaria de dichos inmuebles. POND 115%
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>680</td><td>A</td><td>88032</td></tr>
<tr><td>680</td><td>B</td><td>88033</td></tr>
<tr><td>680</td><td>B</td><td>88034</td></tr>
<tr><td>680</td><td>B</td><td>88035</td></tr>
<tr><td>680</td><td>B</td><td>88036</td></tr>
<tr><td>680</td><td>B</td><td>88037</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
681	ABC_681	Error Id Valiación 681 RC08:El Importe insoluto de los créditos debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo para el GPO9 que tengan como finalidad el desarrollo o adquisición de inmuebles comerciales y cuenten con la garantía hipotecaria de dichos inmuebles. POND 150% ***Algoritmo*:** **|A-B|>=0** *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
681	A	88039
681	B	88040
681	B	88041
681	B	88042
681	B	88043
681	B	88044

Contenido

RC09 RELATIVO A LA DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
309	ABC_309	ERROR IDVALIDACIÓN 309_RC09:INVERSIONES EN "INSTRUMENTOS DE DEUDA", RELATIVOS A ESQUEMAS DE BURSATILIZACIÓN, CUYAS CALIFICACIONES CORRESPONDAN AL GRADO DE RIESGO 4, 5, 6 O NO ESTÉN CALIFICADOS DEBE SER LA SUMA DE [EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN NO ACTUÓ COMO ORIGINADOR DE LOS ACTIVOS SUBYACENTES+EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN ACTUÓ COMO ORIGINADOR DE LOS ACTIVOS SUBYACENTES, (INCLUYE EL IMPORTE DE LAS UTILIDADES ESPERADAS POR LA OPERACIÓN DE BURSATILIZACIÓN)] ***Algoritmo*:** |A-B|= 0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
2862	A	92101
2862	B	92103
2862	B	92109

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>313</td><td>ABC_313</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 313_RC09: PARTIDAS QUE SE CONTABILICEN EN EL ACTIVO DE LA INSTITUCIÓN COMO INTANGIBLES O QUE, EN SU CASO, IMPLIQUEN EL DIFERIMIENTO DE LA APLICACIÓN DE GASTOS O COSTOS EN EL CAPITAL DE LA INSTITUCIÓN DEBE SER LA SUMA DE [INTANGIBLES DE CUALQUIER TIPO+CRÉDITO MERCANTIL+EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO]

Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2863</td><td>A</td><td>93700</td></tr><tr><td>2863</td><td>B</td><td>93720</td></tr><tr><td>2863</td><td>B</td><td>93730</td></tr><tr><td>2863</td><td>B</td><td>93750</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>317</td><td>ABC_317</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 317_RC09:INVERSIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN NO ACTUÓ COMO ORIGINADOR DE LOS ACTIVOS SUBYACENTES DEBE SER LA SUMA DE [IMPORTE A DEDUCIR DEL CAPITAL BÁSICO +IMPORTE A DEDUCIR DEL CAPITAL COMPLEMENTARIO]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2864</td><td>A</td><td>92103</td></tr><tr><td>2864</td><td>B</td><td>92105</td></tr><tr><td>2864</td><td>B</td><td>92106</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>318</td><td>ABC_318</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 318_RC09:INVERSIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN ACTUÓ COMO ORIGINADOR DE LOS ACTIVOS SUBYACENTES, (INCLUYE EL IMPORTE DE LAS UTILIDADES ESPERADAS POR LA OPERACIÓN DE BURSATILIZACIÓN) DEBE SER LA SUMA DE [IMPORTE A DEDUCIR DEL CAPITAL BÁSICO +IMPORTE A DEDUCIR DEL CAPITAL COMPLEMENTARIO]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2865</td><td>A</td><td>92109</td></tr>
<tr><td>2865</td><td>B</td><td>92110</td></tr>
<tr><td>2865</td><td>B</td><td>92111</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>322</td><td>ABC_322</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 322_RC09:INVERSIONES EN ACCIONES DE DERIVADAS DE CAPITALIZACIONES O DACIONES EN PAGO DE ADEUDOS Y QUE ANTES DE EFECTUARSE DICHA CAPITALIZACIÓN NO SE CONSIDERARÁ A LA CORRESPONDIENTE EMPRESA COMO RELACIONADA CON LA INSTITUCIÓN: DEBE SER LA SUMA DE [CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA MÁS DE 5 AÑOS DE HABERSE EFECTUADO+CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA NO MÁS DE 5 AÑOS DE HABERSE EFECTUADO]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2866</td><td>A</td><td>92384</td></tr>
<tr><td>2866</td><td>B</td><td>92385</td></tr>
<tr><td>2866</td><td>B</td><td>92387</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>323</td><td>ABC_323</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 323_RC09:INVERSIONES EN ACCIONES DE LAS FRACCIONES I Y II, NO COTIZADAS, ASÍ COMO COTIZADAS Y NO COTIZADAS DE LA FRACCIÓN III, CUYA TENENCIA DERIVE DE CAPITALIZACIONES DE ADEUDOS O QUE SE HAYAN RECIBIDO COMO DACIÓN EN PAGO DEBE SER LA SUMA DE [CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA MÁS DE 5 AÑOS DE HABERSE EFECTUADO+CUYA CAPITALIZACIÓN TENGA NO MÁS DE 5 AÑOS DE HABERSE EFECTUADO]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2867</td><td>A</td><td>92570</td></tr>
<tr><td>2867</td><td>B</td><td>92573</td></tr>
<tr><td>2867</td><td>B</td><td>92576</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>325</td><td>ABC_325</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 325_RC09:CRÉDITO MERCANTIL DEBE SER LA SUMA DE [RELATIVO A LAS INVERSIONES EN ACCIONES DE LAS QUE SE RESTAN PARA DETERMINAR EL CAPITAL BÁSICO+RELATIVO A OTRAS INVERSIONES]
Algoritmo:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2868</td><td>A</td><td>93730</td></tr>
<tr><td>2868</td><td>B</td><td>93733</td></tr>
<tr><td>2868</td><td>B</td><td>93736</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>326</td><td>ABC_326</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 326_RC09:EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO DEBE SER LA SUMA DE [RELATIVOS A LOS ACTIVOS FIJOS Y A LOS PAGOS ANTICIPADOS MENORES A UN AÑO+RELATIVOS A OTROS]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>2869</td><td>A</td><td>93750</td></tr>
<tr><td>2869</td><td>B</td><td>93755</td></tr>
<tr><td>2869</td><td>B</td><td>93758</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>543</td><td>ABC_543</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 543_RC09:INSTRUMENTOS DE CAPITAL QUE CUMPLAN CON EL ANEXO 1-S CUYO PLAZO DE AMORTIZACIÓN O DE VENCIMIENTO DEBE SER LA SUMA DE DEL 100% DE LO REPORTADO EN EL CONCEPTO 95085, EL 80% DE LO REPORTADO EN EL CONCEPTO 95090, EL 60% DE LO REPORTADO EN EL CONCEPTO 95095, EL 40% DE LO REPORTADO EN EL CONCEPTO 95100, Y EL 20% DE LO REPORTADO EN EL CONCEPTO 95105 MAS EL 0% DE 95110

Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3086</td><td>A</td><td>95080</td></tr>
<tr><td>3086</td><td>B</td><td>95085</td></tr>
<tr><td>3086</td><td>B</td><td>95090</td></tr>
<tr><td>3086</td><td>B</td><td>95095</td></tr>
<tr><td>3086</td><td>B</td><td>95100</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3086	B	95105
3086	B	95110

544 ABC_544

ERROR IDVALIDACIÓN 544_RC09:SUBSIDIARIAS FINANCIERAS SUJETAS A REQUERIMIENTO DE CAPITAL DEBE SER LA SUMA DE [INVERSIÓN ACCIONARIA EN LA ENTIDAD FINANCIERA +FALTANTE DE CAPITAL MÍNIMO REGULATORIO REQUERIDO PROPORCIONAL A LA TENENCIA ACCIONARIA]

Grave

***Algoritmo*:**

$|A-B| = 0$

Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3087	A	95135
3087	B	95140
3087	B	95145

545 ABC_545

ERROR IDVALIDACIÓN 545_RC09:INVERSIONES EN SOCIEDADES DE INVERSIÓN (EN ACCIONES DISTINTAS A LAS DEL CAPITAL FIJO) DEBE SER LA SUMA DE CAPITALES Y DE OBJETO LIMITADO, COTIZADAS, RESPECTO DE LAS CUALES LA TENENCIA DE LA INSTITUCIÓN NO EXCEDA DEL 15 % DEL CAPITAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN, POR LA PARTE DE TALES SOCIEDADES QUE ESTÉ REPRESENTADA POR TÍTULOS ACCIONARIOS (INFORMATIVO) + DE CAPITALES Y DE OBJETO LIMITADO, COTIZADAS, RESPECTO DE LAS CUALES LA TENENCIA DE LA INSTITUCIÓN EXCEDA DEL 15 % DEL CAPITAL DE LA SOCIEDAD DE INVERSIÓN, POR LA PARTE DE TALES SOCIEDADES QUE ESTÉ REPRESENTADA POR TÍTULOS ACCIONARIOS + DE CAPITALES Y DE OBJETO LIMITADO, NO COTIZADAS, CUYO PORTAFOLIO CONTENGA ACCIONES QUE DEBAN RESTARSE DEL CAPITAL BÁSICO 1 (INFORMATIVO) + DE RENTA VARIABLE, CUALQUIERA QUE SEA EL PORCENTAJE DE PARTICIPACIÓN (INFORMATIVO) + DE INSTRUMENTOS DE DEUDA, CUALQUIERA QUE SEA EL PORCENTAJE DE PARTICIPACIÓN (INFORMATIVO)

Grave

***Algoritmo*:**

$|A-B| = 0$

Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		3088 A 95155 3088 B 92790 3088 B 92792 3088 B 95156 3088 B 92808 3088 B 92810	
546	ABC_546	ERROR IDVALIDACIÓN 546_RC09:ORGANISMOS MULTILATERALES DE DESARROLLO O DE FOMENTO INTERNACIONAL DEBE SER LA SUMA DECUYA TENENCIA ACCIONARIA SEA HASTA POR EL 10% DEL CAPITAL DEL ORGANISMO + CUYA TENENCIA ACCIONARIA SEA MAYOR AL 10% DEL CAPITAL DEL ORGANISMO ***Algoritmo*:** |A-B| = 0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3089 A 95160 3089 B 95165 3089 B 95170	Grave
547	ABC_547	ERROR IDVALIDACIÓN 547_RC09:INVERSIONES EN INSTRUMENTOS DE DEUDA SUBORDINADOS DEBE SER LA SUMA DE [OBLIGACIONES SUBORDINADAS EMITIDAS POR OTRAS ENTIDADES FINANCIERAS+OTRA DEUDA SUBORDINADA] ***Algoritmo*:** |A-B| = 0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3090 A 95185 3090 B 91950 3090 B 95190	Grave
548	ABC_548	ERROR IDVALIDACIÓN 548_RC09:VALORES REFERENCIADOS A ÍNDICES ACCIONARIOS DEBE SER LA SUMA DE [INVERSIONES EN EL CAPITAL DE LA PROPIA INSTITUCIÓN+INVERSIONES EN EL CAPITAL DE CUALQUIER ENTIDAD FINANCIERA]	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0

Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3091	A	95215
3091	B	95220
3091	B	95235

549 | ABC_549 | ERROR IDVALIDACIÓN 549_RC09: VALORES REFERENCIADOS A ÍNDICES ACCIONARIOS A INVERSIONES EN EL CAPITAL DE LA PROPIA INSTITUCIÓN DEBE SER LA DIFERENCIA POSITIVA DE [POSICIÓN LARGA - POSICIÓN CORTA] | Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0

APLICA A LA SEGUNDA COLUMNA DE IMPORTES. EJECUTAR SI 95225 > 95230

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3092	A	95220
3092	A	95230
3092	B	95225

550 | ABC_550 | ERROR IDVALIDACIÓN 550_RC09: VALORES REFERENCIADOS A ÍNDICES ACCIONARIOS A INVERSIONES EN EL CAPITAL DE CUALQUIER ENTIDAD FINANCIERA DEBE SER LA DIFERENCIA POSITIVA DE [POSICIÓN LARGA - POSICIÓN CORTA] | Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0

APLICA A LA SEGUNDA COLUMNA DE IMPORTES. EJECUTAR SI 95240 > 95245

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3093	A	95235
3093	A	95245
3093	B	95240

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>551</td><td>ABC_551</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 551_RC09:RESERVAS PENDIENTES DE CONSTITUIRSE DEBE SER LA SUMA DE [GENERALES+OTRAS]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3094</td><td>A</td><td>95270</td></tr><tr><td>3094</td><td>B</td><td>95275</td></tr><tr><td>3094</td><td>B</td><td>95280</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>552</td><td>ABC_552</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 552_RC09: ACTIVOS INTANGIBLES DE LA INSTITUCIÓN O QUE, EN SU CASO, IMPLIQUEN EL DIFERIMIENTO DE LA APLICACIÓN DE GASTOS O COSTOS EN EL CAPITAL DE LA INSTITUCIÓN DEBE SER INTANGIBLES DISTINTOS A CRÉDITO MERCANTIL + CRÉDITO MERCANTIL + EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3095</td><td>A</td><td>95310</td></tr><tr><td>3095</td><td>B</td><td>95315</td></tr><tr><td>3095</td><td>B</td><td>95320</td></tr><tr><td>3095</td><td>B</td><td>95335</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>553</td><td>ABC_553</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 553_RC09:CRÉDITO MERCANTIL DEBE SER LA SUMA DE [DE INVERSIONES EN ACCIONES DE LAS QUE SE RESTAN PARA DETERMINAR EL CAPITAL BASICO 1 +DE OTRAS INVERSIONES]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3096</td><td>A</td><td>95320</td></tr><tr><td>3096</td><td>B</td><td>95325</td></tr><tr><td>3096</td><td>B</td><td>95330</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>554</td><td>ABC_554</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 554_RC09:EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO DEBE SER LA SUMA DE [PROVENIENTE DE ACTIVOS FIJOS Y A LOS PAGOS ANTICIPADOS MENORES A UN AÑO (INFORMATIVO) +OTROS]
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3097</td><td>A</td><td>95335</td></tr>
<tr><td>3097</td><td>B</td><td>95340</td></tr>
<tr><td>3097</td><td>B</td><td>95345</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>555</td><td>ABC_555</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 555_RC09: PARTIDAS A FAVOR DEBE SER PÉRDIDAS FISCALES + CRÉDITOS FISCALES+ PARTICIPACIÓN DE LOS TRABAJADORES EN LAS UTILIDADES DIFERIDA ACTIVA + OTRAS PARTIDAS TEMPORALES
Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3098</td><td>A</td><td>95355</td></tr>
<tr><td>3098</td><td>B</td><td>95360</td></tr>
<tr><td>3098</td><td>B</td><td>95375</td></tr>
<tr><td>3098</td><td>B</td><td>95376</td></tr>
<tr><td>3098</td><td>B</td><td>95380</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>556</td><td>ABC_556</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 556_RC09: PARTIDAS A CARGO DEBE SER LA SUMA DE OTRAS DIFERENCIAS TEMPORALES QUE COMPENSEN PARTIDAS TEMPORALES A FAVOR + OTRAS DIFERENCIAS TEMPORALES UTILIZADAS PARA COMPENSAR INTANGIBLES DISTINTOS AL CRÉDITO MERCANTIL + OTRAS DIFERENCIAS TEMPORALES UTILIZADAS PARA COMPENSAR EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO + PTU DIFERIDA PASIVA UTILIZADA PARA COMPENSAR INTANGIBLES, PAGOS ANTICIPADOS, CARGOS DIFERIDOS Y PTU DIFERIDA ACTIVA.</td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3099	A	95385
3099	B	95390
3099	B	95395
3099	B	95396
3099	B	95397
3099	B	95403
3099	B	95404
3099	B	95406
3099	B	95407
3099	B	95408
3099	B	95409
3099	B	95410

557	ABC_557	ERROR IDVALIDACIÓN 557_RC09:INVERSIONES EN ACCIONES DE EMPRESAS DE TODAS LAS FRACCIONES DEL ARTÍCULO 75 DE LA L.I.C.: DEBE SER LA SUMA DE [EMPRESAS (COTIZADAS Y NO COTIZADAS) RELACIONADAS CON LA INSTITUCIÓN EN LOS TÉRMINOS DE LOS ARTÍCULOS 73, 73 BIS Y 73 BIS 1 DE LA L.I.C., CUYA INVERSIÓN NO DERIVE DE CAPITALIZACIONES O DACIONES EN PAGO DE ADEUDOS + EMPRESAS (COTIZADAS Y NO COTIZADAS) RELACIONADAS CON LA INSTITUCIÓN EN LOS TÉRMINOS DE LOS ARTÍCULOS 73, 73 BIS Y 73 BIS 1 DE LA L.I.C.,CUYA INVERSIÓN DERIVE DE CAPITALIZACIONES O DACIONES EN PAGO DE ADEUDOS + DE LAS FRACCIONES I Y II, NO COTIZADAS, ASÍ COMO COTIZADAS Y NO COTIZADAS DE LA FRACCIÓN III, CUYA TENENCIA DERIVE DE CAPITALIZACIONES DE ADEUDOS O QUE SE HAYAN RECIBIDO COMO DACIÓN EN PAGO + DE LAS FRACCIONES I Y II, NO COTIZADAS + DE LAS FRACCIONES I Y II, COTIZADAS + DE LA FRACCIÓN III (COTIZADAS Y NO COTIZADAS)]	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES
Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3100	A	92380
3100	B	92389

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3100	B	92384
3100	B	92570
3100	B	92625
3100	B	92655
3100	B	92705

558 | ABC_558 | ERROR IDVALIDACIÓN 558_RC09: EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS DEBE SER LA SUMA DE [OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN OBLIGATORIA + OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA Y/O NO PREFERENTES, NO SUSCEPTIBLES DE CONVERTIRSE EN ACCIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN EMISORA PUEDA CANCELAR EL PAGO DE INTERESES Y DIFERIR EL PAGO DE PRINCIPAL.] | Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3101	A	95405
3101	B	95410
3101	B	95415

559 | ABC_559 | ERROR IDVALIDACIÓN 559_RC09:EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA Y/O NO PREFERENTES, NO SUSCEPTIBLES DE CONVERTIRSE EN ACCIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN EMISORA PUEDA CANCELAR EL PAGO DE INTERESES Y DIFERIR EL PAGO DE PRINCIPAL DEBE SER LA SUMA DE [EL 100% DEL CONCEPTO 95420 MÁS EL 50% DEL CONCEPTO 95425 MAS EL 0% DEL CONCEPTO 95430] | Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3102	A	95415
3102	B	95420
3102	B	95425
3102	A	95430

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
560	ABC_560	ERROR IDVALIDACIÓN 560_RC09: EMISIÓN DE OBLIGACIONES QUE COMPUTABAN EN EL CAPITAL COMPLEMENTARIODEBE SER LA SUMA DE [OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN OBLIGATORIA + OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA Y/O NO PREFERENTES, NO SUSCEPTIBLES DE CONVERTIRSE EN ACCIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN EMISORA PUEDA CANCELAR EL PAGO DE INTERESES Y DIFERIR EL PAGO DE PRINCIPAL. + OBLIGACIONES QUE NO CONTEMPLEN EL DIFERIMIENTO DEL PRINCIPAL Y OTROS INSTRUMENTOS DE CAPITALIZACIÓN)] ***Algoritmo*:** |A-B|= 0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3103	A	95435
3103	B	95440
3103	B	95445
3103	B	95465

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
561	ABC_561	ERROR IDVALIDACIÓN 561_RC09:EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA Y/O NO PREFERENTES, NO SUSCEPTIBLES DE CONVERTIRSE EN ACCIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN EMISORA PUEDA CANCELAR EL PAGO DE INTERESES Y DIFERIR EL PAGO DE PRINCIPAL DEBE SER LA SUMA DE EL 100% DEL CONCEPTO 95450 MÁS EL 50% DEL CONCEPTO 95455 + EL 0% DEL CONCEPTO 95460] ***Algoritmo*:** |A-B|= 0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES*	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3104	A	95445
3104	B	95450
3104	B	95455
3104	A	95460

</td><td></td></tr>
<tr><td>562</td><td>ABC_562</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 562_RC09:OBLIGACIONES QUE NO CONTEMPLEN EL DIFERIMIENTO DEL PRINCIPAL Y OTROS INSTRUMENTOS DE CAPITALIZACIÓN DEBE SER LA SUMA EL 100% DEL CONCEPTO 95470, MÁS EL 80% DEL CONCEPTO 95475, MÁS EL 60% DEL CONCEPTO 95480, MÁS EL 40% DEL CONCEPTO 95485 MAS EL 0% DEL CONCEPTO 95490

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3105	A	95465
3105	B	95470
3105	B	95475
3105	B	95480
3105	B	95485
3105	A	95490

</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>563</td><td>ABC_563</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 563_RC09: EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS EMITIDOS DESPUÉS DEL 30 DE JUNIO DEL 2011 Y HASTA EL 31 DICIEMBRE 2012 DEBE SER LA SUMA DE [OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN OBLIGATORIA + OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA Y/O NO PREFERENTES, NO SUSCEPTIBLES DE CONVERTIRSE EN ACCIONES EN LOS QUE LA INSTITUCIÓN EMISORA PUEDA CANCELAR EL PAGO DE INTERESES Y DIFERIR EL PAGO DE PRINCIPAL.]

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3106</td><td>A</td><td>95505</td></tr>
<tr><td>3106</td><td>B</td><td>95510</td></tr>
<tr><td>3106</td><td>B</td><td>95515</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>564</td><td>ABC_564</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 564_RC09:EMITIDOS DESPUÉS DEL 30 DE JUNIO DEL 2011 Y HASTA EL 31 DICIEMBRE 2012 QUE COMPUTABAN EN EL CAPITAL COMPLEMENTARIO DEBE SER LA SUMA DE L 100% DEL CONCEPTO 95520, 80% DEL CONCEPTO 95525, 60% DEL CONCEPTO 95530, EL 40% DEL CONCEPTO 95535, EL 20% DEL CONCEPTO 95440 MAS EL 0% DEL CONCEPTO 95545

Algoritmo:
|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3107</td><td>A</td><td>95515</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>B</td><td>95520</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>B</td><td>95525</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>B</td><td>95530</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>B</td><td>95535</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>B</td><td>95540</td></tr>
<tr><td>3107</td><td>A</td><td>95545</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>629</td><td>ABC_629</td><td>Error IdValidación 629_RC09: Integración del Capital Fundamental

Algoritmo:

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES</td><td></td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3107	A	95671
3107	B	95678
3107	B	95679
3107	B	95680
3107	B	95684
3107	B	95681

643 ABC_643 Error Id Validación 3375 RC09_Reservas admisibles cartera m.e.

***Algoritmo*:**

$$|A-B| = 0$$

Con tolerancia de ± 0.5

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3375	A	95691
3375	B	95692
3375	B	95693
3375	B	95694

644 ABC_644 Error Id Validación 3376 RC09_Pérdidas esperadas totales de la cartera m.e.

***Algoritmo*:**

$$|A-B| = 0$$

Con tolerancia de ± 0.5

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3376	A	95695
3376	B	95696
3376	B	95697
3376	B	95698

645 ABC_645 Error Id Validación 3377 RC09_Reservas admisibles cartera m.i.

***Algoritmo*:**

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 0.5

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3377	A	95704
3377	B	95705
3377	B	95706
3377	B	95707

646 ABC_646 Error Id Validación 3378 RC09_Pérdidas esperadas totales de la cartera m.i.

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 0.5

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3378	A	95708
3378	B	95709
3378	B	95710
3378	B	95711

647 ABC_647 Error Id Valiación 3379 RC09_En el campo importe que corresponde al monto excedente de grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 y 59 de la CUB debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador.

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Con tolerancia de ± 0.5

* Aplica hasta noviembre 2025

** Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3379	A	96500
3379	B	96510
3379	B*	96520
3379	B**	96552
3379	B	96530

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3379	B	96535	

648 ABC_648

Error Id Valiación 3380 RC09_En el campo importe que corresponde al monto de grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 de la CUB cuyo límite es del 25% del Capital Básico debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

***Algoritmo*:**

$$|A-B| = 0$$

Con tolerancia de ± 0.5

* Aplica hasta noviembre 2025

** Aplica a partir de diciembre 2025

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3380	A	96510
3380	B	96511
3380	B*	96512
3380	B	96513
3380	B**	96551

649 ABC_649

Error Id Valiación 3381 RC09_En el campo importe que corresponde al monto de grandes exposiciones que exceden los límites establecidos en el artículo 54 de la CUB cuyo límite es del 100% del Capital Básico debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

***Algoritmo*:**

$$|A-B| = 0$$

Con tolerancia de ± 0.5

* Aplica hasta noviembre 2025

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3381	A	96530
3381	B	96531
3381	B	96532
3381	B	96533
3381	B	96534

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
650	ABC_650	Error Id Valiación 3382 RC09_En el campo importe que corresponde al monto de grandes exposiciones sobre las cuales no están obligadas a sujetarse a los límites máximos establecidos en el artículo 54 de la CUB debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** |A-B| = 0 Con tolerancia de ± 0.5 * Aplica hasta noviembre 2025	

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3382	A	96540
3382	B	96541
3382	B	96542
3382	B	96543
3382	B	96544
3382	B	96545
3382	B	96546
3382	B	95647
3382	B	96548
3382	B	96549
3382	B	96550

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
675	**ABC_675**	**Error Id ValiDación 675 RC09_Proveniente cargos diferidos y a los pagos anticipados iguales o menores a un año debe ser la suma de [Proveniente de pagos anticipados + cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea igual o menor a un año]** ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia**	

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
675	A	95340
675	B	95337
675	B	95338

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

676 ABC_676

Error Id Valiación 676 RC09_Proveniente cargos diferidos y a los pagos anticipados mayores a un año debe ser la suma de [Proveniente de pagos anticipados + cargos diferidos, cuyo plazo remanente de afectación a resultados sea mayor a un año.]

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Sin tolerancia

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
676	A	95345
676	B	95341
676	B	95342

677 ABC_677

Error Id Valiación 677 RC09_Proveniente de Otras diferencias temporales utilizadas para compensar erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo debe ser la suma de [Otras diferencias temporales utilizadas para compensar pagos anticipados, cargos diferidos]

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Sin tolerancia

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
677	A	95397
677	B	95399
677	B	95400
677	B	95401
677	B	95402

3393 ABC_677

Error Id Valiación 3393 RC09: El saldo de las aportaciones ya realizadas para futuros aumentos de capital debe ser igual a la suma de los conceptos desglosados por plazo de formalización y estatus de prórroga.

***Algoritmo*:**

|A-B|= 0
Sin tolerancia
Aplicará a partir de marzo 2026

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3393	A	95035
3393	B	95036
3393	B	95037

	3393	B	95038

RC10 RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO POR COBERTURAS OTORGADAS A TRAVÉS DE GARANTÍAS

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
573	ABC_573	ERROR IDVALIDACIÓN 573_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO II). RIESGO 1 (PONDERADOS AL 0 POR CIENTO) ***Algoritmo:*** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3253 / A / 100010 3253 / B / 100171	Grave
574	ABC_574	ERROR IDVALIDACIÓN 574_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO II). RIESGO 2 (PONDERADOS AL 20 POR CIENTO) ***Algoritmo:*** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 3254 / A / 100020 3254 / B / 100172	**Grave**
575	ABC_575	ERROR IDVALIDACIÓN 575_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO II). RIESGO 3 (PONDERADOS AL 50 POR CIENTO) ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1*	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3255</td><td>A</td><td>100030</td></tr>
<tr><td>3255</td><td>B</td><td>100173</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>576</td><td>ABC_576</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 576_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO II). RIESGO 4 O 5 O NO CALIFICADOS (PONDERADOS AL 100 POR CIENTO)
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3256</td><td>A</td><td>100040</td></tr>
<tr><td>3256</td><td>B</td><td>100174</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>577</td><td>ABC_577</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 577_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO II). RIESGO 6 (PONDERADOS AL 150 POR CIENTO)
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3257</td><td>A</td><td>100050</td></tr>
<tr><td>3257</td><td>B</td><td>100175</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>578</td><td>ABC_578</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 578_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO III). RIESGO 1 AL 6 (PONDERADOS AL 20 POR CIENTO)
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3258	A	100110
3258	B	100177

579 ABC_579

ERROR IDVALIDACIÓN 579_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO III). NO CALIFICADOS (PONDERADOS AL 50 POR CIENTO)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3259	A	100120
3259	B	100178

580 ABC_580

ERROR IDVALIDACIÓN 580_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO. (GRUPO VII_A). RIESGO 1 Y 2 (PONDERADOS AL 20 POR CIENTO)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3260	A	100210
3260	B	100317

581 ABC_581

ERROR IDVALIDACIÓN 581_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO VII_A). RIESGO 3 AL 5 (PONDERADOS AL 100 POR CIENTO)

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3261	A	100230
3261	B	100318

* Aplica hasta noviembre 2025

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
582	ABC_582	ERROR IDVALIDACIÓN 582_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO VII-A). RIESGO 6 (PONDERADOS AL 150 POR CIENTO) ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3262	A	100250
3262	B	100319

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
583	ABC_583	ERROR IDVALIDACIÓN 583_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO IV). RIESGO 1 (PONDERADOS AL 0 POR CIENTO) ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3263	A	100345
3263	B	100341

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
584	ABC_584	ERROR IDVALIDACIÓN 584_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO IV). RIESGO 2 (PONDERADOS AL 20 POR CIENTO) ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3264	A	100322
3264	B	100342

585 ABC_585 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 585_RC10: EL MONTO DE LOS AVALES OTORGADOS DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO (GRUPO IX). RESERVAS CONSTITUIDAS QUE NO COMPUTEN COMO COMPLEMENTARIO

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3265	A	100325
3265	B	100336

586 ABC_586 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 586_RC10: LA APERTURA DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO. ADMISIBLES NO CALIFICADAS

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3266	A	100455
3266	B	100472

587 ABC_587 — Grave

ERROR IDVALIDACIÓN 587_RC10: LA APERTURA DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO. AMISIBLES CALIFICADAS

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3267</td><td>A</td><td>100456</td></tr>
<tr><td>3267</td><td>B</td><td>100473</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>588</td><td>ABC_588</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 588_RC10: LA APERTURA DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO. NO ADMISIBLES (PONDERADAS AL 100 POR CIENTO)
Algoritmo:
|A-B|>=0
APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3268</td><td>A</td><td>100480</td></tr>
<tr><td>3268</td><td>B</td><td>100474</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>3333</td><td>ABC_3333</td><td>ERROR IDVALIDACION 3333 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: PARA OPERACIONES DE COMERCIO EXTERIOR (PODERADAS AL 10 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO
Algoritmo:
|A-B|>=0
APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:
<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3333</td><td>A</td><td>100410</td></tr>
<tr><td>3333</td><td>B</td><td>100633</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>3334</td><td>ABC_3334</td><td>ERROR IDVALIDACION 3334 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: PARA OPERACIONES DE COMERCIO EXTERIOR (PODERADAS AL 25 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO
Algoritmo:
|A-B|>=0
APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3334	A	100414
3334	B	100644

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3335	ABC_3335	ERROR IDVALIDACION 3335 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: PARA OPERACIONES DE COMERCIO EXTERIOR (PODERADAS AL 50 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3335	A	100415
3335	B	100648

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3336	ABC_3336	ERROR IDVALIDACION 3336 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: PARA OPERACIONES DE COMERCIO EXTERIOR (PODERADAS AL 60 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3336	A	100416
3336	B	100649

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3337	ABC_3337	ERROR IDVALIDACION 3337 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: PARA OPERACIONES DE COMERCIO EXTERIOR (PODERADAS AL 75 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3337	A	100417
3337	B	100651

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3338	ABC_3338	ERROR IDVALIDACION 3338 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTRAS Y UTILIZADAS COMO GARANTÍA DE SOSTENIMIENTO DE OFERTA, GARANTÍA DE LA PROPUESTA, GARANTÍA DE EJECUCIÓN Y GARANTÍA DE DEVOLUCIÓN (PONDERADAS AL 20 POR CIENTO) DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3338	A	100430
3338	A	100490
3338	B	100634

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3339	ABC_3339	ERROR IDVALIDACION 3339 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTRAS Y UTILIZADAS COMO GARANTÍA DE SOSTENIMIENTO DE OFERTA, GARANTÍA DE LA PROPUESTA, GARANTÍA DE EJECUCIÓN Y GARANTÍA DE DEVOLUCIÓN (PONDERADAS AL 50 POR CIENTO) DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3339	A	100431
3339	A	100492
3339	B	100636

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3340	ABC_3340	ERROR IDVALIDACION 3340 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTRAS Y UTILIZADAS COMO GARANTÍA DE SOSTENIMIENTO DE OFERTA, GARANTÍA DE LA PROPUESTA, GARANTÍA DE EJECUCIÓN Y GARANTÍA DE DEVOLUCIÓN (PONDERADAS AL 100 POR CIENTO) DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		Dónde: IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3340 / A / 100432 3340 / A / 100493 3340 / A / 100420 3340 / B / 100637	
3341	ABC_3341	ERROR IDVALIDACION 3341 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTRAS Y UTILIZADAS COMO GARANTÍA DE SOSTENIMIENTO DE OFERTA, GARANTÍA DE LA PROPUESTA, GARANTÍA DE EJECUCIÓN Y GARANTÍA DE DEVOLUCIÓN (PONDERADAS AL 120 POR CIENTO) DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3341 / A / 100433 3341 / A / 100494 3341 / B / 100638	Grave
3342	ABC_3342	ERROR IDVALIDACION 3342 RC10: EL IMPORTE DE LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTRAS Y UTILIZADAS COMO GARANTÍA DE SOSTENIMIENTO DE OFERTA, GARANTÍA DE LA PROPUESTA, GARANTÍA DE EJECUCIÓN Y GARANTÍA DE DEVOLUCIÓN (PONDERADAS AL 150 POR CIENTO) DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3342 / A / 100434 3342 / A / 100496 3342 / B / 100639	Grave
3343	ABC_3343	ERROR IDVALIDACION 3343 RC10: LAS LÍNEAS DE CRÉDITO IRREVOCABLES: OTORGADAS A CASAS DE BOLSA, PARA LIQUIDACIÓN DE SALDOS A CARGO DE LA CUENTA DE CONTROL EN EL INDEVAL (PONDERADAS AL 2.5 POR CIENTO)DEBE SER MAYOR O IGUAL A LOS MITIGANTES DE RIESGO ***Algoritmo*:** |A-B|>=0	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3343	A	100450
3343	B	100632

3389

Error IDValidación: 3389 "RC10: El Monto de los Avales otorgados debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo (Grupo VII_A). Riesgo 3 (ponderados al 20 por ciento)

Aplica a partir de diciembre 2025

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3389	A	104259
3389	B	104263

3390

Error IDValidación: 3390 "RC10: El Monto de los Avales otorgados debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo (Grupo VII_A).Riesgo 4 (ponderados al 50 por ciento)

Aplica a partir de diciembre 2025

***Algoritmo*:**

|A-B|>=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3390	A	104260
3390	B	104264

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3391		Error IDValidación: 3391 "RC10: El Monto de los Avales otorgados debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo (Grupo VII_A).Riesgo 3 y 4 (ponderados al 75 por ciento) Aplica a partir de diciembre 2025 ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	
3392		Error IDValidación: 3392 "RC10: El Monto de los Avales otorgados debe ser mayor o igual a los mitigantes de riesgo (Grupo VII_A). Riesgo 5 (ponderados al 100 por ciento) Aplica a partir de diciembre 2025 ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*	

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3391	A	104261
3391	B	104265

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3392	A	104262
3392	B	104266

USO LIMITADO

RC13 RELATIVO A GARANTÍAS REALES, PERSONALES RECIBIDOS Y DERIVADOS DE CRÉDITO COMO COMPRADOR DE PROTECCIÓN

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
327	ABC_327	ERROR IDVALIDACIÓN 327_RC013: DINERO EN EFECTIVO Y MEDIOS DE PAGO CON VENCIMIENTO MENOR A 7 DÍAS (130005) DEBE SER LA SUMA DE [OPERACIONES DERIVADAS EXTRABURSÁTILES CON VALUACIÓN DIARIA Y SIN DISCORDANCIA DE DIVISAS (130010)] + [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO C) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130015)] + [OTRAS OPERACIONES (130020)] ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 2870 / A / 130005 2870 / B / 130010 2870 / B / 130015 2870 / B / 130020	Grave
328	ABC_328	ERROR IDVALIDACIÓN 328_RC13: DEPÓSITOS Y CRÉDITOS A CARGO DE BANCO DE MÉXICO (130030) DEBE SER LA SUMA DE [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO B) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130035)] + [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO C) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130040)] + [OTRAS OPERACIONES (130045)] ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 Con tolerancia de ± 2 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:* **IDENTIFICADOR** / **ELEMENTO** / **CONCEPTO** 2871 / A / 130030 2871 / B / 130035 2871 / B / 130040 2871 / B / 130045	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>329</td><td>ABC_329</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 329_RC13: VALORES GUBERNAMENTALES (130055) DEBE SER LA SUMA DE [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO B) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130060)] + [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO C) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130065)] + [OTRAS OPERACIONES (130070)]

Algoritmo:
|A-B|>=0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2872</td><td>A</td><td>130055</td></tr><tr><td>2872</td><td>B</td><td>130060</td></tr><tr><td>2872</td><td>B</td><td>130065</td></tr><tr><td>2872</td><td>B</td><td>130070</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>330</td><td>ABC_330</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 330_RC13: RIESGO 1 DE LARGO Y CORTO PLAZO Y RIESGO 2 DE CORTO PLAZO (130080) DEBE SER LA SUMA DE [OPERACIONES QUE CUMPLAN LO ESTABLECIDO EN EL PUNTO B) DEL ARTÍCULO 2 BIS 33 (130085)] + [OTRAS OPERACIONES (130090)]

Algoritmo:
|A-B|>=0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2873</td><td>A</td><td>130080</td></tr><tr><td>2873</td><td>B</td><td>130085</td></tr><tr><td>2873</td><td>B</td><td>130090</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>331</td><td>ABC_331</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 331_RC13: PASIVOS DE LOS SEÑALADOS EN LA FRACCIÓN I INCISO A, B Y D, II Y III DEL ART. 46 DE LA LIC) QUE NO PUEDAN SER RETIRADOS CON ANTERIORIDAD A LA FECHA DE VENCIMIENTO DEL ACTIVO (130120) DEBE SER LA SUMA DE [A CARGO DE LA PROPIA INSTITUCIÓN (130125)]+ A CARGO DE BANCOS DE DESARROLLO QUE CONFORME A SUS RESPECTIVAS LEYES ORGÁNICAS, EL GOBIERNO FEDERAL RESPONDA EN TODO TIEMPO POR DICHAS OPERACIONES (130127)] + [A CARGO DE OTROS BANCOS MÚLTIPLES O BANCOS DE DESARROLLO HASTA EL 30 DE ABRIL 2010 (130130)]

Algoritmo:
|A-B|>=0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2874</td><td>A</td><td>130120</td></tr><tr><td>2874</td><td>B</td><td>130125</td></tr><tr><td>2874</td><td>B</td><td>130126</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>332</td><td>ABC_332</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 332_RC13: OTROS PASIVOS (130135) DEBE SER LA SUMA DE [RIESGO 1 DE CORTO PLAZO O 2 O 3 DE LARGO PLAZO (130140)] + [RIESGO 2 DE CORTO PLAZO (130145)] + [RIESGO 3 DE CORTO PLAZO (130150)]

Algoritmo:
|A-B|>=0
Con tolerancia de ± 2

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>2875</td><td>A</td><td>130135</td></tr><tr><td>2875</td><td>B</td><td>130140</td></tr><tr><td>2875</td><td>B</td><td>130145</td></tr><tr><td>2875</td><td>B</td><td>130150</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>566</td><td>ABC_566</td><td>ERROR IDVALIDACIÓN 566_RC13: GARANTÍAS REALES BAJO EL MÉTODO INTEGRAL INSTRUMENTOS DE DEUDA EMITIDOS POR PERSONAS DE LAS SEÑALADAS EN EL GRUPO III O EN EL GRUPO IV DEBE SER LA SUMA DE [INSTRUMENTOS DE DEUDA EMITIDOS POR INSTITUCIONES, CASAS DE BOLSA Y OTRAS ENTIDADES QUE CUENTEN CON CALIFICACIÓN , IGUAL O MEJOR AL GRADO DE RIESGO 4 DEL ANEXO 1-B] + [INSTRUMENTOS DE CORTO PLAZO CUYA CALIFICACIÓN SEA IGUAL O MEJOR AL GRADO DE RIESGO 3 DEL ANEXO 1-B] + [INSTRUMENTOS DE DEUDA EMITIDOS POR PERSONAS DISTINTAS A LAS ANTERIORES QUE CUMPLAN CON EL ARTÍCULO 2 BIS 33 FRACCIÓN I INCISO G) Y H)] + [ASIVOS DE LOS SEÑALADOS EN LA FRACCIÓN I INCISO A, B Y D, II Y III DEL ART. 46 DE LA LIC) QUE NO PUEDAN SER RETIRADOS CON ANTERIORIDAD A LA FECHA DE VENCIMIENTO DEL ACTIVO GARANTIZADO:]

Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3108</td><td>A</td><td>130230</td></tr>
<tr><td>3108</td><td>B</td><td>130235</td></tr>
<tr><td>3108</td><td>B</td><td>130240</td></tr>
<tr><td>3108</td><td>B</td><td>130246</td></tr>
<tr><td>3108</td><td>B</td><td>130250</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>567</td><td>ABC_567</td><td>ERROR EN IDVALIDACIÓN 567 GARANTÍAS PERSONALES (AVALES): ENTIDADES FINANCIERAS FILIALES DE LA INSTITUCIÓN O INTEGRANTES DEL MISMO GRUPO AL QUE PERTENEZCA LA INSTITUCIÓN DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS

Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr>
<tr><td>3109</td><td>A</td><td>133021</td></tr>
<tr><td>3109</td><td>B</td><td>133020</td></tr>
<tr><td>3109</td><td>B</td><td>133022</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>568</td><td>ABC_568</td><td>ERROR EN IDVALIDACIÓN 568 GARANTÍAS PERSONALES (AVALES): PERSONAS MORALES CON ACTIVIDAD EMPRESARIAL, CUYA CALIFICACIÓN CORRESPONDA AL GRADO DE: DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3110</td><td>A</td><td>137007</td></tr><tr><td>3110</td><td>B</td><td>137005</td></tr><tr><td>3110</td><td>B</td><td>137010</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>569</td><td>ABC_569</td><td>ERROR EN IDVALIDACIÓN 569 DERIVADOS DE CRÉDITO EMITIDOS POR: GOBIERNOS Y BANCOS CENTRALES DE PAÍSES EXTRANJEROS, CUYA CALIFICACIÓN CORRESPONDA AL GRADO DE: DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3111</td><td>A</td><td>132107</td></tr><tr><td>3111</td><td>B</td><td>132105</td></tr><tr><td>3111</td><td>B</td><td>132110</td></tr><tr><td>3111</td><td>B</td><td>132115</td></tr><tr><td>3111</td><td>B</td><td>132117</td></tr><tr><td>3111</td><td>B</td><td>132118</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>570</td><td>ABC_570</td><td>ERROR EN IDVALIDACIÓN 570 DERIVADOS DE CRÉDITO EMITIDOS POR: BANCOS MULTILATERALES DE DESARROLLO, CUYA CALIFICACIÓN CORRESPONDA AL GRADO DE: DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS
Algoritmo:
|A-B|>=0

APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES
Dónde:
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>3112</td><td>A</td><td>132116</td></tr><tr><td>3112</td><td>B</td><td>132120</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3112	B	132122	
3112	B	132125	
3112	B	132130	

571	ABC_571	ERROR EN IDVALIDACIÓN 571 DERIVADOS DE CRÉDITO EMITIDOS POR: ENTIDADES FINANCIERAS FILIALES DE LA INSTITUCIÓN O INTEGRANTES DEL MISMO GRUPO AL QUE PERTENEZCA LA INSTITUCIÓN DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3113	A	133121
3113	B	133120
3113	B	133125

572	ABC_572	ERROR EN IDVALIDACIÓN 572 DERIVADOS DE CRÉDITO EMITIDOS POR: PERSONAS MORALES CON ACTIVIDAD EMPRESARIAL, CUYA CALIFICACIÓN CORRESPONDA AL GRADO: DEBE COINCIDIR CON LA SUMA DE SUS ELEMENTOS ***Algoritmo*:** |A-B|>=0 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO
3114	A	137106
3114	B	137105
3114	B	137110

3344	ABC_3344	ERROR IDVALIDACION 3344 RC13: VALIDA LA SUMA DE INSTITUCIONES DE SEGUROS AUTORIZADAS EN MÉXICO (PONDERADOS AL 20 Y 50 POR CIENTO) DE GARANTÍAS PERSONALES (AVALES) ***Algoritmo*:** |A-B|=0 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:*	Grave

IDENTIFICADOR	ELEMENTO	CONCEPTO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		3344 A 133026 3344 B 133027 3344 B 133028	
3345	ABC_3345	ERROR IDVALIDACION 3345 RC13: VALIDA LA SUMA DE INSTITUCIONES DE SEGUROS AUTORIZADAS EN MÉXICO (PONDERADOS AL 20 Y 50 POR CIENTO) DE DERIVADOS Y SEGUROS DE CRÉDITO ***Algoritmo*:** |A-B|=0 *APLICA A CADA COLUMNA DE IMPORTES, SOBRE LOS TOTALES* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3345 A 133127 3345 B 133128 3345 B 133129	Grave

RC17 RELATIVO A LAS OPERACIONES CON MERCANCÍAS, CON RIESGO DE MERCADO

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3355	ABC_3355	ERROR IDVALIDACION 3355 RC17: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN BRUTA LARGA ***Algoritmo*:** |A-B|=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:* IDENTIFICADOR / ELEMENTO / CONCEPTO 3355 A 170054 3355 B 170002 3355 B 170003 3355 B 170004 3355 B 170005 3355 B 170006 3355 B 170007 3355 B 170008 3355 B 170009 3355 B 170010	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3355	B	170012	
		3355	B	170013	
		3355	B	170014	
		3355	B	170015	
		3355	B	170016	
		3355	B	170017	
		3355	B	170019	
		3355	B	170020	
		3355	B	170021	
		3355	B	170022	
		3355	B	170023	
		3355	B	170024	
3356	ABC_3356	ERROR IDVALIDACION 3356 RC17: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN BRUTA CORTA ***Algoritmo*:** |A-B|=0 *APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1* *Dónde:*			Grave
		IDENTIFICADOR	**ELEMENTO**	**CONCEPTO**	
		3356	A	170055	
		3356	B	170028	
		3356	B	170029	
		3356	B	170030	
		3356	B	170031	
		3356	B	170032	
		3356	B	170033	
		3356	B	170034	
		3356	B	170035	
		3356	B	170036	
		3356	B	170038	
		3356	B	170039	
		3356	B	170040	
		3356	B	170041	
		3356	B	170042	
		3356	B	170043	
		3356	B	170045	

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><td>3356</td><td>B</td><td>170046</td></tr>
<tr><td>3356</td><td>B</td><td>170047</td></tr>
<tr><td>3356</td><td>B</td><td>170048</td></tr>
<tr><td>3356</td><td>B</td><td>170049</td></tr>
<tr><td>3356</td><td>B</td><td>170050</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>3357</td><td>ABC_3357</td><td>ERROR IDVALIDACION 3357 RC17: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN NETA POSITIVA DEL PORTAFOLIO

Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1

Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>CONDICIÓN PREVIA</th><th>CONDICIÓN BASE</th></tr>
<tr><td>3357</td><td>Si 170054>170055</td><td>170056+ 170055 = 170054</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>3358</td><td>ABC_3358</td><td>ERROR IDVALIDACION 3358 RC17: VALIDA LA SUMA DE LA POSICIÓN NETA NEGATIVADEL PORTAFOLIO
Algoritmo:
|A-B|=0

APLICA A LA COLUMNA SOBRE EL IMPORTE 1
Dónde:

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>CONDICIÓN PREVIA</th><th>CONDICIÓN BASE</th></tr>
<tr><td>3358</td><td>Si 170055>=170054</td><td>170056+ 170054 = 170055</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

USO LIMITADO

iv. Validaciones por sección en riesgo operacional

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC12 IN RELATIVO A RIESGO OPERACIONAL INDICADOR DE NEGOCIO

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>3374</td><td>ABC_3374</td><td>ERROR ID VALIDACIÓN 3374 INGRESO POR INTERÉS DE TODOS LOS ACTIVOS FINANCIEROS Y OTROS INGRESOS POR INTERÉS (INCLUYE INGRESO DE ARRENDAMIENTO FINANCIERO Y OPERATIVO, Y GANANCIA DE ACTIVOS EN RENTA).

Algoritmo:
|A-B|= 0
Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

Dónde:

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC12IN</th></tr>
<tr><td>3374</td><td>A</td><td>122010</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122020</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122030</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122040</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122050</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122060</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122070</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122080</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122090</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122100</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122110</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122120</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122130</td></tr>
<tr><td>3374</td><td>B</td><td>122140</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3375	ABC_3375	ERROR ID VALIDACIÓN 3375 GASTOS POR INTERESES DE PASIVOS FINANCIEROS Y OTROS GASTOS POR INTERESES (INCLUYENDO GASTOS POR INTERESES DE ARRENDAMIENTO FINANCIERO Y OPERATIVO, PÉRDIDAS, DEPRECIACIÓN Y DETERIORO DE ACTIVOS EN RENTA). ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC12IN** 3375 / A / 122150 3375 / B / 122160 3375 / B / 122170 3375 / B / 122180 3375 / B / 122190 3375 / B / 122200 3375 / B / 122210 3375 / B / 122220 3375 / B / 122230 3375 / B / 122240 3375 / B / 122250 3375 / B / 122260 3375 / B / 122270 3375 / B / 122280 3375 / B / 122290	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3376	ABC_3376	ERROR ID VALIDACIÓN 3376 INGRESOS POR DIVIDENDOS DE INVERSIONES EN ACCIONES Y FONDOS NO CONSOLIDADOS EN LOS ESTADOS FINANCIEROS DE LA INSTITUCIÓN, INCLUYENDO INGRESOS POR DIVIDENDOS DE SUBSIDIARIAS NO CONSOLIDADAS, ASOCIADAS Y PARTES RELACIONADAS. ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC12IN** 3376 / A / 122300 3376 / B / 122310 3376 / B / 122320	Grave
3377	ABC_3377	ERROR ID VALIDACIÓN 3377 ACTIVOS PRODUCTIVOS ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN* **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC12IN** 3377 / A / 122330	Grave

3377	B	122340
3377	B	122350
3377	B	122360
3377	B	122370

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3378	ABC_3378	ERROR ID VALIDACIÓN 3378 INGRESOS POR COMISIONES Y TARIFAS ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3378	A	122380
3378	B	122390
3378	B	122400
3378	B	122410
3378	B	122420
3378	B	122430
3378	B	122440
3378	B	122450
3378	B	122460
3378	B	122470
3378	B	122480
3378	B	122490
3378	B	122500
3378	B	122510
3378	B	122520
3378	B	122530

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

3378	B	122540
3378	B	122550

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3379	ABC_3379	ERROR ID VALIDACIÓN 3379 GASTOS POR COMISIONES Y TARIFAS ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3379	A	122560
3379	B	122570
3379	B	122580
3379	B	122590
3379	B	122600
3379	B	122610
3379	B	122620

3380	ABC_3380	ERROR ID VALIDACIÓN 3380 OTROS INGRESOS OPERATIVOS ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*	Grave

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3380	A	122630
3380	B	122640
3380	B	122650
3380	B	122660
3380	B	122670
3380	B	122680
3380	B	122690
3380	B	122700
3380	B	122710
3380	B	122720
3380	B	122730
3380	B	122740
3380	B	122750
3380	B	122760
3380	B	122770
3380	B	122780
3380	B	122790
3380	B	122800
3380	B	122810

ERROR ID VALIDACIÓN 3381 OTROS GASTOS OPERATIVOS

***Algoritmo*:**

|A-B| = 0

Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

3381 ABC_3381 Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3381	A	122820
3381	B	122830
3381	B	122840
3381	B	122850
3381	B	122860

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

3381	B	122870	
3381	B	122880	
3381	B	122890	
3381	B	122900	
3381	B	122910	
3381	B	122920	
3381	B	122930	
3381	B	122940	
3381	B	122950	
3381	B	122960	
3381	B	122970	
3381	B	122980	
3381	B	122990	
3381	B	123000	

ERROR ID VALIDACIÓN 3382 UTILIDAD/PÉRDIDA NETA EN ACTIVOS Y PASIVOS DE CARTERA DE INVERSIÓN (DERIVADOS, VALORES DE DEUDA, CRÉDITOS Y ANTICIPOS, POSICIONES CORTAS, OTROS ACTIVOS Y PASIVOS), CUENTAS DE COBERTURAS Y DIFERENCIAS CAMBIARIAS.

***Algoritmo*:**

|A-B| = 0

Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

3382 ABC_3382 Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3382	A	123020
3382	B	123030
3382	B	123040
3382	B	123050
3382	B	123060
3382	B	123070

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3392	ABC_3392	ERROR ID VALIACIÓN 3392 CONSISTENCIA ENTRE EL CONCEPTO DE OTRAS PARTIDAS DE LOS EGRESOS DE LA OPERACIÓN Y APROVECHAMIENTOS ***Algoritmo*:** **|A-B|>= 0** **Únicamente aplicable a bancas de desarrollo y si concepto 122985 > 0** *APLICA A LA SECCIÓN RC12 IN*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3392	A	122980
3392	B	122985

Validaciones vigentes a partir de enero 2023, sin embargo, aplicarán desde enero 2022 por quienes obtengan aprobación de CNBV de uso anticipado del método de indicador de negocio y en general para la constitución de base

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3383	ABC_3383	Error Id Valiación 3383 El importe de INGRESO POR INTERÉS DE TODOS LOS ACTIVOS FINANCIEROS Y OTROS INGRESOS POR INTERÉS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="3">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td colspan="3"><table>
<tr><td>3383</td><td>A</td><td>124010</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124020</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124025</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124030</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124040</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124045</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124050</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124060</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124070</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124080</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124090</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124100</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124110</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124120</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124130</td></tr>
<tr><td>3383</td><td>B</td><td>124140</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>3384</td><td>ABC_3384</td><td colspan="3">Error Id Valiación 3384 El importe de GASTOS POR INTERESES DE PASIVOS FINANCIEROS Y OTROS GASTOS POR INTERESES debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

Algoritmo:

|A-B|= 0

Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC12IN</th></tr>
<tr><td>3384</td><td>A</td><td>124150</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124160</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124170</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124180</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124190</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124200</td></tr>
<tr><td>3384</td><td>B</td><td>124210</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3384	B	124220	
		3384	B	124230	
		3384	B	124240	
		3384	B	124250	
		3384	B	124260	
3385	ABC_3385	Error Id Valiación 3385 El importe de INGRESOS POR DIVIDENDOS DE INVERSIONES EN ACCIONES Y FONDOS NO CONSOLIDADOS EN LOS ESTADOS FINANCIEROS DE LA INSTITUCIÓN debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*			Grave
		ID VALIDACIÓN	**ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN**	**RC12IN**	
		3385	A	124300	
		3385	B	124310	
		3385	B	124320	
3386	ABC_3386	Error Id Valiación 3386 El importe de ACTIVOS PRODUCTIVOS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*			Grave
		ID VALIDACIÓN	**ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN**	**RC12IN**	
		3386	A	124330	

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th colspan="3">Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td colspan="3"><table>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124340</td></tr>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124350</td></tr>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124355</td></tr>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124360</td></tr>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124365</td></tr>
<tr><td>3386</td><td>B</td><td>124370</td></tr>
</table></td><td></td></tr>
<tr><td>3387</td><td>ABC_3387</td><td colspan="3">Error Id Valiación 3387 El importe de INGRESOS POR COMISIONES Y TARIFAS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

Algoritmo:
|A-B|= 0
Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC12IN</th></tr>
<tr><td>3387</td><td>A</td><td>124380</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124390</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124400</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124410</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124420</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124430</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124440</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124450</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124460</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124470</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124480</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124490</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124500</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124510</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124520</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124530</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124540</td></tr>
<tr><td>3387</td><td>B</td><td>124550</td></tr>
</table>
</td><td></td></tr>
<tr><td>3388</td><td>ABC_3388</td><td>
Error Id Valiación 3388 El importe de GASTOS POR COMISIONES Y TARIFAS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

Algoritmo:

|A-B|= 0

Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC12IN</th></tr>
<tr><td>3388</td><td>A</td><td>124560</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124570</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124580</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124590</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124600</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124610</td></tr>
<tr><td>3388</td><td>B</td><td>124620</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>3389</td><td>ABC_3389</td><td>
Error Id Valiación 3389 El importe de OTROS INGRESOS OPERATIVOS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

Algoritmo:

|A-B|= 0

Sin tolerancia

APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC12IN</th></tr>
<tr><td>3389</td><td>A</td><td>124630</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3389	B	124650	
		3389	B	124660	
		3389	B	124670	
		3389	B	124680	
		3389	B	124690	
		3389	B	124700	
		3389	B	124710	
		3389	B	124720	
		3389	B	124730	
		3389	B	124740	
		3389	B	124750	
		3389	B	124760	
		3389	B	124770	
		3389	B	124780	
		3389	B	124790	
		3389	B	124800	
		3389	B	124810	
3390	ABC_3390	Error Id Valiación 3390 El importe de OTROS GASTOS OPERATIVOS debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*			Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3390	A	124820
3390	B	124830
3390	B	124840
3390	B	124850
3390	B	124860
3390	B	124870

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3390	B	124880	
		3390	B	124890	
		3390	B	124900	
		3390	B	124910	
		3390	B	124920	
		3390	B	124930	
		3390	B	124940	
		3390	B	124950	
		3390	B	124960	
		3390	B	124970	
		3390	B	124980	
		3390	B	124990	
		3390	B	125000	
		Error Id Valiación 3391 El importe de UTILIDAD/PÉRDIDA NETA EN ACTIVOS Y PASIVOS DE CARTERA DE INVERSIÓN debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador ***Algoritmo*:** **|A-B|= 0** **Sin tolerancia** *APLICA A LAS SECCIÓN RC12 IN*			
3391	ABC_3391				Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3391	A	125020
3391	B	125030
3391	B	125040
3391	B	125050
3391	B	125060

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3391	B	125070	

Error Id Valiación 3393 Consistencia entre el concepto de Otras partidas de los egresos de la operación y aprovechamientos

***Algoritmo*:**

|A-B|>= 0

Únicamente aplicable a bancas de desarrollo y si concepto 124985 > 0

APLICA A LA SECCIÓN RC12 IN

3393 ABC_3393 Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3393	A	124980
3393	B	124985

Error Id Valiación 3394 El importe de Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas, diferencia cambiaria y valuaciones de derivados, divisas y metales preciosos debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

***Algoritmo*:**

|A-B|>= 0

3394 ABC_3394 **Sin tolerancia** Grave

APLICA A LA SECCIÓN RC12 IN

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC12IN
3394	A	123025
3394	B	123030
3394	B	123040

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*			Nivel
		3394	B	123050	
		3394	B	123060	
		3394	B	123070	
		3394	B	123072	
		3394	B	123073	
		3394	B	123074	

Error Id Valiación 3395 El importe de Utilidad/pérdida neta en activos y pasivos de cartera de inversión (derivados, valores de deuda, créditos y anticipos, posiciones cortas, otros activos y pasivos), cuentas de coberturas, diferencia cambiaria y valuaciones de derivados, divisas y metales preciosos debe ser igual a la suma de los conceptos correspondientes de dicho concepto agrupador

***Algoritmo*:**

|A-B|>= 0

Sin tolerancia

APLICA A LA SECCIÓN RC12 IN

3395	ABC_3395	**ID VALIDACIÓN**	**ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN**	**RC12IN**	Grave
		3395	A	125025	
		3395	B	125030	
		3395	B	125040	
		3395	B	125050	
		3395	B	125060	
		3395	B	125070	
		3395	B	125080	
		3395	B	125090	
		3395	B	125100	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Etapa: Validaciones entre Secciones

i. Objetivo de la validación

Verificar la integridad de la información del formulario RCs, a través de la consistencia aritmética entre conceptos de diferentes secciones.

ii. Validaciones entre secciones.

A continuación se muestra el detalle para cada tipo de validación entre secciones.

Tipo1. Capital (RC09) vs Crédito (RC08)

1.1 Operaciones Relacionadas Relevantes

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>2</td><td>TCT_2</td><td>ERROR ID. 2 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CAPITAL VS CRÉDITO, RELATIVO A OPERACIONES RELACIONADAS RELEVANTES SUJETAS A EVALUAR RC09 (93916) VS RC15
Para el formulario RC15 el Algoritmo es:
|A-B| <= 0.15 A
Con tolerancia de 15%

Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC09</th><th>RC15</th></tr>
<tr><td>2</td><td>A</td><td>93916</td><td></td></tr>
<tr><td>2</td><td>B</td><td></td><td>150400</td></tr>
<tr><td>2</td><td>B</td><td></td><td>150420</td></tr>
</table>
<table>
<tr><td>150400</td><td>Catálogo de Personas relacionadas. [CPersonaRel] TipoRel=9] JOIN RC15.FILTRO[Clase<>{10214,10402, 10403, 10407, 10419, 10420, 104041 a 104043, 104051 a 104055, 104061 a 104065, 104068 a 104072, 104075 a 104079, 104082 a 104086, 10502 y 10464}, FechaC=2] AGRUPAR POR CAMPO [CPersonaRel] Max(sum [ImporteP–sum(Garantia)-sum(Aval)-sum(Reserva),0))]</td></tr>
<tr><td>150420</td><td>Máx(0, 150471 + 150472)</td></tr>
<tr><td>150471</td><td>Catálogo de Personas relacionadas. [CPersonaRel] TipoRel=9] JOIN RC15.FILTRO[Clase={10402, 10403, 10419, 10420, 104041 a 104043, 104051 a 104055,</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		104061 a 104065, 104068 a 104072, 104075 a 104079, 104082 a 104086, FechaC=2] , AGRUPAR POR CAMPO [CPersonaRel] (Max(sum [ImporteP] -sum(Garantia)- sum(Aval),0)- sum [importeN])	
	150472	Catálogo de Personas relacionadas. [CPersonaRel] TipoRel=9 JOIN RC15.FILTRO [Clase={10464} , AGRUPAR POR CAMPO [CPersonaRel] (sum [ImporteP]))	

1.2 Cargos Diferidos menores a un año

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
3	TCT_3	ERROR ID. 3 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CAPITAL VS CRÉDITO, RELATIVO A CARGOS DIFERIDOS MENORES A 1 AÑO RC09 (93755) INFORMATIVO VS RC08 (84903) ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave Vigente hasta dic. 2021

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC08	RC09
3	A		93755
3	B	84903	

Tipo2. Mercado vs Crédito Entidad emisora y Personas Relacionadas

2.1 Activos Brutos por operaciones con títulos de deuda

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
4	TCT_4	ERROR ID. 4 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN MN RC01 (ACTIVOS BRUTOS) VS POSICIONES LARGAS RC07 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ****** Aplica a partir de marzo 2026*** ***Dónde:***	Grave

150320	FILTRO[Clase={10312,10451,10460,10450,10463}] sum [Importe]

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC07	RC15
4	A	10300		
4	A	10302		
4	A	10304		
4	A	10306		
4	A	10308		
4	A	10310		
4	A	10312		
4	A	10314		
4	A	10316		
4	A	10318		
4	A	10320		
4	A	10322		
4	A	10324		
4	A	10326		
4	A	10350		
4	A	10352		
4	A	10354		
4	A	10356		
4	A	10358		
4	A	10360		
4	A	10362		
4	A	10364		
4	A	10366		
4	A	10368		
4	A	10370		
4	A	10372		
4	A	10374		
4	A	10376		
4	A	10400		
4	A	10402		
4	A	10404		
4	A	10406		
4	A	10408		
4	A	10410		
4	A	10412		
4	A	10414		
4	A	10416		
4	A	10418		
4	A	10420		
4	A	10422		
4	A	10424		
4	A	10426		
4	A	10450		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		4	A	10452		
		4	A	10454		
		4	A	10456		
		4	A	10458		
		4	A	10460		
		4	A	10462		
		4	A	10464		
		4	A	10466		
		4	A	10468		
		4	A	10470		
		4	A	10472		
		4	A	10474		
		4	A	10476		
		4	A	10500		
		4	A	10502		
		4	A	10504		
		4	A	10506		
		4	A	10508		
		4	A	10510		
		4	A	10512		
		4	A	10514		
		4	A	10516		
		4	A	10518		
		4	A	10520		
		4	A	10522		
		4	A	10524		
		4	A	10526		
		4	A	10600		
		4	A	10602		
		4	A	10604		
		4	A	10606		
		4	A	10608		
		4	A	10610		
		4	A	10612		
		4	A	10614		
		4	A	10616		
		4	A	10618		
		4	A	10620		
		4	A	10622		
		4	A	10624		
		4	A	10626		
		4	B		77000	150320
		4	B		79587	
		4	B		77012	
		4	B		77014	
		4	B		77016	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo		Nivel
	4	B	77018	
	4	B	77020	
	4	B	77022	
	4	B	79588	
	4	B	77026	
	4	B	77028	
	4	B	77030	
	4	B	77032	
	4	B	77034	
	4	B	77036	
	4	B	77104	
	4	B	77106	
	4	B	77108	
	4	B	77110	
	4	B	79593	
	4	B	79594	
	4	B	79595	
	4	B	79596	
	4	B	77130	
	4	B	77134	
	4	B	77138	
	4	B	77142	
	4	B	77146	
	4	B	77152	
	4	B	77308	
	4	B	77270	
	4	B	772800	
	4	B	77280	
	4	B	77282	
	4	B	77284	
	4	B	77286	
	4	B	77314	
	4	B	77316	
	4	B	79605	
	4	B*	77364	
	4	B*	79606	
	4	B*	77324	
	4	B**	79800	
	4	B**	79801	
	4	B**	79802	
	4	B**	79803	
	4	B	77326	
	4	B	79607	
	4	B	77334	
	4	B	77340	
	4	B	77344	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		4	B	77348	
		4	B	77352	
		4	B	77356	
		4	B	77360	
		4	B	77474	
		4	B ***	794082	
		4	B ***	794087	
		4	B ***	794088	
		4	B ***	794089	
		4	B ***	794090	
		4	B ***	794091	
		4	B ***	794092	
		4	B ***	794109	
		4	B ***	794110	
		4	B ***	794111	
		4	B ***	794112	
		4	B ***	794113	
		4	B ***	794127	
		4	B ***	794131	
		4	B ***	794136	
		4	B ***	794137	
		4	B ***	794138	
		4	B ***	794139	
		4	B ***	794140	
		4	B ***	794155	
		4	B ***	794156	
		4	B ***	794157	
		4	B ***	794158	
		4	B ***	794159	
		4	B ***	794160	
		4	B ***	794177	
		4	B ***	794178	
		4	B ***	794179	
		4	B ***	794180	
		4	B ***	794181	
		4	B ***	794182	
		4	B ***	794198	
5	TCT_5	ERROR ID. 5 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN UDIS_SMG RC03, RC11 (ACTIVOS BRUTOS) VS POSICIONES LARGAS RC07 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** * Aplica hasta noviembre 2025			NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

** Aplica a partir de diciembre 2025

***** Aplica a partir de marzo 2026**

Dónde:

150330	FILTRO[Clase={10313,10461}] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC11	RC07	RC15
5	A	30300	110300		
5	A	30302	110302		
5	A	30304	110304		
5	A	30306	110306		
5	A	30308	110308		
5	A	30310	110310		
5	A	30312	110312		
5	A	30314	110314		
5	A	30316	110316		
5	A	30318	110318		
5	A	30320	110320		
5	A	30322	110322		
5	A	30324	110324		
5	A	30326	110326		
5	A	30350	110350		
5	A	30352	110352		
5	A	30354	110354		
5	A	30356	110356		
5	A	30358	110358		
5	A	30360	110360		
5	A	30362	110362		
5	A	30364	110364		
5	A	30366	110366		
5	A	30368	110368		
5	A	30370	110370		
5	A	30372	110372		
5	A	30374	110374		
5	A	30376	110376		
5	A	30400	110400		
5	A	30402	110402		
5	A	30404	110404		
5	A	30406	110406		
5	A	30408	110408		
5	A	30410	110410		
5	A	30412	110412		
5	A	30414	110414		
5	A	30416	110416		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		5	A	30418	110418	
		5	A	30420	110420	
		5	A	30422	110422	
		5	A	30424	110424	
		5	A	30426	110426	
		5	A	30450	110450	
		5	A	30452	110452	
		5	A	30454	110454	
		5	A	30456	110456	
		5	A	30458	110458	
		5	A	30460	110460	
		5	A	30462	110462	
		5	A	30464	110464	
		5	A	30466	110466	
		5	A	30468	110468	
		5	A	30470	110470	
		5	A	30472	110472	
		5	A	30474	110474	
		5	A	30476	110476	
		5	A	30500	110500	
		5	A	30502	110502	
		5	A	30504	110504	
		5	A	30506	110506	
		5	A	30508	110508	
		5	A	30510	110510	
		5	A	30512	110512	
		5	A	30514	110514	
		5	A	30516	110516	
		5	A	30518	110518	
		5	A	30520	110520	
		5	A	30522	110522	
		5	A	30524	110524	
		5	A	30526	110526	
		5	A	30600	110600	
		5	A	30602	110602	
		5	A	30604	110604	
		5	A	30606	110606	
		5	A	30608	110608	
		5	A	30610	110610	
		5	A	30612	110612	
		5	A	30614	110614	
		5	A	30616	110616	
		5	A	30618	110618	
		5	A	30620	110620	
		5	A	30622	110622	
		5	A	30624	110624	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
	5	A	30626	110626		
	5	B			77484 150330	
	5	B			79614	
	5	B			77496	
	5	B			77498	
	5	B			77500	
	5	B			77502	
	5	B			77504	
	5	B			77506	
	5	B			79615	
	5	B			77510	
	5	B			77512	
	5	B			77514	
	5	B			77516	
	5	B			77518	
	5	B			77520	
	5	B			77588	
	5	B			77590	
	5	B			77592	
	5	B			77594	
	5	B			79620	
	5	B			79621	
	5	B			79622	
	5	B			79623	
	5	B			77614	
	5	B			77618	
	5	B			77622	
	5	B			77626	
	5	B			77630	
	5	B			77636	
	5	B			77792	
	5	B			77754	
	5	B			777640	
	5	B			77764	
	5	B			77766	
	5	B			77768	
	5	B			77770	
	5	B			77798	
	5	B			77800	
	5	B			79632	
	5	B*			77848	
	5	B*			79633	
	5	B*			77808	
	5	B**			79812	
	5	B**			79813	
	5	B**			79814	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo		Nivel
		5	B**	79815
		5	B	77810
		5	B	79634
		5	B	77818
		5	B	77824
		5	B	77828
		5	B	77832
		5	B	77836
		5	B	77840
		5	B	77844
		5	B	77958
		5	B ***	794202
		5	B ***	794207
		5	B ***	794208
		5	B ***	794209
		5	B ***	794210
		5	B ***	794211
		5	B ***	794212
		5	B ***	794229
		5	B ***	794230
		5	B ***	794231
		5	B ***	794232
		5	B ***	794233
		5	B ***	794247
		5	B ***	794251
		5	B ***	794256
		5	B ***	794257
		5	B ***	794258
		5	B ***	794259
		5	B ***	794260
		5	B ***	794275
		5	B ***	794276
		5	B ***	794277
		5	B ***	794278
		5	B ***	794279
		5	B ***	794280
		5	B ***	794297
		5	B ***	794298
		5	B ***	794299
		5	B ***	794300
		5	B ***	794301
		5	B ***	794302
		5	B ***	794318

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
6	TCT_6	ERROR ID. 6 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN ME RC04 (ACTIVOS BRUTOS) VS POSICIONES LARGAS RC07 Y RC15	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025
***** Aplica a partir de marzo 2026**

Dónde:

150340	FILTRO[Clase={10314,10462}] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC07	RC15
6	A	40300		
6	A	40302		
6	A	40304		
6	A	40306		
6	A	40308		
6	A	40310		
6	A	40312		
6	A	40314		
6	A	40316		
6	A	40318		
6	A	40320		
6	A	40322		
6	A	40324		
6	A	40326		
6	A	40350		
6	A	40352		
6	A	40354		
6	A	40356		
6	A	40358		
6	A	40360		
6	A	40362		
6	A	40364		
6	A	40366		
6	A	40368		
6	A	40370		
6	A	40372		
6	A	40374		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		6	A	40376	
		6	A	40400	
		6	A	40402	
		6	A	40404	
		6	A	40406	
		6	A	40408	
		6	A	40410	
		6	A	40412	
		6	A	40414	
		6	A	40416	
		6	A	40418	
		6	A	40420	
		6	A	40422	
		6	A	40424	
		6	A	40426	
		6	A	40450	
		6	A	40452	
		6	A	40454	
		6	A	40456	
		6	A	40458	
		6	A	40460	
		6	A	40462	
		6	A	40464	
		6	A	40466	
		6	A	40468	
		6	A	40470	
		6	A	40472	
		6	A	40474	
		6	A	40476	
		6	A	40500	
		6	A	40502	
		6	A	40504	
		6	A	40506	
		6	A	40508	
		6	A	40510	
		6	A	40512	
		6	A	40514	
		6	A	40516	
		6	A	40518	
		6	A	40520	
		6	A	40522	
		6	A	40524	
		6	A	40526	
		6	A	40600	
		6	A	40602	
		6	A	40604	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		6	A	40606		
		6	A	40608		
		6	A	40610		
		6	A	40612		
		6	A	40614		
		6	A	40616		
		6	A	40618		
		6	A	40620		
		6	A	40622		
		6	A	40624		
		6	A	40626		
		6	B		77968 150340	
		6	B		79641	
		6	B		77980	
		6	B		77982	
		6	B		77984	
		6	B		77986	
		6	B		77988	
		6	B		77990	
		6	B		79642	
		6	B		77994	
		6	B		77996	
		6	B		77998	
		6	B		78000	
		6	B		78002	
		6	B		78004	
		6	B		78072	
		6	B		78074	
		6	B		78076	
		6	B		78078	
		6	B		79647	
		6	B		79648	
		6	B		79649	
		6	B		79650	
		6	B		78098	
		6	B		78102	
		6	B		78106	
		6	B		78110	
		6	B		78114	
		6	B		78120	
		6	B		78276	
		6	B		78238	
		6	B		782480	
		6	B		78248	
		6	B		78250	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		6	B	78252	
		6	B	78254	
		6	B	78282	
		6	B	78284	
		6	B	79659	
		6	B*	78306	
		6	B*	79660	
		6	B*	78292	
		6	B**	79824	
		6	B**	79825	
		6	B**	79826	
		6	B**	79827	
		6	B	78294	
		6	B	79661	
		6	B	78302	
		6	B	78308	
		6	B	78312	
		6	B	78316	
		6	B	78320	
		6	B	78324	
		6	B	78328	
		6	B	78442	
		6	B ***	794322	
		6	B ***	794327	
		6	B ***	794328	
		6	B ***	794329	
		6	B ***	794330	
		6	B ***	794331	
		6	B ***	794332	
		6	B ***	794349	
		6	B ***	794350	
		6	B ***	794351	
		6	B ***	794352	
		6	B ***	794353	
		6	B ***	794367	
		6	B ***	794371	
		6	B ***	794376	
		6	B ***	794377	
		6	B ***	794378	
		6	B ***	794379	
		6	B ***	794380	
		6	B ***	794395	
		6	B ***	794396	
		6	B ***	794397	
		6	B ***	794398	
		6	B ***	794399	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
		6 B *** 794400 6 B *** 794417 6 B *** 794418 6 B *** 794419 6 B *** 794420 6 B *** 794421 6 B *** 794422 6 B *** 794438	
8	TCT_8	ERROR ID. 8 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES CON VINCULACIÓN CREDITICIA RC01, RC03, RC04, RC11 (CREDIT LINKED NOTES) (ACTIVOS BRUTOS) VS POSICIONES LARGAS RC07 Y RC15	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC07
8	A	11350	31350	41440	111350	
8	A	11352	31352	41442	111352	
8	A	11354	31354	41444	111354	
8	A	11356	31356	41446	111356	
8	A	11358	31358	41448	111358	
8	A	11360	31360	41450	111360	
8	A	11362	31362	41452	111362	
8	A	11364	31364	41454	111364	
8	A	11366	31366	41456	111366	
8	A	11368	31368	41458	111368	
8	A	11370	31370	41460	111370	
8	A	11372	31372	41462	111372	
8	A	11374	31374	41464	111374	
8	A	11376	31376	41466	111376	
8	B					78936
8	B					79695
8	B					78944
8	B					78946
8	B					78948
8	B					78950
8	B					78952
8	B					78954
8	B					79696

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	8	B		78958	
	8	B		78960	
	8	B		78962	
	8	B		78964	
	8	B		78966	
	8	B		78968	
	8	B		78976	
	8	B		78978	
	8	B		78980	
	8	B		78982	
	8	B		79697	
	8	B		79698	
	8	B		79699	
	8	B		79700	
	8	B		79002	
	8	B		79006	
	8	B		79010	
	8	B		79014	
	8	B		79018	
	8	B		79024	
	8	B		79032	
	8	B		79030	
	8	B		790360	
	8	B		79036	
	8	B		79038	
	8	B		79040	
	8	B		79042	
	8	B		79050	
	8	B		79052	
	8	B		79701	
	8	B*		79073	
	8	B*		79702	
	8	B*		79060	
	8	B**		79848	
	8	B**		79849	
	8	B**		79850	
	8	B**		79851	
	8	B		79062	
	8	B		79703	
	8	B		79070	
	8	B		79076	
	8	B		79080	
	8	B		79084	
	8	B		79088	
	8	B		79092	
	8	B		79096	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
	8	B 79102	

2.2 Pasivos Brutos por operaciones con títulos de deuda

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
9	TCT_9	ERROR ID. 9 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN MN RC01 (PASIVOS BRUTOS) VS POSICIONES CORTAS RC07 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ***** Aplica a partir de marzo 2026** ***Dónde:***	Grave

150350	FILTRO[Clase={10312,10451,10460,10450,10463}] sum [ImporteP(

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC07	RC15
9	A	13500		
9	A	13502		
9	A	13504		
9	A	13506		
9	A	13508		
9	A	13510		
9	A	13512		
9	A	13514		
9	A	13516		
9	A	13518		
9	A	13520		
9	A	13522		
9	A	13524		
9	A	13526		
9	A	13550		
9	A	13552		
9	A	13554		
9	A	13556		
9	A	13558		
9	A	13560		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		9	A	13562	
		9	A	13564	
		9	A	13566	
		9	A	13568	
		9	A	13570	
		9	A	13572	
		9	A	13574	
		9	A	13576	
		9	A	13600	
		9	A	13602	
		9	A	13604	
		9	A	13606	
		9	A	13608	
		9	A	13610	
		9	A	13612	
		9	A	13614	
		9	A	13616	
		9	A	13618	
		9	A	13620	
		9	A	13622	
		9	A	13624	
		9	A	13626	
		9	A	13650	
		9	A	13652	
		9	A	13654	
		9	A	13656	
		9	A	13658	
		9	A	13660	
		9	A	13662	
		9	A	13664	
		9	A	13666	
		9	A	13668	
		9	A	13670	
		9	A	13672	
		9	A	13674	
		9	A	13676	
		9	A	13700	
		9	A	13702	
		9	A	13704	
		9	A	13706	
		9	A	13708	
		9	A	13710	
		9	A	13712	
		9	A	13714	
		9	A	13716	
		9	A	13718	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
	9	A	13720			
	9	A	13722			
	9	A	13724			
	9	A	13726			
	9	B		77002	150350	
	9	B		79589		
	9	B		77042		
	9	B		77044		
	9	B		77046		
	9	B		77048		
	9	B		77050		
	9	B		77052		
	9	B		79590		
	9	B		77056		
	9	B		77058		
	9	B		77060		
	9	B		77062		
	9	B		77064		
	9	B		77066		
	9	B		77160		
	9	B		77162		
	9	B		77164		
	9	B		77166		
	9	B		79597		
	9	B		79598		
	9	B		79599		
	9	B		79600		
	9	B		77186		
	9	B		77190		
	9	B		77194		
	9	B		77198		
	9	B		77202		
	9	B		77208		
	9	B		77310		
	9	B		77272		
	9	B		772900		
	9	B		77290		
	9	B		77292		
	9	B		77294		
	9	B		77296		
	9	B		77368		
	9	B		77370		
	9	B		79608		
	9	B*		77418		
	9	B*		79609		
	9	B*		77378		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo		Nivel
	9	B**	79804	
	9	B**	79805	
	9	B**	79806	
	9	B**	79807	
	9	B	77380	
	9	B	79610	
	9	B	77388	
	9	B	77394	
	9	B	77398	
	9	B	77402	
	9	B	77406	
	9	B	77410	
	9	B	77414	
	9	B	77476	
	9	B ***	794083	
	9	B ***	794094	
	9	B ***	794095	
	9	B ***	794096	
	9	B ***	794097	
	9	B ***	794098	
	9	B ***	794099	
	9	B ***	794115	
	9	B ***	794116	
	9	B ***	794117	
	9	B ***	794118	
	9	B ***	794119	
	9	B ***	794128	
	9	B ***	794132	
	9	B ***	794142	
	9	B ***	794143	
	9	B ***	794144	
	9	B ***	794145	
	9	B ***	794146	
	9	B ***	794162	
	9	B ***	794163	
	9	B ***	794164	
	9	B ***	794165	
	9	B ***	794166	
	9	B ***	794167	
	9	B ***	794184	
	9	B ***	794185	
	9	B ***	794186	
	9	B ***	794187	
	9	B ***	794188	
	9	B ***	794189	
	9	B ***	794199	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
10	TCT_10	ERROR ID. 10 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN UDIS_SMG RC03,RC11 (PASIVOS BRUTOS) VS POSICIONES CORTAS RC07 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ****** Aplica a partir de marzo 2026*** ***Dónde:***	NO Grave

150360	FILTRO[Clase={10313,10461}] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC11	RC07	RC15
10	A	33500	113500		
10	A	33502	113502		
10	A	33504	113504		
10	A	33506	113506		
10	A	33508	113508		
10	A	33510	113510		
10	A	33512	113512		
10	A	33514	113514		
10	A	33516	113516		
10	A	33518	113518		
10	A	33520	113520		
10	A	33522	113522		
10	A	33524	113524		
10	A	33526	113526		
10	A	33550	113550		
10	A	33552	113552		
10	A	33554	113554		
10	A	33556	113556		
10	A	33558	113558		
10	A	33560	113560		
10	A	33562	113562		
10	A	33564	113564		
10	A	33566	113566		
10	A	33568	113568		
10	A	33570	113570		
10	A	33572	113572		
10	A	33574	113574		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		10	A	33576	113576		
		10	A	33600	113600		
		10	A	33602	113602		
		10	A	33604	113604		
		10	A	33606	113606		
		10	A	33608	113608		
		10	A	33610	113610		
		10	A	33612	113612		
		10	A	33614	113614		
		10	A	33616	113616		
		10	A	33618	113618		
		10	A	33620	113620		
		10	A	33622	113622		
		10	A	33624	113624		
		10	A	33626	113626		
		10	A	33650	113650		
		10	A	33652	113652		
		10	A	33654	113654		
		10	A	33656	113656		
		10	A	33658	113658		
		10	A	33660	113660		
		10	A	33662	113662		
		10	A	33664	113664		
		10	A	33666	113666		
		10	A	33668	113668		
		10	A	33670	113670		
		10	A	33672	113672		
		10	A	33674	113674		
		10	A	33676	113676		
		10	A	33700	113700		
		10	A	33702	113702		
		10	A	33704	113704		
		10	A	33706	113706		
		10	A	33708	113708		
		10	A	33710	113710		
		10	A	33712	113712		
		10	A	33714	113714		
		10	A	33716	113716		
		10	A	33718	113718		
		10	A	33720	113720		
		10	A	33722	113722		
		10	A	33724	113724		
		10	A	33726	113726		
		10	B			77486 150360	
		10	B			79616	
		10	B			77526	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo		Nivel
	10	B	77528	
	10	B	77530	
	10	B	77532	
	10	B	77534	
	10	B	77536	
	10	B	79617	
	10	B	77540	
	10	B	77542	
	10	B	77544	
	10	B	77546	
	10	B	77548	
	10	B	77550	
	10	B	77644	
	10	B	77646	
	10	B	77648	
	10	B	77650	
	10	B	79624	
	10	B	79625	
	10	B	79626	
	10	B	79627	
	10	B	77670	
	10	B	77674	
	10	B	77678	
	10	B	77682	
	10	B	77686	
	10	B	77692	
	10	B	77794	
	10	B	77756	
	10	B	777740	
	10	B	77774	
	10	B	77776	
	10	B	77778	
	10	B	77780	
	10	B	77852	
	10	B	77854	
	10	B	79635	
	10	B*	77902	
	10	B*	79636	
	10	B*	77862	
	10	B**	79816	
	10	B**	79817	
	10	B**	79818	
	10	B**	79819	
	10	B	77864	
	10	B	79637	
	10	B	77872	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		10	B	77878	
		10	B	77882	
		10	B	77886	
		10	B	77890	
		10	B	77894	
		10	B	77898	
		10	B	77960	
		10	B ***	794203	
		10	B ***	794214	
		10	B ***	794215	
		10	B ***	794216	
		10	B ***	794217	
		10	B ***	794218	
		10	B ***	794219	
		10	B ***	794235	
		10	B ***	794236	
		10	B ***	794237	
		10	B ***	794238	
		10	B ***	794239	
		10	B ***	794248	
		10	B ***	794252	
		10	B ***	794262	
		10	B ***	794263	
		10	B ***	794264	
		10	B ***	794265	
		10	B ***	794266	
		10	B ***	794282	
		10	B ***	794283	
		10	B ***	794284	
		10	B ***	794285	
		10	B ***	794286	
		10	B ***	794287	
		10	B ***	794304	
		10	B ***	794305	
		10	B ***	794306	
		10	B ***	794307	
		10	B ***	794308	
		10	B ***	794309	
		10	B ***	794319	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
11	TCT_11	ERROR ID. 11 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES EN ME RC04 (PASIVOS BRUTOS) VS POSICIONES CORTAS RC07 Y RC15 * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ***** Aplica a partir de marzo 2026** ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025	Grave

Dónde:

150370	FILTRO[Clase={10314,10462}] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC07	RC15
11	A	43500		
11	A	43502		
11	A	43504		
11	A	43506		
11	A	43508		
11	A	43510		
11	A	43512		
11	A	43514		
11	A	43516		
11	A	43518		
11	A	43520		
11	A	43522		
11	A	43524		
11	A	43526		
11	A	43550		
11	A	43552		
11	A	43554		
11	A	43556		
11	A	43558		
11	A	43560		
11	A	43562		
11	A	43564		
11	A	43566		
11	A	43568		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	11	A	43570		
	11	A	43572		
	11	A	43574		
	11	A	43576		
	11	A	43600		
	11	A	43602		
	11	A	43604		
	11	A	43606		
	11	A	43608		
	11	A	43610		
	11	A	43612		
	11	A	43614		
	11	A	43616		
	11	A	43618		
	11	A	43620		
	11	A	43622		
	11	A	43624		
	11	A	43626		
	11	A	43650		
	11	A	43652		
	11	A	43654		
	11	A	43656		
	11	A	43658		
	11	A	43660		
	11	A	43662		
	11	A	43664		
	11	A	43666		
	11	A	43668		
	11	A	43670		
	11	A	43672		
	11	A	43674		
	11	A	43676		
	11	A	43700		
	11	A	43702		
	11	A	43704		
	11	A	43706		
	11	A	43708		
	11	A	43710		
	11	A	43712		
	11	A	43714		
	11	A	43716		
	11	A	43718		
	11	A	43720		
	11	A	43722		
	11	A	43724		
	11	A	43726		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	11	B	77970	150370	
	11	B	79643		
	11	B	78010		
	11	B	78012		
	11	B	78014		
	11	B	78016		
	11	B	78018		
	11	B	78020		
	11	B	79644		
	11	B	78024		
	11	B	78026		
	11	B	78028		
	11	B	78030		
	11	B	78032		
	11	B	78034		
	11	B	78128		
	11	B	78130		
	11	B	78132		
	11	B	78134		
	11	B	79651		
	11	B	79652		
	11	B	79653		
	11	B	79654		
	11	B	78154		
	11	B	78158		
	11	B	78162		
	11	B	78166		
	11	B	78170		
	11	B	78176		
	11	B	78278		
	11	B	78240		
	11	B	782580		
	11	B	78258		
	11	B	78260		
	11	B	78262		
	11	B	78264		
	11	B	78336		
	11	B	78338		
	11	B	79662		
	11	B*	78386		
	11	B*	79663		
	11	B*	78346		
	11	B**	79828		
	11	B**	79829		
	11	B**	79830		
	11	B**	79831		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		11	B	78348	
		11	B	79664	
		11	B	78356	
		11	B	78362	
		11	B	78366	
		11	B	78370	
		11	B	78374	
		11	B	78378	
		11	B	78382	
		11	B	78444	
		11	B ***	794323	
		11	B ***	794334	
		11	B ***	794335	
		11	B ***	794336	
		11	B ***	794337	
		11	B ***	794338	
		11	B ***	794339	
		11	B ***	794355	
		11	B ***	794356	
		11	B ***	794357	
		11	B ***	794358	
		11	B ***	794359	
		11	B ***	794368	
		11	B ***	794372	
		11	B ***	794382	
		11	B ***	794383	
		11	B ***	794384	
		11	B ***	794385	
		11	B ***	794386	
		11	B ***	794402	
		11	B ***	794403	
		11	B ***	794404	
		11	B ***	794405	
		11	B ***	794406	
		11	B ***	794407	
		11	B ***	794424	
		11	B ***	794425	
		11	B ***	794426	
		11	B ***	794427	
		11	B ***	794428	
		11	B ***	794429	
		11	B ***	794439	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
12	TCT_12	ERROR ID. 12 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO ENTIDAD EMISORA Y RELACIONADOS, VARIAS OPERACIONES CON OTRO RENDIMIENTO (PASIVOS BRUTOS) VS POSICIONES CORTAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC05	RC07
12	A	55066	
12	A	55079	
12	B		78454
12	B		79670
12	B		78494
12	B		78496
12	B		78498
12	B		78500
12	B		78502
12	B		78504
12	B		79671
12	B		78508
12	B		78510
12	B		78512
12	B		78514
12	B		78516
12	B		78518
12	B		78612
12	B		78614
12	B		78616
12	B		78618
12	B		79678
12	B		79679
12	B		79680
12	B		79681
12	B		78638
12	B		78642
12	B		78646
12	B		78650
12	B		78654

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		12	B	78660	
		12	B	78762	
		12	B	78724	
		12	B	787420	
		12	B	78742	
		12	B	78744	
		12	B	78746	
		12	B	78748	
		12	B	78820	
		12	B	78822	
		12	B	79689	
		12	B*	78870	
		12	B*	79690	
		12	B*	78830	
		12	B**	79840	
		12	B**	79841	
		12	B**	79842	
		12	B**	79843	
		12	B	78832	
		12	B	79691	
		12	B	78840	
		12	B	78846	
		12	B	78850	
		12	B	78854	
		12	B	78858	
		12	B	78862	
		12	B	78866	
		12	B	78928	

Tipo3. Mercado (Activo) vs Mercado (Pasivo)

3.1 Swaps

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
13	TCT_13	ERROR ID. 13 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, SWAPS TASA DE INTERES Y OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS TASA DE INTERES Y OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.16 A** **Con tolerancia de 16%** ***Dónde:***	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
13	A	11926	31050	41926	111080
13	A	11927	31052	41927	111082
13	A	11928	31054	41928	111084
13	A	11929	31056	41929	111086
13	A	11930	31058	41930	111088
13	A	11931	31060	41931	111090
13	A	11932	31062	41932	111092
13	A	11933	31064	41933	111094
13	A	11934	31066	41934	111096
13	A	11935	31068	41935	111098
13	A	11936	31070	41936	111100
13	A	11937	31072	41937	111102
13	A	11938	31074	41938	111104
13	A	11939	31076	41939	111106
13	A	11080	31080	41140	
13	A	11082	31082	41142	
13	A	11084	31084	41144	
13	A	11086	31086	41146	
13	A	11088	31088	41148	
13	A	11090	31090	41150	
13	A	11092	31092	41152	
13	A	11094	31094	41154	
13	A	11096	31096	41156	
13	A	11098	31098	41158	
13	A	11100	31100	41160	
13	A	11102	31102	41162	
13	A	11104	31104	41164	
13	A	11106	31106	41166	
13	A	11110	31110	41170	
13	A	11112	31112	41172	
13	A	11114	31114	41174	
13	A	11116	31116	41176	
13	A	11118	31118	41178	
13	A	11120	31120	41180	
13	A	11122	31122	41182	
13	A	11124	31124	41184	
13	A	11126	31126	41186	
13	A	11128	31128	41188	
13	A	11130	31130	41190	
13	A	11132	31132	41192	
13	A	11134	31134	41194	
13	A	11136	31136	41196	
13	B	15076	34200	45076	114230

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		13	B	15077	34202	45077	114232	
		13	B	15078	34204	45078	114234	
		13	B	15079	34206	45079	114236	
		13	B	15080	34208	45080	114238	
		13	B	15081	34210	45081	114240	
		13	B	15082	34212	45082	114242	
		13	B	15083	34214	45083	114244	
		13	B	15084	34216	45084	114246	
		13	B	15085	34218	45085	114248	
		13	B	15086	34220	45086	114250	
		13	B	15087	34222	45087	114252	
		13	B	15088	34224	45088	114254	
		13	B	15089	34226	45089	114256	
		13	B	14230	34230	44290		
		13	B	14232	34232	44292		
		13	B	14234	34234	44294		
		13	B	14236	34236	44296		
		13	B	14238	34238	44298		
		13	B	14240	34240	44300		
		13	B	14242	34242	44302		
		13	B	14244	34244	44304		
		13	B	14246	34246	44306		
		13	B	14248	34248	44308		
		13	B	14250	34250	44310		
		13	B	14252	34252	44312		
		13	B	14254	34254	44314		
		13	B	14256	34256	44316		
		13	B	14260	34260	44320		
		13	B	14262	34262	44322		
		13	B	14264	34264	44324		
		13	B	14266	34266	44326		
		13	B	14268	34268	44328		
		13	B	14270	34270	44330		
		13	B	14272	34272	44332		
		13	B	14274	34274	44334		
		13	B	14276	34276	44336		
		13	B	14278	34278	44338		
		13	B	14280	34280	44340		
		13	B	14282	34282	44342		
		13	B	14284	34284	44344		
		13	B	14286	34286	44346		
14	TCT_14	ERROR ID. 14 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, SWAPS ACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04, RC05 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04, RC05 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A**						Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
14	A	11896	41896	55010
14	A	11897	41897	55023
14	A	11898	41898	55036
14	A	11899	41899	
14	A	11900	41900	
14	A	11901	41901	
14	A	11902	41902	
14	A	11903	41903	
14	A	11904	41904	
14	A	11905	41905	
14	A	11906	41906	
14	A	11907	41907	
14	A	11908	41908	
14	A	11909	41909	
14	B	15046	45046	55061
14	B	15047	45047	55074
14	B	15048	45048	55087
14	B	15049	45049	
14	B	15050	45050	
14	B	15051	45051	
14	B	15052	45052	
14	B	15053	45053	
14	B	15054	45054	
14	B	15055	45055	
14	B	15056	45056	
14	B	15057	45057	
14	B	15058	45058	
14	B	15059	45059	

15 TCT_15 ERROR ID. 15 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, SWAPS MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04, RC17 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04, RC17 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
15	A	11911	41911	170008
15	A	11912	41912	170016
15	A	11913	41913	170023
15	A	11914	41914	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		15	A	11915	41915		
		15	A	11916	41916		
		15	A	11917	41917		
		15	A	11918	41918		
		15	A	11919	41919		
		15	A	11920	41920		
		15	A	11921	41921		
		15	A	11922	41922		
		15	A	11923	41923		
		15	A	11924	41924		
		15	B	15061	45061	170034	
		15	B	15062	45062	170042	
		15	B	15063	45063	170049	
		15	B	15064	45064		
		15	B	15065	45065		
		15	B	15066	45066		
		15	B	15067	45067		
		15	B	15068	45068		
		15	B	15069	45069		
		15	B	15070	45070		
		15	B	15071	45071		
		15	B	15072	45072		
		15	B	15073	45073		
		15	B	15074	45074		

Contenido

3.2 Futuros

3.2.1 Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
16	TCT_16	ERROR ID. 16 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.23 A** **Con tolerancia de 23%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
16	A		40810
16	A		40812
16	A		40814

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

16	A		40816
16	A		40818
16	A		40820
16	A		40822
16	A		40824
16	A		40826
16	A		40828
16	A		40830
16	A		40832
16	A		40834
16	A		40836
16	B	13930	43960
16	B	13932	43962
16	B	13934	43964
16	B	13936	43966
16	B	13938	43968
16	B	13940	43970
16	B	13942	43972
16	B	13944	43974
16	B	13946	43976
16	B	13948	43978
16	B	13950	43980
16	B	13952	43982
16	B	13954	43984
16	B	13956	43986

17 TCT_17 ERROR ID. 17 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
17	A	10690	30690	40690
17	A	10692	30692	40692
17	A	10694	30694	40694
17	A	10696	30696	40696
17	A	10698	30698	40698
17	A	10700	30700	40700

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		17	A	10702	30702	40702	
		17	A	10704	30704	40704	
		17	A	10706	30706	40706	
		17	A	10708	30708	40708	
		17	A	10710	30710	40710	
		17	A	10712	30712	40712	
		17	A	10714	30714	40714	
		17	A	10716	30716	40716	
		17	A	10990	30990	41050	
		17	A	10992	30992	41052	
		17	A	10994	30994	41054	
		17	A	10996	30996	41056	
		17	A	10998	30998	41058	
		17	A	11000	31000	41060	
		17	A	11002	31002	41062	
		17	A	11004	31004	41064	
		17	A	11006	31006	41066	
		17	A	11008	31008	41068	
		17	A	11010	31010	41070	
		17	A	11012	31012	41072	
		17	A	11014	31014	41074	
		17	A	11016	31016	41076	
		17	B	13840	33840	43840	
		17	B	13842	33842	43842	
		17	B	13844	33844	43844	
		17	B	13846	33846	43846	
		17	B	13848	33848	43848	
		17	B	13850	33850	43850	
		17	B	13852	33852	43852	
		17	B	13854	33854	43854	
		17	B	13856	33856	43856	
		17	B	13858	33858	43858	
		17	B	13860	33860	43860	
		17	B	13862	33862	43862	
		17	B	13864	33864	43864	
		17	B	13866	33866	43866	
		17	B	14140	34140	44200	
		17	B	14142	34142	44202	
		17	B	14144	34144	44204	
		17	B	14146	34146	44206	
		17	B	14148	34148	44208	
		17	B	14150	34150	44210	
		17	B	14152	34152	44212	
		17	B	14154	34154	44214	
		17	B	14156	34156	44216	
		17	B	14158	34158	44218	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

17	B	14160	34160	44220
17	B	14162	34162	44222
17	B	14164	34164	44224
17	B	14166	34166	44226

18 TCT_18 — Grave

ERROR ID. 18 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
18	A	11866	30870	41866
18	A	11867	30872	41867
18	A	11868	30874	41868
18	A	11869	30876	41869
18	A	11870	30878	41870
18	A	11871	30880	41871
18	A	11872	30882	41872
18	A	11873	30884	41873
18	A	11874	30886	41874
18	A	11875	30888	41875
18	A	11876	30890	41876
18	A	11877	30892	41877
18	A	11878	30894	41878
18	A	11879	30896	41879
18	B	15016	34020	45016
18	B	15017	34022	45017
18	B	15018	34024	45018
18	B	15019	34026	45019
18	B	15020	34028	45020
18	B	15021	34030	45021
18	B	15022	34032	45022
18	B	15023	34034	45023
18	B	15024	34036	45024
18	B	15025	34038	45025
18	B	15026	34040	45026
18	B	15027	34042	45027

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

18	B	15028	34044	45028
18	B	15029	34046	45029

19 TCT_19 — Grave

ERROR ID. 19 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA ACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC05 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
19	A			55007
19	A			55020
19	A			55033
19	B	14986	44986	
19	B	14987	44987	
19	B	14988	44988	
19	B	14989	44989	
19	B	14990	44990	
19	B	14991	44991	
19	B	14992	44992	
19	B	14993	44993	
19	B	14994	44994	
19	B	14995	44995	
19	B	14996	44996	
19	B	14997	44997	
19	B	14998	44998	
19	B	14999	44999	

20 TCT_20 — Grave

ERROR ID. 20 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC17 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

20	A			170005
20	A			170013
20	A			170020
20	B	15001	45001	
20	B	15002	45002	
20	B	15003	45003	
20	B	15004	45004	
20	B	15005	45005	
20	B	15006	45006	
20	B	15007	45007	
20	B	15008	45008	
20	B	15009	45009	
20	B	15010	45010	
20	B	15011	45011	
20	B	15012	45012	
20	B	15013	45013	
20	B	15014	45014	

21 TCT_21 ERROR ID. 21 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS COMPRA BONOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01 VS BONOS (PASIVOS BRUTOS)RC01 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
21	A	11440
21	A	11442
21	A	11444
21	A	11446
21	A	11448
21	A	11450
21	A	11452
21	A	11454
21	A	11456
21	A	11458
21	A	11460
21	A	11462
21	A	11464
21	A	11466
21	B	14590
21	B	14592
21	B	14594

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		21	B	14596	
		21	B	14598	
		21	B	14600	
		21	B	14602	
		21	B	14604	
		21	B	14606	
		21	B	14608	
		21	B	14610	
		21	B	14612	
		21	B	14614	
		21	B	14616	

3.2.2 Venta

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
22	TCT_22	ERROR ID. 22 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.23 A** **Con tolerancia de 23%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
22	A	10780	40840
22	A	10782	40842
22	A	10784	40844
22	A	10786	40846
22	A	10788	40848
22	A	10790	40850
22	A	10792	40852
22	A	10794	40854
22	A	10796	40856
22	A	10798	40858
22	A	10800	40860
22	A	10802	40862
22	A	10804	40864
22	A	10806	40866

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

22	B		43990
22	B		43992
22	B		43994
22	B		43996
22	B		43998
22	B		44000
22	B		44002
22	B		44004
22	B		44006
22	B		44008
22	B		44010
22	B		44012
22	B		44014
22	B		44016

23 TCT_23 ERROR ID. 23 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
23	A	10720	30720	40720
23	A	10722	30722	40722
23	A	10724	30724	40724
23	A	10726	30726	40726
23	A	10728	30728	40728
23	A	10730	30730	40730
23	A	10732	30732	40732
23	A	10734	30734	40734
23	A	10736	30736	40736
23	A	10738	30738	40738
23	A	10740	30740	40740
23	A	10742	30742	40742
23	A	10744	30744	40744
23	A	10746	30746	40746
23	A	11020	31020	41080
23	A	11022	31022	41082
23	A	11024	31024	41084

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		23	A	11026	31026	41086	
		23	A	11028	31028	41088	
		23	A	11030	31030	41090	
		23	A	11032	31032	41092	
		23	A	11034	31034	41094	
		23	A	11036	31036	41096	
		23	A	11038	31038	41098	
		23	A	11040	31040	41100	
		23	A	11042	31042	41102	
		23	A	11044	31044	41104	
		23	A	11046	31046	41106	
		23	B	13870	33870	43870	
		23	B	13872	33872	43872	
		23	B	13874	33874	43874	
		23	B	13876	33876	43876	
		23	B	13878	33878	43878	
		23	B	13880	33880	43880	
		23	B	13882	33882	43882	
		23	B	13884	33884	43884	
		23	B	13886	33886	43886	
		23	B	13888	33888	43888	
		23	B	13890	33890	43890	
		23	B	13892	33892	43892	
		23	B	13894	33894	43894	
		23	B	13896	33896	43896	
		23	B	14170	34170	44230	
		23	B	14172	34172	44232	
		23	B	14174	34174	44234	
		23	B	14176	34176	44236	
		23	B	14178	34178	44238	
		23	B	14180	34180	44240	
		23	B	14182	34182	44242	
		23	B	14184	34184	44244	
		23	B	14186	34186	44246	
		23	B	14188	34188	44248	
		23	B	14190	34190	44250	
		23	B	14192	34192	44252	
		23	B	14194	34194	44254	
		23	B	14196	34196	44256	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
24	TCT_24	ERROR ID. 24 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
24	A	11881	30900	41881
24	A	11882	30902	41882
24	A	11883	30904	41883
24	A	11884	30906	41884
24	A	11885	30908	41885
24	A	11886	30910	41886
24	A	11887	30912	41887
24	A	11888	30914	41888
24	A	11889	30916	41889
24	A	11890	30918	41890
24	A	11891	30920	41891
24	A	11892	30922	41892
24	A	11893	30924	41893
24	A	11894	30926	41894
24	B	15031	34050	45031
24	B	15032	34052	45032
24	B	15033	34054	45033
24	B	15034	34056	45034
24	B	15035	34058	45035
24	B	15036	34060	45036
24	B	15037	34062	45037
24	B	15038	34064	45038
24	B	15039	34066	45039
24	B	15040	34068	45040
24	B	15041	34070	45041
24	B	15042	34072	45042
24	B	15043	34074	45043
24	B	15044	34076	45044

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>TCT_25</td><td>ERROR ID. 25 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA ACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS) RC05
Algoritmo:
|A-B| <= 0.15 A
Con tolerancia de 15%
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th><th>RC05</th></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11836</td><td>41836</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11837</td><td>41837</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11838</td><td>41838</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11839</td><td>41839</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11840</td><td>41840</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11841</td><td>41841</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11842</td><td>41842</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11843</td><td>41843</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11844</td><td>41844</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11845</td><td>41845</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11846</td><td>41846</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11847</td><td>41847</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11848</td><td>41848</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>A</td><td>11849</td><td>41849</td><td></td></tr>
<tr><td>25</td><td>B</td><td></td><td></td><td>55058</td></tr>
<tr><td>25</td><td>B</td><td></td><td></td><td>55071</td></tr>
<tr><td>25</td><td>B</td><td></td><td></td><td>55084</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>26</td><td>TCT_26</td><td>ERROR ID. 26 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC017
Algoritmo:
|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%
Dónde:
<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th><th>RC17</th></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11851</td><td>41851</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11852</td><td>41852</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11853</td><td>41853</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11854</td><td>41854</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11855</td><td>41855</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11856</td><td>41856</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11857</td><td>41857</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11858</td><td>41858</td><td></td></tr>
<tr><td>26</td><td>A</td><td>11859</td><td>41859</td><td></td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

26	A	11860	41860	
26	A	11861	41861	
26	A	11862	41862	
26	A	11863	41863	
26	A	11864	41864	
26	B			170031
26	B			170039
26	B			170046

27 TCT_27

ERROR ID. 27 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FUTUROS VENTA BONOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01 VS BONOS (PASIVOS BRUTOS) RC01

NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
27	A	11470
27	A	11472
27	A	11474
27	A	11476
27	A	11478
27	A	11480
27	A	11482
27	A	11484
27	A	11486
27	A	11488
27	A	11490
27	A	11492
27	A	11494
27	A	11496
27	B	14620
27	B	14622
27	B	14624
27	B	14626
27	B	14628
27	B	14630
27	B	14632
27	B	14634
27	B	14636
27	B	14638
27	B	14640
27	B	14642
27	B	14644

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		27	B	14646	

3.3 Forwards

3.3.1 Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
28	TCT_28	ERROR ID. 28 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.25 A** **Con tolerancia de 25%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
28	A		40750
28	A		40752
28	A		40754
28	A		40756
28	A		40758
28	A		40760
28	A		40762
28	A		40764
28	A		40766
28	A		40768
28	A		40770
28	A		40772
28	A		40774
28	A		40776
28	B	13900	43900
28	B	13902	43902
28	B	13904	43904
28	B	13906	43906
28	B	13908	43908
28	B	13910	43910
28	B	13912	43912
28	B	13914	43914

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

28	B	13916	43916
28	B	13918	43918
28	B	13920	43920
28	B	13922	43922
28	B	13924	43924
28	B	13926	43926

29 TCT_29

ERROR ID. 29 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
29	A	10630	30630	40630
29	A	10632	30632	40632
29	A	10634	30634	40634
29	A	10636	30636	40636
29	A	10638	30638	40638
29	A	10640	30640	40640
29	A	10642	30642	40642
29	A	10644	30644	40644
29	A	10646	30646	40646
29	A	10648	30648	40648
29	A	10650	30650	40650
29	A	10652	30652	40652
29	A	10654	30654	40654
29	A	10656	30656	40656
29	A	10930	30930	40990
29	A	10932	30932	40992
29	A	10934	30934	40994
29	A	10936	30936	40996
29	A	10938	30938	40998
29	A	10940	30940	41000
29	A	10942	30942	41002
29	A	10944	30944	41004
29	A	10946	30946	41006
29	A	10948	30948	41008

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

29	A	10950	30950	41010	
29	A	10952	30952	41012	
29	A	10954	30954	41014	
29	A	10956	30956	41016	
29	B	13780	33780	43780	
29	B	13782	33782	43782	
29	B	13784	33784	43784	
29	B	13786	33786	43786	
29	B	13788	33788	43788	
29	B	13790	33790	43790	
29	B	13792	33792	43792	
29	B	13794	33794	43794	
29	B	13796	33796	43796	
29	B	13798	33798	43798	
29	B	13800	33800	43800	
29	B	13802	33802	43802	
29	B	13804	33804	43804	
29	B	13806	33806	43806	
29	B	14080	34080	44140	
29	B	14082	34082	44142	
29	B	14084	34084	44144	
29	B	14086	34086	44146	
29	B	14088	34088	44148	
29	B	14090	34090	44150	
29	B	14092	34092	44152	
29	B	14094	34094	44154	
29	B	14096	34096	44156	
29	B	14098	34098	44158	
29	B	14100	34100	44160	
29	B	14102	34102	44162	
29	B	14104	34104	44164	
29	B	14106	34106	44166	

30 TCT_30 ERROR ID. 30 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.15 A
Con tolerancia de 15%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

30	A	11806	30810	41806	110630
30	A	11807	30812	41807	110632
30	A	11808	30814	41808	110634
30	A	11809	30816	41809	110636
30	A	11810	30818	41810	110638
30	A	11811	30820	41811	110640
30	A	11812	30822	41812	110642
30	A	11813	30824	41813	110644
30	A	11814	30826	41814	110646
30	A	11815	30828	41815	110648
30	A	11816	30830	41816	110650
30	A	11817	30832	41817	110652
30	A	11818	30834	41818	110654
30	A	11819	30836	41819	110656
30	B	14956	33960	44956	113780
30	B	14957	33962	44957	113782
30	B	14958	33964	44958	113784
30	B	14959	33966	44959	113786
30	B	14960	33968	44960	113788
30	B	14961	33970	44961	113790
30	B	14962	33972	44962	113792
30	B	14963	33974	44963	113794
30	B	14964	33976	44964	113796
30	B	14965	33978	44965	113798
30	B	14966	33980	44966	113800
30	B	14967	33982	44967	113802
30	B	14968	33984	44968	113804
30	B	14969	33986	44969	113806

31 TCT_31 ERROR ID. 31 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA ACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC05 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
31	A			55006
31	A			55019
31	A			55032
31	B	14926	44926	
31	B	14927	44927	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

31	B	14928	44928	
31	B	14929	44929	
31	B	14930	44930	
31	B	14931	44931	
31	B	14932	44932	
31	B	14933	44933	
31	B	14934	44934	
31	B	14935	44935	
31	B	14936	44936	
31	B	14937	44937	
31	B	14938	44938	
31	B	14939	44939	

32 TCT_32 ERROR ID. 32 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC17 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
32	A			170004
32	A			170012
32	A			170019
32	B	14941	44941	
32	B	14942	44942	
32	B	14943	44943	
32	B	14944	44944	
32	B	14945	44945	
32	B	14946	44946	
32	B	14947	44947	
32	B	14948	44948	
32	B	14949	44949	
32	B	14950	44950	
32	B	14951	44951	
32	B	14952	44952	
32	B	14953	44953	
32	B	14954	44954	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
33	TCT_33	ERROR ID. 33 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS COMPRA BONOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01 VS BONOS (PASIVOS BRUTOS) RC01 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
33	A	12031
33	A	12032
33	A	12033
33	A	12034
33	A	12035
33	A	12036
33	A	12037
33	A	12038
33	A	12039
33	A	12040
33	A	12041
33	A	12042
33	A	12043
33	A	12044
33	B	15181
33	B	15182
33	B	15183
33	B	15184
33	B	15185
33	B	15186
33	B	15187

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

33	B	15188
33	B	15189
33	B	15190
33	B	15191
33	B	15192
33	B	15193
33	B	15194

3.3.2 Venta

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
34	TCT_34	ERROR ID. 34 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.25 A** **Con tolerancia de 25%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
34	A	10750	40780
34	A	10752	40782
34	A	10754	40784
34	A	10756	40786
34	A	10758	40788
34	A	10760	40790
34	A	10762	40792
34	A	10764	40794
34	A	10766	40796
34	A	10768	40798
34	A	10770	40800
34	A	10772	40802

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

34	A	10774	40804
34	A	10776	40806
34	B		43930
34	B		43932
34	B		43934
34	B		43936
34	B		43938
34	B		43940
34	B		43942
34	B		43944
34	B		43946
34	B		43948
34	B		43950
34	B		43952
34	B		43954
34	B		43956

35 TCT_35 ERROR ID. 35 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
35	A	10660	30660	40660
35	A	10662	30662	40662
35	A	10664	30664	40664
35	A	10666	30666	40666
35	A	10668	30668	40668
35	A	10670	30670	40670
35	A	10672	30672	40672
35	A	10674	30674	40674
35	A	10676	30676	40676
35	A	10678	30678	40678
35	A	10680	30680	40680
35	A	10682	30682	40682

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		35	A	10684	30684	40684	
		35	A	10686	30686	40686	
		35	A	10960	30960	41020	
		35	A	10962	30962	41022	
		35	A	10964	30964	41024	
		35	A	10966	30966	41026	
		35	A	10968	30968	41028	
		35	A	10970	30970	41030	
		35	A	10972	30972	41032	
		35	A	10974	30974	41034	
		35	A	10976	30976	41036	
		35	A	10978	30978	41038	
		35	A	10980	30980	41040	
		35	A	10982	30982	41042	
		35	A	10984	30984	41044	
		35	A	10986	30986	41046	
		35	B	13810	33810	43810	
		35	B	13812	33812	43812	
		35	B	13814	33814	43814	
		35	B	13816	33816	43816	
		35	B	13818	33818	43818	
		35	B	13820	33820	43820	
		35	B	13822	33822	43822	
		35	B	13824	33824	43824	
		35	B	13826	33826	43826	
		35	B	13828	33828	43828	
		35	B	13830	33830	43830	
		35	B	13832	33832	43832	
		35	B	13834	33834	43834	
		35	B	13836	33836	43836	
		35	B	14110	34110	44170	
		35	B	14112	34112	44172	
		35	B	14114	34114	44174	
		35	B	14116	34116	44176	
		35	B	14118	34118	44178	
		35	B	14120	34120	44180	
		35	B	14122	34122	44182	
		35	B	14124	34124	44184	
		35	B	14126	34126	44186	
		35	B	14128	34128	44188	
		35	B	14130	34130	44190	
		35	B	14132	34132	44192	
		35	B	14134	34134	44194	
		35	B	14136	34136	44196	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
36	TCT_36	ERROR ID. 36 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.15 A** **Con tolerancia de 15%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
36	A	11821	30840	41821	110660
36	A	11822	30842	41822	110662
36	A	11823	30844	41823	110664
36	A	11824	30846	41824	110666
36	A	11825	30848	41825	110668
36	A	11826	30850	41826	110670
36	A	11827	30852	41827	110672
36	A	11828	30854	41828	110674
36	A	11829	30856	41829	110676
36	A	11830	30858	41830	110678

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

36	A	11831	30860	41831	110680	
36	A	11832	30862	41832	110682	
36	A	11833	30864	41833	110684	
36	A	11834	30866	41834	110686	
36	B	14971	33990	44971	113810	
36	B	14972	33992	44972	113812	
36	B	14973	33994	44973	113814	
36	B	14974	33996	44974	113816	
36	B	14975	33998	44975	113818	
36	B	14976	34000	44976	113820	
36	B	14977	34002	44977	113822	
36	B	14978	34004	44978	113824	
36	B	14979	34006	44979	113826	
36	B	14980	34008	44980	113828	
36	B	14981	34010	44981	113830	
36	B	14982	34012	44982	113832	
36	B	14983	34014	44983	113834	
36	B	14984	34016	44984	113836	

37 TCT_37

ERROR ID. 37 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA ACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS) RC05

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
37	A	11776	41776	
37	A	11777	41777	
37	A	11778	41778	
37	A	11779	41779	
37	A	11780	41780	
37	A	11781	41781	
37	A	11782	41782	
37	A	11783	41783	
37	A	11784	41784	
37	A	11785	41785	
37	A	11786	41786	
37	A	11787	41787	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

37	A	11788	41788	
37	A	11789	41789	
37	B			55057
37	B			55070
37	B			55083

38 TCT_38 — Grave

ERROR ID. 38 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC17

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
38	A	11791	41791	
38	A	11792	41792	
38	A	11793	41793	
38	A	11794	41794	
38	A	11795	41795	
38	A	11796	41796	
38	A	11797	41797	
38	A	11798	41798	
38	A	11799	41799	
38	A	11800	41800	
38	A	11801	41801	
38	A	11802	41802	
38	A	11803	41803	
38	A	11804	41804	
38	B			170030
38	B			170038
38	B			170045

39 TCT_39 — Grave

ERROR ID. 39 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, FORWARDS VENTA BONOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01 VS BONOS (PASIVOS BRUTOS) RC01

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01
39	A	12046
39	A	12047
39	A	12048

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		39	A	12049	
		39	A	12050	
		39	A	12051	
		39	A	12052	
		39	A	12053	
		39	A	12054	
		39	A	12055	
		39	A	12056	
		39	A	12057	
		39	A	12058	
		39	A	12059	
		39	B	15196	
		39	B	15197	
		39	B	15198	
		39	B	15199	
		39	B	15200	
		39	B	15201	
		39	B	15202	
		39	B	15203	
		39	B	15204	
		39	B	15205	
		39	B	15206	
		39	B	15207	
		39	B	15208	
		39	B	15209	

Contenido

3.4 Reportos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
40	TCT_40	ERROR ID. 40 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, REPORTOS REPORTADOR ACTIVOS BRUTOS RC01,RC04 VS PASIVOS BRUTOS RC01,RC03,RC04,RC11 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.14 A** **Con tolerancia de 14%**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
40	A	10550		40550	
40	A	10552		40552	
40	A	10554		40554	
40	A	10556		40556	
40	A	10558		40558	
40	A	10560		40560	
40	A	10562		40562	
40	A	10564		40564	
40	A	10566		40566	
40	A	10568		40568	
40	A	10570		40570	
40	A	10572		40572	
40	A	10574		40574	
40	A	10576		40576	
40	B	13700	33700	43700	113700
40	B	13702	33702	43702	113702
40	B	13704	33704	43704	113704
40	B	13706	33706	43706	113706
40	B	13708	33708	43708	113708
40	B	13710	33710	43710	113710
40	B	13712	33712	43712	113712
40	B	13714	33714	43714	113714
40	B	13716	33716	43716	113716
40	B	13718	33718	43718	113718
40	B	13720	33720	43720	113720
40	B	13722	33722	43722	113722
40	B	13724	33724	43724	113724
40	B	13726	33726	43726	113726

41	TCT_41	ERROR ID. 41 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, REPORTOS REPORTADO ACTIVOS BRUTOS RC01,RC03,RC04,RC11 VS PASIVOS BRUTOS RC01,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
41	A	10600	30600	40600	110600
41	A	10602	30602	40602	110602
41	A	10604	30604	40604	110604
41	A	10606	30606	40606	110606
41	A	10608	30608	40608	110608
41	A	10610	30610	40610	110610
41	A	10612	30612	40612	110612
41	A	10614	30614	40614	110614
41	A	10616	30616	40616	110616
41	A	10618	30618	40618	110618
41	A	10620	30620	40620	110620
41	A	10622	30622	40622	110622
41	A	10624	30624	40624	110624
41	A	10626	30626	40626	110626
41	B	13750		43750	
41	B	13752		43752	
41	B	13754		43754	
41	B	13756		43756	
41	B	13758		43758	
41	B	13760		43760	
41	B	13762		43762	
41	B	13764		43764	
41	B	13766		43766	
41	B	13768		43768	
41	B	13770		43770	
41	B	13772		43772	
41	B	13774		43774	
41	B	13776		43776	

Contenido

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

3.5 Opciones

3.5.1 Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
42	TCT_42	ERROR ID. 42 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES COMPRA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC04
42	A	421	11200	41260
42	A	421	11202	41262
42	A	421	11204	41264
42	A	421	11206	41266
42	A	421	11208	41268
42	A	421	11210	41270
42	A	421	11212	41272
42	A	421	11214	41274
42	A	421	11216	41276
42	A	421	11218	41278
42	A	421	11220	41280
42	A	421	11222	41282
42	A	421	11224	41284
42	A	421	11226	41286
42	A	421		41560
42	A	421		41562
42	A	421		41564
42	A	421		41566
42	A	421		41568
42	A	421		41570
42	A	421		41572
42	A	421		41574
42	A	421		41576
42	A	421		41578
42	A	421		41580

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		42	A	421		41582	
		42	A	421		41584	
		42	A	421		41586	
		42	B	422	14710	44410	
		42	B	422	14712	44412	
		42	B	422	14714	44414	
		42	B	422	14716	44416	
		42	B	422	14718	44418	
		42	B	422	14720	44420	
		42	B	422	14722	44422	
		42	B	422	14724	44424	
		42	B	422	14726	44426	
		42	B	422	14728	44428	
		42	B	422	14730	44430	
		42	B	422	14732	44432	
		42	B	422	14734	44434	
		42	B	422	14736	44436	
		42	B	422		44710	
		42	B	422		44712	
		42	B	422		44714	
		42	B	422		44716	
		42	B	422		44718	
		42	B	422		44720	
		42	B	422		44722	
		42	B	422		44724	
		42	B	422		44726	
		42	B	422		44728	
		42	B	422		44730	
		42	B	422		44732	
		42	B	422		44734	
		42	B	422		44736	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
43	TCT_43	ERROR ID. 43 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.12 A

Con tolerancia de 12%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC03	RC04
43	A	431	11650	31500	41650
43	A	431	11652	31502	41652
43	A	431	11654	31504	41654
43	A	431	11656	31506	41656
43	A	431	11658	31508	41658
43	A	431	11660	31510	41660
43	A	431	11662	31512	41662
43	A	431	11664	31514	41664
43	A	431	11666	31516	41666
43	A	431	11668	31518	41668
43	A	431	11670	31520	41670
43	A	431	11672	31522	41672
43	A	431	11674	31524	41674
43	A	431	11676	31526	41676
43	A	431	11680	31530	41680
43	A	431	11682	31532	41682
43	A	431	11684	31534	41684
43	A	431	11686	31536	41686
43	A	431	11688	31538	41688
43	A	431	11690	31540	41690
43	A	431	11692	31542	41692
43	A	431	11694	31544	41694
43	A	431	11696	31546	41696
43	A	431	11698	31548	41698
43	A	431	11700	31550	41700
43	A	431	11702	31552	41702
43	A	431	11704	31554	41704
43	A	431	11706	31556	41706
43	A	431	11140	31140	41200

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		43	A	431	11142	31142	41202	
		43	A	431	11144	31144	41204	
		43	A	431	11146	31146	41206	
		43	A	431	11148	31148	41208	
		43	A	431	11150	31150	41210	
		43	A	431	11152	31152	41212	
		43	A	431	11154	31154	41214	
		43	A	431	11156	31156	41216	
		43	A	431	11158	31158	41218	
		43	A	431	11160	31160	41220	
		43	A	431	11162	31162	41222	
		43	A	431	11164	31164	41224	
		43	A	431	11166	31166	41226	
		43	A	431	11530	31410	41500	
		43	A	431	11532	31412	41502	
		43	A	431	11534	31414	41504	
		43	A	431	11536	31416	41506	
		43	A	431	11538	31418	41508	
		43	A	431	11540	31420	41510	
		43	A	431	11542	31422	41512	
		43	A	431	11544	31424	41514	
		43	A	431	11546	31426	41516	
		43	A	431	11548	31428	41518	
		43	A	431	11550	31430	41520	
		43	A	431	11552	31432	41522	
		43	A	431	11554	31434	41524	
		43	A	431	11556	31436	41526	
		43	B	432	14800	34650	44800	
		43	B	432	14802	34652	44802	
		43	B	432	14804	34654	44804	
		43	B	432	14806	34656	44806	
		43	B	432	14808	34658	44808	
		43	B	432	14810	34660	44810	
		43	B	432	14812	34662	44812	
		43	B	432	14814	34664	44814	
		43	B	432	14816	34666	44816	
		43	B	432	14818	34668	44818	
		43	B	432	14820	34670	44820	
		43	B	432	14822	34672	44822	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		43	B	432	14824	34674	44824	
		43	B	432	14826	34676	44826	
		43	B	432	14830	34680	44830	
		43	B	432	14832	34682	44832	
		43	B	432	14834	34684	44834	
		43	B	432	14836	34686	44836	
		43	B	432	14838	34688	44838	
		43	B	432	14840	34690	44840	
		43	B	432	14842	34692	44842	
		43	B	432	14844	34694	44844	
		43	B	432	14846	34696	44846	
		43	B	432	14848	34698	44848	
		43	B	432	14850	34700	44850	
		43	B	432	14852	34702	44852	
		43	B	432	14854	34704	44854	
		43	B	432	14856	34706	44856	
		43	B	432	14290	34290	44350	
		43	B	432	14292	34292	44352	
		43	B	432	14294	34294	44354	
		43	B	432	14296	34296	44356	
		43	B	432	14298	34298	44358	
		43	B	432	14300	34300	44360	
		43	B	432	14302	34302	44362	
		43	B	432	14304	34304	44364	
		43	B	432	14306	34306	44366	
		43	B	432	14308	34308	44368	
		43	B	432	14310	34310	44370	
		43	B	432	14312	34312	44372	
		43	B	432	14314	34314	44374	
		43	B	432	14316	34316	44376	
		43	B	432	14680	34560	44650	
		43	B	432	14682	34562	44652	
		43	B	432	14684	34564	44654	
		43	B	432	14686	34566	44656	
		43	B	432	14688	34568	44658	
		43	B	432	14690	34570	44660	
		43	B	432	14692	34572	44662	
		43	B	432	14694	34574	44664	
		43	B	432	14696	34576	44666	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		43	B	432	14698	34578	44668
		43	B	432	14700	34580	44670
		43	B	432	14702	34582	44672
		43	B	432	14704	34584	44674
		43	B	432	14706	34586	44676

44 TCT_44 ERROR ID. 44 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC05 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05
44	A	441	11971	31200	41971	111140	55011
44	A	441	11972	31202	41972	111142	55024
44	A	441	11973	31204	41973	111144	55037
44	A	441	11974	31206	41974	111146	
44	A	441	11975	31208	41975	111148	
44	A	441	11976	31210	41976	111150	
44	A	441	11977	31212	41977	111152	
44	A	441	11978	31214	41978	111154	
44	A	441	11979	31216	41979	111156	
44	A	441	11980	31218	41980	111158	
44	A	441	11981	31220	41981	111160	
44	A	441	11982	31222	41982	111162	
44	A	441	11983	31224	41983	111164	
44	A	441	11984	31226	41984	111166	
44	A	441	12151	31470	42061		
44	A	441	12152	31472	42062		
44	A	441	12153	31474	42063		
44	A	441	12154	31476	42064		
44	A	441	12155	31478	42065		
44	A	441	12156	31480	42066		
44	A	441	12157	31482	42067		
44	A	441	12158	31484	42068		
44	A	441	12159	31486	42069		
44	A	441	12160	31488	42070		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		44	A	441	12161	31490	42071			
		44	A	441	12162	31492	42072			
		44	A	441	12163	31494	42073			
		44	A	441	12164	31496	42074			
		44	B	442	15121	34380	45121	114290		
		44	B	442	15122	34382	45122	114292		
		44	B	442	15123	34384	45123	114294		
		44	B	442	15124	34386	45124	114296		
		44	B	442	15125	34388	45125	114298		
		44	B	442	15126	34390	45126	114300		
		44	B	442	15127	34392	45127	114302		
		44	B	442	15128	34394	45128	114304		
		44	B	442	15129	34396	45129	114306		
		44	B	442	15130	34398	45130	114308		
		44	B	442	15131	34400	45131	114310		
		44	B	442	15132	34402	45132	114312		
		44	B	442	15133	34404	45133	114314		
		44	B	442	15134	34406	45134	114316		
		44	B	442	15301	34620	45211			
		44	B	442	15302	34622	45212			
		44	B	442	15303	34624	45213			
		44	B	442	15304	34626	45214			
		44	B	442	15305	34628	45215			
		44	B	442	15306	34630	45216			
		44	B	442	15307	34632	45217			
		44	B	442	15308	34634	45218			
		44	B	442	15309	34636	45219			
		44	B	442	15310	34638	45220			
		44	B	442	15311	34640	45221			
		44	B	442	15312	34642	45222			
		44	B	442	15313	34644	45223			
		44	B	442	15314	34646	45224			
45	TCT_45	ERROR ID. 45 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES COMPRAACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04, RC05 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS)RC01, RC04, RC05 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%**								Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN I	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC04	RC05
45	A	451	11941	41941	55009
45	A	451	11942	41942	55022
45	A	451	11943	41943	55035
45	A	451	11944	41944	
45	A	451	11945	41945	
45	A	451	11946	41946	
45	A	451	11947	41947	
45	A	451	11948	41948	
45	A	451	11949	41949	
45	A	451	11950	41950	
45	A	451	11951	41951	
45	A	451	11952	41952	
45	A	451	11953	41953	
45	A	451	11954	41954	
45	B	452	15241	45151	55059
45	B	452	15242	45152	55072
45	B	452	15243	45153	55085
45	B	452	15244	45154	
45	B	452	15245	45155	
45	B	452	15246	45156	
45	B	452	15247	45157	
45	B	452	15248	45158	
45	B	452	15249	45159	
45	B	452	15250	45160	
45	B	452	15251	45161	
45	B	452	15252	45162	
45	B	452	15253	45163	
45	B	452	15254	45164	
45	B	452	15256	45166	
45	B	452	15257	45167	
45	B	452	15258	45168	
45	B	452	15259	45169	
45	B	452	15260	45170	
45	B	452	15261	45171	
45	B	452	15262	45172	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

45	B	452	15263	45173		
45	B	452	15264	45174		
45	B	452	15265	45175		
45	B	452	15266	45176		
45	B	452	15267	45177		
45	B	452	15268	45178		
45	B	452	15269	45179		

46 TCT_46 ERROR ID. 46 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES COMPRAMERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04,RC17 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04,RC17 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
46	A	11956	41956	170007
46	A	11957	41957	170015
46	A	11958	41958	170022
46	A	11959	41959	
46	A	11960	41960	
46	A	11961	41961	
46	A	11962	41962	
46	A	11963	41963	
46	A	11964	41964	
46	A	11965	41965	
46	A	11966	41966	
46	A	11967	41967	
46	A	11968	41968	
46	A	11969	41969	
46	B	15271	45181	170032
46	B	15272	45182	170040
46	B	15273	45183	170047
46	B	15274	45184	
46	B	15275	45185	
46	B	15276	45186	
46	B	15277	45187	
46	B	15278	45188	
46	B	15279	45189	
46	B	15280	45190	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

46	B	15281	45191	
46	B	15282	45192	
46	B	15283	45193	
46	B	15284	45194	

3.5.2 Venta

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
47	TCT_47	ERROR ID. 47 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES VENTA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC04
47	A	471	11560	41530
47	A	471	11562	41532
47	A	471	11564	41534
47	A	471	11566	41536
47	A	471	11568	41538
47	A	471	11570	41540
47	A	471	11572	41542
47	A	471	11574	41544
47	A	471	11576	41546
47	A	471	11578	41548
47	A	471	11580	41550
47	A	471	11582	41552
47	A	471	11584	41554
47	A	471	11586	41556
47	A	471		41290
47	A	471		41292
47	A	471		41294
47	A	471		41296
47	A	471		41298
47	A	471		41300
47	A	471		41302

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		47	A	471		41304	
		47	A	471		41306	
		47	A	471		41308	
		47	A	471		41310	
		47	A	471		41312	
		47	A	471		41314	
		47	A	471		41316	
		47	B	472	14350	44440	
		47	B	472	14352	44442	
		47	B	472	14354	44444	
		47	B	472	14356	44446	
		47	B	472	14358	44448	
		47	B	472	14360	44450	
		47	B	472	14362	44452	
		47	B	472	14364	44454	
		47	B	472	14366	44456	
		47	B	472	14368	44458	
		47	B	472	14370	44460	
		47	B	472	14372	44462	
		47	B	472	14374	44464	
		47	B	472	14376	44466	
		47	B	472		44680	
		47	B	472		44682	
		47	B	472		44684	
		47	B	472		44686	
		47	B	472		44688	
		47	B	472		44690	
		47	B	472		44692	
		47	B	472		44694	
		47	B	472		44696	
		47	B	472		44698	
		47	B	472		44700	
		47	B	472		44702	
		47	B	472		44704	
		47	B	472		44706	
48	TCT_48	ERROR ID. 48 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES VENTA TASA INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.24 A**					Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Con tolerancia de 24%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC03	RC04
48	A	481	11710	31560	41710
48	A	481	11712	31562	41712
48	A	481	11714	31564	41714
48	A	481	11716	31566	41716
48	A	481	11718	31568	41718
48	A	481	11720	31570	41720
48	A	481	11722	31572	41722
48	A	481	11724	31574	41724
48	A	481	11726	31576	41726
48	A	481	11728	31578	41728
48	A	481	11730	31580	41730
48	A	481	11732	31582	41732
48	A	481	11734	31584	41734
48	A	481	11736	31586	41736
48	A	481	11740	31590	41740
48	A	481	11742	31592	41742
48	A	481	11744	31594	41744
48	A	481	11746	31596	41746
48	A	481	11748	31598	41748
48	A	481	11750	31600	41750
48	A	481	11752	31602	41752
48	A	481	11754	31604	41754
48	A	481	11756	31606	41756
48	A	481	11758	31608	41758
48	A	481	11760	31610	41760
48	A	481	11762	31612	41762
48	A	481	11764	31614	41764
48	A	481	11766	31616	41766
48	A	481	11170	31170	41230
48	A	481	11172	31172	41232
48	A	481	11174	31174	41234
48	A	481	11176	31176	41236
48	A	481	11178	31178	41238
48	A	481	11180	31180	41240
48	A	481	11182	31182	41242
48	A	481	11184	31184	41244
48	A	481	11186	31186	41246
48	A	481	11188	31188	41248
48	A	481	11190	31190	41250
48	A	481	11192	31192	41252

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		48	A	481	11194	31194	41254	
		48	A	481	11196	31196	41256	
		48	A	481	11500	31380	41470	
		48	A	481	11502	31382	41472	
		48	A	481	11504	31384	41474	
		48	A	481	11506	31386	41476	
		48	A	481	11508	31388	41478	
		48	A	481	11510	31390	41480	
		48	A	481	11512	31392	41482	
		48	A	481	11514	31394	41484	
		48	A	481	11516	31396	41486	
		48	A	481	11518	31398	41488	
		48	A	481	11520	31400	41490	
		48	A	481	11522	31402	41492	
		48	A	481	11524	31404	41494	
		48	A	481	11526	31406	41496	
		48	B	482	14320	34320	44380	
		48	B	482	14322	34322	44382	
		48	B	482	14324	34324	44384	
		48	B	482	14326	34326	44386	
		48	B	482	14328	34328	44388	
		48	B	482	14330	34330	44390	
		48	B	482	14332	34332	44392	
		48	B	482	14334	34334	44394	
		48	B	482	14336	34336	44396	
		48	B	482	14338	34338	44398	
		48	B	482	14340	34340	44400	
		48	B	482	14342	34342	44402	
		48	B	482	14344	34344	44404	
		48	B	482	14346	34346	44406	
		48	B	482	14650	34530	44620	
		48	B	482	14652	34532	44622	
		48	B	482	14654	34534	44624	
		48	B	482	14656	34536	44626	
		48	B	482	14658	34538	44628	
		48	B	482	14660	34540	44630	
		48	B	482	14662	34542	44632	
		48	B	482	14664	34544	44634	
		48	B	482	14666	34546	44636	
		48	B	482	14668	34548	44638	
		48	B	482	14670	34550	44640	
		48	B	482	14672	34552	44642	
		48	B	482	14674	34554	44644	
		48	B	482	14676	34556	44646	
		48	B	482	14860	34710	44860	
		48	B	482	14862	34712	44862	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		48	B	482	14864	34714	44864	
		48	B	482	14866	34716	44866	
		48	B	482	14868	34718	44868	
		48	B	482	14870	34720	44870	
		48	B	482	14872	34722	44872	
		48	B	482	14874	34724	44874	
		48	B	482	14876	34726	44876	
		48	B	482	14878	34728	44878	
		48	B	482	14880	34730	44880	
		48	B	482	14882	34732	44882	
		48	B	482	14884	34734	44884	
		48	B	482	14886	34736	44886	
		48	B	482	14890	34740	44890	
		48	B	482	14892	34742	44892	
		48	B	482	14894	34744	44894	
		48	B	482	14896	34746	44896	
		48	B	482	14898	34748	44898	
		48	B	482	14900	34750	44900	
		48	B	482	14902	34752	44902	
		48	B	482	14904	34754	44904	
		48	B	482	14906	34756	44906	
		48	B	482	14908	34758	44908	
		48	B	482	14910	34760	44910	
		48	B	482	14912	34762	44912	
		48	B	482	14914	34764	44914	
		48	B	482	14916	34766	44916	

49 TCT_49

ERROR ID. 49 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11

Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.15 A
Con tolerancia de 15%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05
49	A	491	11986	31260	41986	111170	
49	A	491	11987	31262	41987	111172	
49	A	491	11988	31264	41988	111174	
49	A	491	11989	31266	41989	111176	
49	A	491	11990	31268	41990	111178	
49	A	491	11991	31270	41991	111180	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	49	A	491	11992	31272	41992	111182			
	49	A	491	11993	31274	41993	111184			
	49	A	491	11994	31276	41994	111186			
	49	A	491	11995	31278	41995	111188			
	49	A	491	11996	31280	41996	111190			
	49	A	491	11997	31282	41997	111192			
	49	A	491	11998	31284	41998	111194			
	49	A	491	11999	31286	41999	111196			
	49	A	491	12136	31440	42046				
	49	A	491	12137	31442	42047				
	49	A	491	12138	31444	42048				
	49	A	491	12139	31446	42049				
	49	A	491	12140	31448	42050				
	49	A	491	12141	31450	42051				
	49	A	491	12142	31452	42052				
	49	A	491	12143	31454	42053				
	49	A	491	12144	31456	42054				
	49	A	491	12145	31458	42055				
	49	A	491	12146	31460	42056				
	49	A	491	12147	31462	42057				
	49	A	491	12148	31464	42058				
	49	A	491	12149	31466	42059				
	49	B	492	15136	34410	45136	114320	55062		
	49	B	492	15137	34412	45137	114322	55075		
	49	B	492	15138	34414	45138	114324	55088		
	49	B	492	15139	34416	45139	114326			
	49	B	492	15140	34418	45140	114328			
	49	B	492	15141	34420	45141	114330			
	49	B	492	15142	34422	45142	114332			
	49	B	492	15143	34424	45143	114334			
	49	B	492	15144	34426	45144	114336			
	49	B	492	15145	34428	45145	114338			
	49	B	492	15146	34430	45146	114340			
	49	B	492	15147	34432	45147	114342			
	49	B	492	15148	34434	45148	114344			
	49	B	492	15149	34436	45149	114346			
	49	B	492	15286	34590	45196				
	49	B	492	15287	34592	45197				
	49	B	492	15288	34594	45198				
	49	B	492	15289	34596	45199				
	49	B	492	15290	34598	45200				
	49	B	492	15291	34600	45201				
	49	B	492	15292	34602	45202				
	49	B	492	15293	34604	45203				
	49	B	492	15294	34606	45204				
	49	B	492	15295	34608	45205				

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

49	B	492	15296	34610	45206			
49	B	492	15297	34612	45207			
49	B	492	15298	34614	45208			
49	B	492	15299	34616	45209			

50 TCT_50 ERROR ID. 50 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES VENTAACCIONES (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04,RC05 VS ACCIONES (PASIVOS BRUTOS)RC01, RC04,RC05 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%
Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
50	A	12091	42001	55008
50	A	12092	42002	55021
50	A	12093	42003	55034
50	A	12094	42004	
50	A	12095	42005	
50	A	12096	42006	
50	A	12097	42007	
50	A	12098	42008	
50	A	12099	42009	
50	A	12100	42010	
50	A	12101	42011	
50	A	12102	42012	
50	A	12103	42013	
50	A	12104	42014	
50	A	12106	42016	
50	A	12107	42017	
50	A	12108	42018	
50	A	12109	42019	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		50	A	12110	42020		
		50	A	12111	42021		
		50	A	12112	42022		
		50	A	12113	42023		
		50	A	12114	42024		
		50	A	12115	42025		
		50	A	12116	42026		
		50	A	12117	42027		
		50	A	12118	42028		
		50	A	12119	42029		
		50	B	15091	45091	55060	
		50	B	15092	45092	55073	
		50	B	15093	45093	55086	
		50	B	15094	45094		
		50	B	15095	45095		
		50	B	15096	45096		
		50	B	15097	45097		
		50	B	15098	45098		
		50	B	15099	45099		
		50	B	15100	45100		
		50	B	15101	45101		
		50	B	15102	45102		
		50	B	15103	45103		
		50	B	15104	45104		
51	TCT_51	ERROR ID. 51 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, OPCIONES VENTAMERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01, RC04,RC17 VS MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01, RC04,RC17 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***					Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
51	A	12121	42031	170006
51	A	12122	42032	170014
51	A	12123	42033	170021
51	A	12124	42034	
51	A	12125	42035	
51	A	12126	42036	
51	A	12127	42037	
51	A	12128	42038	
51	A	12129	42039	
51	A	12130	42040	
51	A	12131	42041	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

51	A	12132	42042	
51	A	12133	42043	
51	A	12134	42044	
51	B	15106	45106	170033
51	B	15107	45107	170041
51	B	15108	45108	170048
51	B	15109	45109	
51	B	15110	45110	
51	B	15111	45111	
51	B	15112	45112	
51	B	15113	45113	
51	B	15114	45114	
51	B	15115	45115	
51	B	15116	45116	
51	B	15117	45117	
51	B	15118	45118	
51	B	15119	45119	

3.6 Operaciones de Compra y Venta

3.6.1 Divisas

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
52	TCT_52	ERROR ID. 52 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, COMPRA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.15 A** **Con tolerancia de 15%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
52	A		40195
52	B	13240	43195

53	TCT_53	ERROR ID. 53 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, VENTA DIVISAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVOS BRUTOS) RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.15 A** **Con tolerancia de 15%**	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
53	A	10195	40197
53	B		43197

3.6.2 Títulos de Deuda

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
54	TCT_54	ERROR ID. 54 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, COMPRA FECHA VALOR TITULOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS DINERO (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04	Grave
55	TCT_55	ERROR ID. 55 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, VENTA FECHA VALOR DINERO (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS TITULOS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
54	A	10300	30300	40300	110300
54	A	10302	30302	40302	110302
54	A	10304	30304	40304	110304
54	A	10306	30306	40306	110306
54	A	10308	30308	40308	110308
54	A	10310	30310	40310	110310
54	A	10312	30312	40312	110312
54	A	10314	30314	40314	110314
54	A	10316	30316	40316	110316
54	A	10318	30318	40318	110318
54	A	10320	30320	40320	110320
54	A	10322	30322	40322	110322
54	A	10324	30324	40324	110324
54	A	10326	30326	40326	110326
54	B	13400		43400	
54	B	13402		43402	

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
55	A	10200		40200	
55	A	10202		40212	
55	B	13500	33500	43500	113500
55	B	13502	33502	43502	113502
55	B	13504	33504	43504	113504
55	B	13506	33506	43506	113506
55	B	13508	33508	43508	113508
55	B	13510	33510	43510	113510
55	B	13512	33512	43512	113512
55	B	13514	33514	43514	113514
55	B	13516	33516	43516	113516
55	B	13518	33518	43518	113518
55	B	13520	33520	43520	113520
55	B	13522	33522	43522	113522
55	B	13524	33524	43524	113524
55	B	13526	33526	43526	113526

3.6.3 Acciones

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
56	TCT_56	ERROR ID. 56 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, ACCIONES COMPRA ACCIONES (VALORES) A RECIBIR RC05 VS DINERO A ENTREGAR RC01,RC04	Grave
57	TCT_57	ERROR ID. 57 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, ACCIONES VENTA DINERO A RECIBIR RC01,RC04 VS ACCIONES (VALORES) A ENTREGAR RC05	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.155 A

Con tolerancia de 15.5%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
56	A			55002
56	A			55015
56	A			55028
56	B	14921	44921	
56	B	14922	44922	

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.33 A

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Con tolerancia de 33%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
57	A	11771	41771	
57	A	11772	41772	
57	B			55054
57	B			55066
57	B			55079

3.6.4 Mercancías

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
58	TCT_58	ERROR ID. 58 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, MERCANCIAS COMPRA MERCANCIAS (PLATA Y OTRAS) A RECIBIR RC17 VS DINERO A ENTREGAR RC01,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
58	A			170002
58	A			170003
58	B	14924	44924	

59	TCT_59	ERROR ID. 59 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO, MERCANCIAS VENTA DINERO A RECIBIR RC01,RC04 VS MERCANCIAS (PLATA Y OTRAS) A ENTREGAR RC017	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17
59	A	11774	41774	
59	B			170028
59	B			170029

Tipo4. Mercado vs Crédito (Contraparte)

4.1 Reportos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
60	TCT_60	ERROR ID. 60 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),REPORTO TÍTULOS A RECIBIR REPORTADO (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15	NO Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde

600040	FILTRO[Clase=10316] sum [ImporteA]
150040	FILTRO[Clase=10316] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
60	A	10600	30600	40600	110600		
60	A	10602	30602	40602	110602		
60	A	10604	30604	40604	110604		
60	A	10606	30606	40606	110606		
60	A	10608	30608	40608	110608		
60	A	10610	30610	40610	110610		
60	A	10612	30612	40612	110612		
60	A	10614	30614	40614	110614		
60	A	10616	30616	40616	110616		
60	A	10618	30618	40618	110618		
60	A	10620	30620	40620	110620		
60	A	10622	30622	40622	110622		
60	A	10624	30624	40624	110624		
60	A	10626	30626	40626	110626		
60	B					600040	150040

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
61	TCT_61	ERROR ID. 61 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),REPORTO TÍTULOS A ENTREGAR REPORTADOR (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15	NO Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600070	FILTRO[Clase=10317] sum [ImporteP]
150070	FILTRO[Clase=10317] sum [ImportePO]

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
61	A	13700	33700	43700	113700		
61	A	13702	33702	43702	113702		
61	A	13704	33704	43704	113704		
61	A	13706	33706	43706	113706		
61	A	13708	33708	43708	113708		
61	A	13710	33710	43710	113710		
61	A	13712	33712	43712	113712		
61	A	13714	33714	43714	113714		
61	A	13716	33716	43716	113716		
61	A	13718	33718	43718	113718		
61	A	13720	33720	43720	113720		
61	A	13722	33722	43722	113722		
61	A	13724	33724	43724	113724		
61	A	13726	33726	43726	113726		
61	B					600070	150070

62 TCT_62 ERROR ID. 62 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),REPORTO DINERO A RECIBIR REPORTADOR (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS RC06 Y RC15 — NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600060	FILTRO[Clase=10317] sum [ImporteA]
150060	FILTRO[Clase=10317] sum [Importe]

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06	RC15
62	A	10550	40550		
62	A	10552	40552		
62	A	10554	40554		
62	A	10556	40556		
62	A	10558	40558		
62	A	10560	40560		
62	A	10562	40562		
62	A	10564	40564		
62	A	10566	40566		
62	A	10568	40568		
62	A	10570	40570		
62	A	10572	40572		
62	A	10574	40574		
62	A	10576	40576		
62	B			600060	150060

63 TCT_63 ERROR ID. 63 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),REPORTO DINERO A ENTREGAR REPORTADO (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS RC06 Y RC15 — NO Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600050	FILTRO[Clase=10316] sum [ImporteP]
150050	FILTRO[Clase=10316] sum [ImportePO]

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06	RC15
63	A	13750	43750		
63	A	13752	43752		
63	A	13754	43754		
63	A	13756	43756		
63	A	13758	43758		
63	A	13760	43760		
63	A	13762	43762		
63	A	13764	43764		
63	A	13766	43766		
63	A	13768	43768		
63	A	13770	43770		
63	A	13772	43772		
63	A	13774	43774		
63	A	13776	43776		
63	B			600050	150050

4.2 Swaps

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
64	TCT_64	ERROR ID. 64 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS TASAS DE INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

600220	FILTRO[Clase=104051] sum [ImporteA]
150220	FILTRO[Clase=104051] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
64	A	11080	31080	41140	111080		
64	A	11082	31082	41142	111082		
64	A	11084	31084	41144	111084		
64	A	11086	31086	41146	111086		
64	A	11088	31088	41148	111088		
64	A	11090	31090	41150	111090		
64	A	11092	31092	41152	111092		
64	A	11094	31094	41154	111094		
64	A	11096	31096	41156	111096		
64	A	11098	31098	41158	111098		
64	A	11100	31100	41160	111100		
64	A	11102	31102	41162	111102		
64	A	11104	31104	41164	111104		
64	A	11106	31106	41166	111106		
64	A	11110	31110	41170			
64	A	11112	31112	41172			
64	A	11114	31114	41174			
64	A	11116	31116	41176			
64	A	11118	31118	41178			
64	A	11120	31120	41180			
64	A	11122	31122	41182			
64	A	11124	31124	41184			
64	A	11126	31126	41186			
64	A	11128	31128	41188			
64	A	11130	31130	41190			
64	A	11132	31132	41192			
64	A	11134	31134	41194			
64	A	11136	31136	41196			
64	B					600220	150220

65	TCT_65	ERROR ID. 65 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS TASAS DE INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

600230	FILTRO[Clase=104051] sum [ImporteP]
150230	FILTRO[Clase=104051] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
65	A	14230	34230	44290	114230		
65	A	14232	34232	44292	114232		
65	A	14234	34234	44294	114234		
65	A	14236	34236	44296	114236		
65	A	14238	34238	44298	114238		
65	A	14240	34240	44300	114240		
65	A	14242	34242	44302	114242		
65	A	14244	34244	44304	114244		
65	A	14246	34246	44306	114246		
65	A	14248	34248	44308	114248		
65	A	14250	34250	44310	114250		
65	A	14252	34252	44312	114252		
65	A	14254	34254	44314	114254		
65	A	14256	34256	44316	114256		
65	A	14260	34260	44320			
65	A	14262	34262	44322			
65	A	14264	34264	44324			
65	A	14266	34266	44326			
65	A	14268	34268	44328			
65	A	14270	34270	44330			
65	A	14272	34272	44332			
65	A	14274	34274	44334			
65	A	14276	34276	44336			
65	A	14278	34278	44338			
65	A	14280	34280	44340			
65	A	14282	34282	44342			
65	A	14284	34284	44344			
65	A	14286	34286	44346			
65	B					600230	150230

66	TCT_66	ERROR ID. 66 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS ACCIONES E ÍNDICES ACCIONARIOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC05 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%
Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

600260	FILTRO[Clase=104053] sum [ImporteA]
150260	FILTRO[Clase=104053] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05	RC06	RC15
66	A	11896	41896	55010		
66	A	11897	41897	55023		
66	A	11898	41898	55036		
66	A	11899	41899			
66	A	11900	41900			
66	A	11901	41901			
66	A	11902	41902			
66	A	11903	41903			
66	A	11904	41904			
66	A	11905	41905			
66	A	11906	41906			
66	A	11907	41907			
66	A	11908	41908			
66	A	11909	41909			
66	B				600260	150260

67	TCT_67	ERROR ID. 67 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS ACCIONES E ÍNDICES ACCIONARIOS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC05 VS RC06 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

600270	FILTRO[Clase=104053] sum [ImporteP]
150270	FILTRO[Clase=104053] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05	RC06	RC15
67	A	15046	45046	55061		
67	A	15047	45047	55074		
67	A	15048	45048	55087		
67	A	15049	45049			
67	A	15050	45050			
67	A	15051	45051			
67	A	15052	45052			
67	A	15053	45053			
67	A	15054	45054			
67	A	15055	45055			
67	A	15056	45056			
67	A	15057	45057			
67	A	15058	45058			
67	A	15059	45059			
67	B				600270	150270

68	TCT_68	ERROR ID. 68 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS METALES PRECIOSOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC17 VS RC06 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%**	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

600280	FILTRO[Clase=104054] sum [ImporteA]
150280	FILTRO[Clase=104054] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17	RC06	RC15
68	A	11911	41911	170008		
68	A	11912	41912	170016		
68	A	11913	41913	170023		
68	A	11914	41914			
68	A	11915	41915			
68	A	11916	41916			
68	A	11917	41917			
68	A	11918	41918			
68	A	11919	41919			
68	A	11920	41920			
68	A	11921	41921			
68	A	11922	41922			
68	A	11923	41923			
68	A	11924	41924			
68	B				600280	150280

69	TCT_69	ERROR ID. 69 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS METALES PRECIOSOS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC17 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

600290	FILTRO[Clase=104054] sum [ImporteP]
150290	FILTRO[Clase=104054] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17	RC06	RC15
69	A	15061	45061	170034		
69	A	15062	45062	170042		
69	A	15063	45063	170049		
69	A	15064	45064			
69	A	15065	45065			
69	A	15066	45066			
69	A	15067	45067			
69	A	15068	45068			
69	A	15069	45069			
69	A	15070	45070			
69	A	15071	45071			
69	A	15072	45072			
69	A	15073	45073			
69	A	15074	45074			
69	B				600290	150290

70	TCT_70	ERROR ID. 70 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Dónde:

600300	FILTRO[Clase=104055] sum [ImporteA]
150300	FILTRO[Clase=104055] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06	RC15
70	A	11926	31050	41926		
70	A	11927	31052	41927		
70	A	11928	31054	41928		
70	A	11929	31056	41929		
70	A	11930	31058	41930		
70	A	11931	31060	41931		
70	A	11932	31062	41932		
70	A	11933	31064	41933		
70	A	11934	31066	41934		
70	A	11935	31068	41935		
70	A	11936	31070	41936		
70	A	11937	31072	41937		
70	A	11938	31074	41938		
70	A	11939	31076	41939		
70	B				600300	150300

71	TCT_71	ERROR ID. 71 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS RC06 Y RC15 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

600310	FILTRO[Clase=104055] sum [ImporteP]
150310	FILTRO[Clase=104055] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06	RC15
71	A	15076	34200	45076		
71	A	15077	34202	45077		
71	A	15078	34204	45078		
71	A	15079	34206	45079		
71	A	15080	34208	45080		
71	A	15081	34210	45081		
71	A	15082	34212	45082		
71	A	15083	34214	45083		
71	A	15084	34216	45084		
71	A	15085	34218	45085		
71	A	15086	34220	45086		
71	A	15087	34222	45087		
71	A	15088	34224	45088		
71	A	15089	34226	45089		
71	B				600310	150310

4.3 Futuros y Forwards Compra y Venta

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
72	TCT_72	ERROR ID. 72 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA DIVISAS Y ORO (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS RC06 Y RC15 ***Algoritmo***:	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600120	FILTRO[Clase=10402] sum [ImporteA]
150120	FILTRO[Clase=10402] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06	RC15
72	A	10750	40750		
72	A	10752	40752		
72	A	10754	40754		
72	A	10756	40756		
72	A	10758	40758		
72	A	10760	40760		
72	A	10762	40762		
72	A	10764	40764		
72	A	10766	40766		
72	A	10768	40768		
72	A	10770	40770		
72	A	10772	40772		
72	A	10774	40774		
72	A	10776	40776		
72	A	10780	40780		
72	A	10782	40782		
72	A	10784	40784		
72	A	10786	40786		
72	A	10788	40788		
72	A	10790	40790		
72	A	10792	40792		
72	A	10794	40794		
72	A	10796	40796		
72	A	10798	40798		
72	A	10800	40800		
72	A	10802	40802		
72	A	10804	40804		
72	A	10806	40806		
72	A		40840		
72	A		40842		
72	A		40844		
72	A		40846		
72	A		40848		
72	A		40850		
72	A		40852		
72	A		40854		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		72	A		40856		
		72	A		40858		
		72	A		40860		
		72	A		40862		
		72	A		40864		
		72	A		40866		
		72	A		40810		
		72	A		40812		
		72	A		40814		
		72	A		40816		
		72	A		40818		
		72	A		40820		
		72	A		40822		
		72	A		40824		
		72	A		40826		
		72	A		40828		
		72	A		40830		
		72	A		40832		
		72	A		40834		
		72	A		40836		
		72	B			600120	150120

73 TCT_73

ERROR ID. 73 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA DIVISAS Y ORO (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04 VS RC06 Y RC15

NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600130	FILTRO[Clase=10402] sum [ImporteP]
150130	FILTRO[Clase=10402] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06	RC15
73	A	13900	43900		
73	A	13902	43902		
73	A	13904	43904		
73	A	13906	43906		
73	A	13908	43908		
73	A	13910	43910		
73	A	13912	43912		
73	A	13914	43914		
73	A	13916	43916		
73	A	13918	43918		
73	A	13920	43920		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		73	A	13922	43922			
		73	A	13924	43924			
		73	A	13926	43926			
		73	A	13930	43930			
		73	A	13932	43932			
		73	A	13934	43934			
		73	A	13936	43936			
		73	A	13938	43938			
		73	A	13940	43940			
		73	A	13942	43942			
		73	A	13944	43944			
		73	A	13946	43946			
		73	A	13948	43948			
		73	A	13950	43950			
		73	A	13952	43952			
		73	A	13954	43954			
		73	A	13956	43956			
		73	A		43960			
		73	A		43962			
		73	A		43964			
		73	A		43966			
		73	A		43968			
		73	A		43970			
		73	A		43972			
		73	A		43974			
		73	A		43976			
		73	A		43978			
		73	A		43980			
		73	A		43982			
		73	A		43984			
		73	A		43986			
		73	A		43990			
		73	A		43992			
		73	A		43994			
		73	A		43996			
		73	A		43998			
		73	A		44000			
		73	A		44002			
		73	A		44004			
		73	A		44006			
		73	A		44008			
		73	A		44010			
		73	A		44012			
		73	A		44014			
		73	A		44016			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		73	B			600130	150130

74 TCT_74

ERROR ID. 74 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA TASAS DE INTERÉS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS RC06 Y RC15

NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600140	FILTRO[Clase=10403] sum [ImporteA]
150140	FILTRO[Clase=10403] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06	RC15
74	A	10630	30630	40630		
74	A	10632	30632	40632		
74	A	10634	30634	40634		
74	A	10636	30636	40636		
74	A	10638	30638	40638		
74	A	10640	30640	40640		
74	A	10642	30642	40642		
74	A	10644	30644	40644		
74	A	10646	30646	40646		
74	A	10648	30648	40648		
74	A	10650	30650	40650		
74	A	10652	30652	40652		
74	A	10654	30654	40654		
74	A	10656	30656	40656		
74	A	10660	30660	40660		
74	A	10662	30662	40662		
74	A	10664	30664	40664		
74	A	10666	30666	40666		
74	A	10668	30668	40668		
74	A	10670	30670	40670		
74	A	10672	30672	40672		
74	A	10674	30674	40674		
74	A	10676	30676	40676		
74	A	10678	30678	40678		
74	A	10680	30680	40680		
74	A	10682	30682	40682		
74	A	10684	30684	40684		
74	A	10686	30686	40686		
74	A	10690	30690	40690		
74	A	10692	30692	40692		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		74	A	10694	30694	40694			
		74	A	10696	30696	40696			
		74	A	10698	30698	40698			
		74	A	10700	30700	40700			
		74	A	10702	30702	40702			
		74	A	10704	30704	40704			
		74	A	10706	30706	40706			
		74	A	10708	30708	40708			
		74	A	10710	30710	40710			
		74	A	10712	30712	40712			
		74	A	10714	30714	40714			
		74	A	10716	30716	40716			
		74	A	10720	30720	40720			
		74	A	10722	30722	40722			
		74	A	10724	30724	40724			
		74	A	10726	30726	40726			
		74	A	10728	30728	40728			
		74	A	10730	30730	40730			
		74	A	10732	30732	40732			
		74	A	10734	30734	40734			
		74	A	10736	30736	40736			
		74	A	10738	30738	40738			
		74	A	10740	30740	40740			
		74	A	10742	30742	40742			
		74	A	10744	30744	40744			
		74	A	10746	30746	40746			
		74	A	10930	30930	40990			
		74	A	10932	30932	40992			
		74	A	10934	30934	40994			
		74	A	10936	30936	40996			
		74	A	10938	30938	40998			
		74	A	10940	30940	41000			
		74	A	10942	30942	41002			
		74	A	10944	30944	41004			
		74	A	10946	30946	41006			
		74	A	10948	30948	41008			
		74	A	10950	30950	41010			
		74	A	10952	30952	41012			
		74	A	10954	30954	41014			
		74	A	10956	30956	41016			
		74	A	10960	30960	41020			
		74	A	10962	30962	41022			
		74	A	10964	30964	41024			
		74	A	10966	30966	41026			
		74	A	10968	30968	41028			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		74	A	10970	30970	41030			
		74	A	10972	30972	41032			
		74	A	10974	30974	41034			
		74	A	10976	30976	41036			
		74	A	10978	30978	41038			
		74	A	10980	30980	41040			
		74	A	10982	30982	41042			
		74	A	10984	30984	41044			
		74	A	10986	30986	41046			
		74	A	10990	30990	41050			
		74	A	10992	30992	41052			
		74	A	10994	30994	41054			
		74	A	10996	30996	41056			
		74	A	10998	30998	41058			
		74	A	11000	31000	41060			
		74	A	11002	31002	41062			
		74	A	11004	31004	41064			
		74	A	11006	31006	41066			
		74	A	11008	31008	41068			
		74	A	11010	31010	41070			
		74	A	11012	31012	41072			
		74	A	11014	31014	41074			
		74	A	11016	31016	41076			
		74	A	11020	31020	41080			
		74	A	11022	31022	41082			
		74	A	11024	31024	41084			
		74	A	11026	31026	41086			
		74	A	11028	31028	41088			
		74	A	11030	31030	41090			
		74	A	11032	31032	41092			
		74	A	11034	31034	41094			
		74	A	11036	31036	41096			
		74	A	11038	31038	41098			
		74	A	11040	31040	41100			
		74	A	11042	31042	41102			
		74	A	11044	31044	41104			
		74	A	11046	31046	41106			
		74	A	11380					
		74	A	11382					
		74	A	11384					
		74	A	11386					
		74	A	11388					
		74	A	11390					
		74	A	11392					
		74	A	11394					

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		74	A	11396					
		74	A	11398					
		74	A	11400					
		74	A	11402					
		74	A	11404					
		74	A	11406					
		74	A	11410					
		74	A	11412					
		74	A	11414					
		74	A	11416					
		74	A	11418					
		74	A	11420					
		74	A	11422					
		74	A	11424					
		74	A	11426					
		74	A	11428					
		74	A	11430					
		74	A	11432					
		74	A	11434					
		74	A	11436					
		74	B				600140	150140	
75	TCT_75	ERROR ID. 75 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA TASAS DE INTERÉS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04 VS RC06 Y RC15							NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600150	FILTRO[Clase=10403] sum [ImporteP]
150150	FILTRO[Clase=10403] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06	RC15
75	A	13780	33780	43780		
75	A	13782	33782	43782		
75	A	13784	33784	43784		
75	A	13786	33786	43786		
75	A	13788	33788	43788		
75	A	13790	33790	43790		
75	A	13792	33792	43792		
75	A	13794	33794	43794		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		75	A	13796	33796	43796			
		75	A	13798	33798	43798			
		75	A	13800	33800	43800			
		75	A	13802	33802	43802			
		75	A	13804	33804	43804			
		75	A	13806	33806	43806			
		75	A	13810	33810	43810			
		75	A	13812	33812	43812			
		75	A	13814	33814	43814			
		75	A	13816	33816	43816			
		75	A	13818	33818	43818			
		75	A	13820	33820	43820			
		75	A	13822	33822	43822			
		75	A	13824	33824	43824			
		75	A	13826	33826	43826			
		75	A	13828	33828	43828			
		75	A	13830	33830	43830			
		75	A	13832	33832	43832			
		75	A	13834	33834	43834			
		75	A	13836	33836	43836			
		75	A	13840	33840	43840			
		75	A	13842	33842	43842			
		75	A	13844	33844	43844			
		75	A	13846	33846	43846			
		75	A	13848	33848	43848			
		75	A	13850	33850	43850			
		75	A	13852	33852	43852			
		75	A	13854	33854	43854			
		75	A	13856	33856	43856			
		75	A	13858	33858	43858			
		75	A	13860	33860	43860			
		75	A	13862	33862	43862			
		75	A	13864	33864	43864			
		75	A	13866	33866	43866			
		75	A	13870	33870	43870			
		75	A	13872	33872	43872			
		75	A	13874	33874	43874			
		75	A	13876	33876	43876			
		75	A	13878	33878	43878			
		75	A	13880	33880	43880			
		75	A	13882	33882	43882			
		75	A	13884	33884	43884			
		75	A	13886	33886	43886			
		75	A	13888	33888	43888			
		75	A	13890	33890	43890			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		75	A	13892	33892	43892			
		75	A	13894	33894	43894			
		75	A	13896	33896	43896			
		75	A	14080	34080	44140			
		75	A	14082	34082	44142			
		75	A	14084	34084	44144			
		75	A	14086	34086	44146			
		75	A	14088	34088	44148			
		75	A	14090	34090	44150			
		75	A	14092	34092	44152			
		75	A	14094	34094	44154			
		75	A	14096	34096	44156			
		75	A	14098	34098	44158			
		75	A	14100	34100	44160			
		75	A	14102	34102	44162			
		75	A	14104	34104	44164			
		75	A	14106	34106	44166			
		75	A	14110	34110	44170			
		75	A	14112	34112	44172			
		75	A	14114	34114	44174			
		75	A	14116	34116	44176			
		75	A	14118	34118	44178			
		75	A	14120	34120	44180			
		75	A	14122	34122	44182			
		75	A	14124	34124	44184			
		75	A	14126	34126	44186			
		75	A	14128	34128	44188			
		75	A	14130	34130	44190			
		75	A	14132	34132	44192			
		75	A	14134	34134	44194			
		75	A	14136	34136	44196			
		75	A	14140	34140	44200			
		75	A	14142	34142	44202			
		75	A	14144	34144	44204			
		75	A	14146	34146	44206			
		75	A	14148	34148	44208			
		75	A	14150	34150	44210			
		75	A	14152	34152	44212			
		75	A	14154	34154	44214			
		75	A	14156	34156	44216			
		75	A	14158	34158	44218			
		75	A	14160	34160	44220			
		75	A	14162	34162	44222			
		75	A	14164	34164	44224			
		75	A	14166	34166	44226			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		75	A	14170	34170	44230			
		75	A	14172	34172	44232			
		75	A	14174	34174	44234			
		75	A	14176	34176	44236			
		75	A	14178	34178	44238			
		75	A	14180	34180	44240			
		75	A	14182	34182	44242			
		75	A	14184	34184	44244			
		75	A	14186	34186	44246			
		75	A	14188	34188	44248			
		75	A	14190	34190	44250			
		75	A	14192	34192	44252			
		75	A	14194	34194	44254			
		75	A	14196	34196	44256			
		75	A	14530					
		75	A	14532					
		75	A	14534					
		75	A	14536					
		75	A	14538					
		75	A	14540					
		75	A	14542					
		75	A	14544					
		75	A	14546					
		75	A	14548					
		75	A	14550					
		75	A	14552					
		75	A	14554					
		75	A	14556					
		75	A	14560					
		75	A	14562					
		75	A	14564					
		75	A	14566					
		75	A	14568					
		75	A	14570					
		75	A	14572					
		75	A	14574					
		75	A	14576					
		75	A	14578					
		75	A	14580					
		75	A	14582					
		75	A	14584					
		75	A	14586					
		75	B				600150	150150	

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>76</td><td>TCT_76</td><td>ERROR ID. 76 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA ACCIONES E ÍNDICES ACCIONARIOS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC05 VS RC06 Y RC15
Algoritmo:
|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

<table>
<tr><td>600160</td><td>FILTRO[Clase=104041] sum [ImporteA]</td></tr>
<tr><td>150160</td><td>FILTRO[Clase=104041] sum [Importe]</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC01</th><th>RC04</th><th>RC05</th><th>RC06</th><th>RC15</th></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11776</td><td>41776</td><td>55006</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11777</td><td>41777</td><td>55019</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11778</td><td>41778</td><td>55032</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11779</td><td>41779</td><td>55007</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11780</td><td>41780</td><td>55020</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11781</td><td>41781</td><td>55033</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11782</td><td>41782</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11783</td><td>41783</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11784</td><td>41784</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11785</td><td>41785</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11786</td><td>41786</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11787</td><td>41787</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11788</td><td>41788</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11789</td><td>41789</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11836</td><td>41836</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11837</td><td>41837</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11838</td><td>41838</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11839</td><td>41839</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11840</td><td>41840</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11841</td><td>41841</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11842</td><td>41842</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11843</td><td>41843</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11844</td><td>41844</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11845</td><td>41845</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11846</td><td>41846</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11847</td><td>41847</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11848</td><td>41848</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>A</td><td>11849</td><td>41849</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>76</td><td>B</td><td></td><td></td><td></td><td>600160</td><td>150160</td></tr>
</table>
</td><td>NO Grave</td></tr>
<tr><td>77</td><td>TCT_77</td><td>ERROR ID. 77 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA ACCIONES E ÍNDICES ACCIONARIOS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC05 VS RC06 Y RC15</td><td>NO Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600170	FILTRO[Clase=104041] sum [ImporteP]
150170	FILTRO[Clase=104041] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05	RC06	RC15
77	A	14926	44926	55057		
77	A	14927	44927	55058		
77	A	14928	44928	55070		
77	A	14929	44929	55071		
77	A	14930	44930	55083		
77	A	14931	44931	55084		
77	A	14932	44932			
77	A	14933	44933			
77	A	14934	44934			
77	A	14935	44935			
77	A	14936	44936			
77	A	14937	44937			
77	A	14938	44938			
77	A	14939	44939			
77	A	14986	44986			
77	A	14987	44987			
77	A	14988	44988			
77	A	14989	44989			
77	A	14990	44990			
77	A	14991	44991			
77	A	14992	44992			
77	A	14993	44993			
77	A	14994	44994			
77	A	14995	44995			
77	A	14996	44996			
77	A	14997	44997			
77	A	14998	44998			
77	A	14999	44999			
77	B				600170	150170

78	TCT_78	ERROR ID. 78 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC17 VS RC06 Y RC15	NO Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600180	FILTRO[Clase=104042] sum [ImporteA]
150180	FILTRO[Clase=104042] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17	RC06	RC15
78	A	11791	41791	170004		
78	A	11792	41792	170012		
78	A	11793	41793	170019		
78	A	11794	41794	170005		
78	A	11795	41795	170013		
78	A	11796	41796	170020		
78	A	11797	41797			
78	A	11798	41798			
78	A	11799	41799			
78	A	11800	41800			
78	A	11801	41801			
78	A	11802	41802			
78	A	11803	41803			
78	A	11804	41804			
78	A	11851	41851			
78	A	11852	41852			
78	A	11853	41853			
78	A	11854	41854			
78	A	11855	41855			
78	A	11856	41856			
78	A	11857	41857			
78	A	11858	41858			
78	A	11859	41859			
78	A	11860	41860			
78	A	11861	41861			
78	A	11862	41862			
78	A	11863	41863			
78	A	11864	41864			
78	B				600180	150180

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
79	TCT_79	ERROR ID. 79 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC04,RC17 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600190	FILTRO[Clase=104042] sum [ImporteP]
150190	FILTRO[Clase=104042] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC17	RC06	RC15
79	A	14941	44941	170030		
79	A	14942	44942	170031		
79	A	14943	44943	170038		
79	A	14944	44944	170039		
79	A	14945	44945	170045		
79	A	14946	44946	170046		
79	A	14947	44947			
79	A	14948	44948			
79	A	14949	44949			
79	A	14950	44950			
79	A	14951	44951			
79	A	14952	44952			
79	A	14953	44953			
79	A	14954	44954			
79	A	15001	45001			
79	A	15002	45002			
79	A	15003	45003			
79	A	15004	45004			
79	A	15005	45005			
79	A	15006	45006			
79	A	15007	45007			
79	A	15008	45008			
79	A	15009	45009			
79	A	15010	45010			
79	A	15011	45011			
79	A	15012	45012			
79	A	15013	45013			
79	A	15014	45014			
79	B				600190	150190

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
80	TCT_80	ERROR ID. 80 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15	NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600200	FILTRO[Clase=104043] sum [ImporteA]
150200	FILTRO[Clase=104043] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
80	A	11806	30810	41806	110630		
80	A	11807	30812	41807	110632		
80	A	11808	30814	41808	110634		
80	A	11809	30816	41809	110636		
80	A	11810	30818	41810	110638		
80	A	11811	30820	41811	110640		
80	A	11812	30822	41812	110642		
80	A	11813	30824	41813	110644		
80	A	11814	30826	41814	110646		
80	A	11815	30828	41815	110648		
80	A	11816	30830	41816	110650		
80	A	11817	30832	41817	110652		
80	A	11818	30834	41818	110654		
80	A	11819	30836	41819	110656		
80	A	11821	30840	41821	110660		
80	A	11822	30842	41822	110662		
80	A	11823	30844	41823	110664		
80	A	11824	30846	41824	110666		
80	A	11825	30848	41825	110668		
80	A	11826	30850	41826	110670		
80	A	11827	30852	41827	110672		
80	A	11828	30854	41828	110674		
80	A	11829	30856	41829	110676		
80	A	11830	30858	41830	110678		
80	A	11831	30860	41831	110680		
80	A	11832	30862	41832	110682		
80	A	11833	30864	41833	110684		
80	A	11834	30866	41834	110686		
80	A	11866	30870	41866			
80	A	11867	30872	41867			
80	A	11868	30874	41868			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		80	A	11869	30876	41869				
		80	A	11870	30878	41870				
		80	A	11871	30880	41871				
		80	A	11872	30882	41872				
		80	A	11873	30884	41873				
		80	A	11874	30886	41874				
		80	A	11875	30888	41875				
		80	A	11876	30890	41876				
		80	A	11877	30892	41877				
		80	A	11878	30894	41878				
		80	A	11879	30896	41879				
		80	A	11881	30900	41881				
		80	A	11882	30902	41882				
		80	A	11883	30904	41883				
		80	A	11884	30906	41884				
		80	A	11885	30908	41885				
		80	A	11886	30910	41886				
		80	A	11887	30912	41887				
		80	A	11888	30914	41888				
		80	A	11889	30916	41889				
		80	A	11890	30918	41890				
		80	A	11891	30920	41891				
		80	A	11892	30922	41892				
		80	A	11893	30924	41893				
		80	A	11894	30926	41894				
		80	A	11440						
		80	A	11442						
		80	A	11444						
		80	A	11446						
		80	A	11448						
		80	A	11450						
		80	A	11452						
		80	A	11454						
		80	A	11456						
		80	A	11458						
		80	A	11460						
		80	A	11462						
		80	A	11464						
		80	A	11466						
		80	A	11470						
		80	A	11472						
		80	A	11474						
		80	A	11476						
		80	A	11478						
		80	A	11480						

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		80	A	11482						
		80	A	11484						
		80	A	11486						
		80	A	11488						
		80	A	11490						
		80	A	11492						
		80	A	11494						
		80	A	11496						
		80	A	12001						
		80	A	12002						
		80	A	12003						
		80	A	12004						
		80	A	12005						
		80	A	12006						
		80	A	12007						
		80	A	12008						
		80	A	12009						
		80	A	12010						
		80	A	12011						
		80	A	12012						
		80	A	12013						
		80	A	12014						
		80	A	12016						
		80	A	12017						
		80	A	12018						
		80	A	12019						
		80	A	12020						
		80	A	12021						
		80	A	12022						
		80	A	12023						
		80	A	12024						
		80	A	12025						
		80	A	12026						
		80	A	12027						
		80	A	12028						
		80	A	12029						
		80	A	12031						
		80	A	12032						
		80	A	12033						
		80	A	12034						
		80	A	12035						
		80	A	12036						
		80	A	12037						
		80	A	12038						
		80	A	12039						

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		80	A	12040						
		80	A	12041						
		80	A	12042						
		80	A	12043						
		80	A	12044						
		80	A	12046						
		80	A	12047						
		80	A	12048						
		80	A	12049						
		80	A	12050						
		80	A	12051						
		80	A	12052						
		80	A	12053						
		80	A	12054						
		80	A	12055						
		80	A	12056						
		80	A	12057						
		80	A	12058						
		80	A	12059						
		80	A	12061						
		80	A	12062						
		80	A	12063						
		80	A	12064						
		80	A	12065						
		80	A	12066						
		80	A	12067						
		80	A	12068						
		80	A	12069						
		80	A	12070						
		80	A	12071						
		80	A	12072						
		80	A	12073						
		80	A	12074						
		80	A	12076						
		80	A	12077						
		80	A	12078						
		80	A	12079						
		80	A	12080						
		80	A	12081						
		80	A	12082						
		80	A	12083						
		80	A	12084						
		80	A	12085						
		80	A	12086						
		80	A	12087						

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

80	A	12088					
80	A	12089					
80	B					600200	150200

81 TCT_81

ERROR ID. 81 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA OTROS SUBYACENTES (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15

NO Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600210	FILTRO[Clase=104043] sum [ImporteP]
150210	FILTRO[Clase=104043] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
81	A	14956	33960	44956	113780		
81	A	14957	33962	44957	113782		
81	A	14958	33964	44958	113784		
81	A	14959	33966	44959	113786		
81	A	14960	33968	44960	113788		
81	A	14961	33970	44961	113790		
81	A	14962	33972	44962	113792		
81	A	14963	33974	44963	113794		
81	A	14964	33976	44964	113796		
81	A	14965	33978	44965	113798		
81	A	14966	33980	44966	113800		
81	A	14967	33982	44967	113802		
81	A	14968	33984	44968	113804		
81	A	14969	33986	44969	113806		
81	A	14971	33990	44971	113810		
81	A	14972	33992	44972	113812		
81	A	14973	33994	44973	113814		
81	A	14974	33996	44974	113816		
81	A	14975	33998	44975	113818		
81	A	14976	34000	44976	113820		
81	A	14977	34002	44977	113822		
81	A	14978	34004	44978	113824		
81	A	14979	34006	44979	113826		
81	A	14980	34008	44980	113828		
81	A	14981	34010	44981	113830		
81	A	14982	34012	44982	113832		
81	A	14983	34014	44983	113834		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		81	A	14984	34016	44984	113836			
		81	A	15016	34020	45016				
		81	A	15017	34022	45017				
		81	A	15018	34024	45018				
		81	A	15019	34026	45019				
		81	A	15020	34028	45020				
		81	A	15021	34030	45021				
		81	A	15022	34032	45022				
		81	A	15023	34034	45023				
		81	A	15024	34036	45024				
		81	A	15025	34038	45025				
		81	A	15026	34040	45026				
		81	A	15027	34042	45027				
		81	A	15028	34044	45028				
		81	A	15029	34046	45029				
		81	A	15031	34050	45031				
		81	A	15032	34052	45032				
		81	A	15033	34054	45033				
		81	A	15034	34056	45034				
		81	A	15035	34058	45035				
		81	A	15036	34060	45036				
		81	A	15037	34062	45037				
		81	A	15038	34064	45038				
		81	A	15039	34066	45039				
		81	A	15040	34068	45040				
		81	A	15041	34070	45041				
		81	A	15042	34072	45042				
		81	A	15043	34074	45043				
		81	A	15044	34076	45044				
		81	A	14590						
		81	A	14592						
		81	A	14594						
		81	A	14596						
		81	A	14598						
		81	A	14600						
		81	A	14602						
		81	A	14604						
		81	A	14606						
		81	A	14608						
		81	A	14610						
		81	A	14612						
		81	A	14614						
		81	A	14616						
		81	A	14620						
		81	A	14622						

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		81	A	14624						
		81	A	14626						
		81	A	14628						
		81	A	14630						
		81	A	14632						
		81	A	14634						
		81	A	14636						
		81	A	14638						
		81	A	14640						
		81	A	14642						
		81	A	14644						
		81	A	14646						
		81	A	15151						
		81	A	15152						
		81	A	15153						
		81	A	15154						
		81	A	15155						
		81	A	15156						
		81	A	15157						
		81	A	15158						
		81	A	15159						
		81	A	15160						
		81	A	15161						
		81	A	15162						
		81	A	15163						
		81	A	15164						
		81	A	15166						
		81	A	15167						
		81	A	15168						
		81	A	15169						
		81	A	15170						
		81	A	15171						
		81	A	15172						
		81	A	15173						
		81	A	15174						
		81	A	15175						
		81	A	15176						
		81	A	15177						
		81	A	15178						
		81	A	15179						
		81	A	15181						
		81	A	15182						
		81	A	15183						
		81	A	15184						
		81	A	15185						

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
		81	A	15186						
		81	A	15187						
		81	A	15188						
		81	A	15189						
		81	A	15190						
		81	A	15191						
		81	A	15192						
		81	A	15193						
		81	A	15194						
		81	A	15196						
		81	A	15197						
		81	A	15198						
		81	A	15199						
		81	A	15200						
		81	A	15201						
		81	A	15202						
		81	A	15203						
		81	A	15204						
		81	A	15205						
		81	A	15206						
		81	A	15207						
		81	A	15208						
		81	A	15209						
		81	A	15211						
		81	A	15212						
		81	A	15213						
		81	A	15214						
		81	A	15215						
		81	A	15216						
		81	A	15217						
		81	A	15218						
		81	A	15219						
		81	A	15220						
		81	A	15221						
		81	A	15222						
		81	A	15223						
		81	A	15224						
		81	A	15226						
		81	A	15227						
		81	A	15228						
		81	A	15229						
		81	A	15230						
		81	A	15231						
		81	A	15232						
		81	A	15233						

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

81	A	15234					
81	A	15235					
81	A	15236					
81	A	15237					
81	A	15238					
81	A	15239					
81	B					600210	150210

105 TCT_105

ERROR ID. 105 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA OTROS SUBYACENTES, DIVISAS, ORO Y MERCANCÍAS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11,RC17 VS RC06 Y RC15 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600120	FILTRO[Clase=10402] sum [ImporteA]
600180	FILTRO[Clase=104042] sum [ImporteA]
600200	FILTRO[Clase=104043] sum [ImporteA]
150120	FILTRO[Clase=10402] sum [Importe]
150180	FILTRO[Clase=104042] sum [Importe]
150200	FILTRO[Clase=104043] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15	RC17
105	A	10750	30810	40750	110630			170004
105	A	10752	30812	40752	110632			170005
105	A	10754	30814	40754	110634			170012
105	A	10756	30816	40756	110636			170013
105	A	10758	30818	40758	110638			170019
105	A	10760	30820	40760	110640			170020
105	A	10762	30822	40762	110642			
105	A	10764	30824	40764	110644			
105	A	10766	30826	40766	110646			
105	A	10768	30828	40768	110648			
105	A	10770	30830	40770	110650			
105	A	10772	30832	40772	110652			
105	A	10774	30834	40774	110654			
105	A	10776	30836	40776	110656			
105	A	10780	30840	40780	110660			
105	A	10782	30842	40782	110662			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo									Nivel
	105	A	10784	30844	40784	110664					
	105	A	10786	30846	40786	110666					
	105	A	10788	30848	40788	110668					
	105	A	10790	30850	40790	110670					
	105	A	10792	30852	40792	110672					
	105	A	10794	30854	40794	110674					
	105	A	10796	30856	40796	110676					
	105	A	10798	30858	40798	110678					
	105	A	10800	30860	40800	110680					
	105	A	10802	30862	40802	110682					
	105	A	10804	30864	40804	110684					
	105	A	10806	30866	40806	110686					
	105	A	11791	30870	40840						
	105	A	11792	30872	40842						
	105	A	11793	30874	40844						
	105	A	11794	30876	40846						
	105	A	11795	30878	40848						
	105	A	11796	30880	40850						
	105	A	11797	30882	40852						
	105	A	11798	30884	40854						
	105	A	11799	30886	40856						
	105	A	11800	30888	40858						
	105	A	11801	30890	40860						
	105	A	11802	30892	40862						
	105	A	11803	30894	40864						
	105	A	11804	30896	40866						
	105	A	11851	30900	40810						
	105	A	11852	30902	40812						
	105	A	11853	30904	40814						
	105	A	11854	30906	40816						
	105	A	11855	30908	40818						
	105	A	11856	30910	40820						
	105	A	11857	30912	40822						
	105	A	11858	30914	40824						
	105	A	11859	30916	40826						
	105	A	11860	30918	40828						
	105	A	11861	30920	40830						
	105	A	11862	30922	40832						

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	105	A	11863	30924	40834					
	105	A	11864	30926	40836					
	105	A	11806		41791					
	105	A	11807		41792					
	105	A	11808		41793					
	105	A	11809		41794					
	105	A	11810		41795					
	105	A	11811		41796					
	105	A	11812		41797					
	105	A	11813		41798					
	105	A	11814		41799					
	105	A	11815		41800					
	105	A	11816		41801					
	105	A	11817		41802					
	105	A	11818		41803					
	105	A	11819		41804					
	105	A	11821		41851					
	105	A	11822		41852					
	105	A	11823		41853					
	105	A	11824		41854					
	105	A	11825		41855					
	105	A	11826		41856					
	105	A	11827		41857					
	105	A	11828		41858					
	105	A	11829		41859					
	105	A	11830		41860					
	105	A	11831		41861					
	105	A	11832		41862					
	105	A	11833		41863					
	105	A	11834		41864					
	105	A	11866		41806					
	105	A	11867		41807					
	105	A	11868		41808					
	105	A	11869		41809					
	105	A	11870		41810					
	105	A	11871		41811					
	105	A	11872		41812					
	105	A	11873		41813					

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	105	A	11874		41814					
	105	A	11875		41815					
	105	A	11876		41816					
	105	A	11877		41817					
	105	A	11878		41818					
	105	A	11879		41819					
	105	A	11881		41821					
	105	A	11882		41822					
	105	A	11883		41823					
	105	A	11884		41824					
	105	A	11885		41825					
	105	A	11886		41826					
	105	A	11887		41827					
	105	A	11888		41828					
	105	A	11889		41829					
	105	A	11890		41830					
	105	A	11891		41831					
	105	A	11892		41832					
	105	A	11893		41833					
	105	A	11894		41834					
	105	A			41866					
	105	A			41867					
	105	A			41868					
	105	A			41869					
	105	A			41870					
	105	A			41871					
	105	A			41872					
	105	A			41873					
	105	A			41874					
	105	A			41875					
	105	A			41876					
	105	A			41877					
	105	A			41878					
	105	A			41879					
	105	A			41881					
	105	A			41882					
	105	A			41883					
	105	A			41884					

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

105	A			41885				
105	A			41886				
105	A			41887				
105	A			41888				
105	A			41889				
105	A			41890				
105	A			41891				
105	A			41892				
105	A			41893				
105	A			41894				
105	B					600120	150120	
105	B					600180	150180	
105	B					600200	150200	

106

TCT_106

ERROR ID. 106 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),FUTUROS Y FORWARDS COMPRA Y VENTA OTROS SUBYACENTES, DIVISAS, ORO Y MERCANCÍAS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11,RC17 VS RC06 Y RC15 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600130	FILTRO[Clase=10402] sum [ImporteP]
600190	FILTRO[Clase=104042] sum [ImporteP]
600210	FILTRO[Clase=104043] sum [ImporteP]
150130	FILTRO[Clase=10402] sum [ImportePO]
150190	FILTRO[Clase=104042] sum [ImportePO]
150210	FILTRO[Clase=104043] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15	RC17
106	A	13900	33960	43900	113780			170030
106	A	13902	33962	43902	113782			170031
106	A	13904	33964	43904	113784			170038
106	A	13906	33966	43906	113786			170039
106	A	13908	33968	43908	113788			170045
106	A	13910	33970	43910	113790			170046

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	106	A	13912	33972	43912	113792				
	106	A	13914	33974	43914	113794				
	106	A	13916	33976	43916	113796				
	106	A	13918	33978	43918	113798				
	106	A	13920	33980	43920	113800				
	106	A	13922	33982	43922	113802				
	106	A	13924	33984	43924	113804				
	106	A	13926	33986	43926	113806				
	106	A	13930	33990	43930	113810				
	106	A	13932	33992	43932	113812				
	106	A	13934	33994	43934	113814				
	106	A	13936	33996	43936	113816				
	106	A	13938	33998	43938	113818				
	106	A	13940	34000	43940	113820				
	106	A	13942	34002	43942	113822				
	106	A	13944	34004	43944	113824				
	106	A	13946	34006	43946	113826				
	106	A	13948	34008	43948	113828				
	106	A	13950	34010	43950	113830				
	106	A	13952	34012	43952	113832				
	106	A	13954	34014	43954	113834				
	106	A	13956	34016	43956	113836				
	106	A	14941	34020	43960					
	106	A	14942	34022	43962					
	106	A	14943	34024	43964					
	106	A	14944	34026	43966					
	106	A	14945	34028	43968					
	106	A	14946	34030	43970					
	106	A	14947	34032	43972					
	106	A	14948	34034	43974					
	106	A	14949	34036	43976					
	106	A	14950	34038	43978					
	106	A	14951	34040	43980					
	106	A	14952	34042	43982					
	106	A	14953	34044	43984					
	106	A	14954	34046	43986					
	106	A	15001	34050	43990					

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo									Nivel
	106	A	15002	34052	43992						
	106	A	15003	34054	43994						
	106	A	15004	34056	43996						
	106	A	15005	34058	43998						
	106	A	15006	34060	44000						
	106	A	15007	34062	44002						
	106	A	15008	34064	44004						
	106	A	15009	34066	44006						
	106	A	15010	34068	44008						
	106	A	15011	34070	44010						
	106	A	15012	34072	44012						
	106	A	15013	34074	44014						
	106	A	15014	34076	44016						
	106	A	14956		44941						
	106	A	14957		44942						
	106	A	14958		44943						
	106	A	14959		44944						
	106	A	14960		44945						
	106	A	14961		44946						
	106	A	14962		44947						
	106	A	14963		44948						
	106	A	14964		44949						
	106	A	14965		44950						
	106	A	14966		44951						
	106	A	14967		44952						
	106	A	14968		44953						
	106	A	14969		44954						
	106	A	14971		45001						
	106	A	14972		45002						
	106	A	14973		45003						
	106	A	14974		45004						
	106	A	14975		45005						
	106	A	14976		45006						
	106	A	14977		45007						
	106	A	14978		45008						
	106	A	14979		45009						
	106	A	14980		45010						

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	106	A	14981		45011					
	106	A	14982		45012					
	106	A	14983		45013					
	106	A	14984		45014					
	106	A	15016		44956					
	106	A	15017		44957					
	106	A	15018		44958					
	106	A	15019		44959					
	106	A	15020		44960					
	106	A	15021		44961					
	106	A	15022		44962					
	106	A	15023		44963					
	106	A	15024		44964					
	106	A	15025		44965					
	106	A	15026		44966					
	106	A	15027		44967					
	106	A	15028		44968					
	106	A	15029		44969					
	106	A	15031		44971					
	106	A	15032		44972					
	106	A	15033		44973					
	106	A	15034		44974					
	106	A	15035		44975					
	106	A	15036		44976					
	106	A	15037		44977					
	106	A	15038		44978					
	106	A	15039		44979					
	106	A	15040		44980					
	106	A	15041		44981					
	106	A	15042		44982					
	106	A	15043		44983					
	106	A	15044		44984					
	106	A			45016					
	106	A			45017					
	106	A			45018					
	106	A			45019					
	106	A			45020					

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo								Nivel
	106	A			45021					
	106	A			45022					
	106	A			45023					
	106	A			45024					
	106	A			45025					
	106	A			45026					
	106	A			45027					
	106	A			45028					
	106	A			45029					
	106	A			45031					
	106	A			45032					
	106	A			45033					
	106	A			45034					
	106	A			45035					
	106	A			45036					
	106	A			45037					
	106	A			45038					
	106	A			45039					
	106	A			45040					
	106	A			45041					
	106	A			45042					
	106	A			45043					
	106	A			45044					
	106	B					600130	150130		
	106	B					600190	150190		
	106	B					600210	150210		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

4.4 Préstamos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
82	TCT_82	ERROR ID. 82 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS PRESTAMISTA (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15	NO Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600080	FILTRO[Clase=10318] sum [ImporteA]
150080	FILTRO[Clase=10318] sum [Importe]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
82	A	10500	30500	40500	110500		
82	A	10502	30502	40502	110502		
82	A	10504	30504	40504	110504		
82	A	10506	30506	40506	110506		
82	A	10508	30508	40508	110508		
82	A	10510	30510	40510	110510		
82	A	10512	30512	40512	110512		
82	A	10514	30514	40514	110514		
82	A	10516	30516	40516	110516		
82	A	10518	30518	40518	110518		
82	A	10520	30520	40520	110520		
82	A	10522	30522	40522	110522		
82	A	10524	30524	40524	110524		
82	A	10526	30526	40526	110526		
82	B					600080	150080

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

83 TCT_83 ERROR ID. 83 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES RIESGO MERCADO VS CRÉDITO (CONTRAPARTE),SWAPS PERSTATARIO (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC06 Y RC15 — NO Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600110	FILTRO[Clase=10319] sum [ImporteP]
150110	FILTRO[Clase=10319] sum [ImportePO]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06	RC15
83	A	13650	33650	43650	113650		
83	A	13652	33652	43652	113652		
83	A	13654	33654	43654	113654		
83	A	13656	33656	43656	113656		
83	A	13658	33658	43658	113658		
83	A	13660	33660	43660	113660		
83	A	13662	33662	43662	113662		
83	A	13664	33664	43664	113664		
83	A	13666	33666	43666	113666		
83	A	13668	33668	43668	113668		
83	A	13670	33670	43670	113670		
83	A	13672	33672	43672	113672		
83	A	13674	33674	43674	113674		
83	A	13676	33676	43676	113676		
83	B					600110	150110

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

Contenido

Tipo5. Mercado vs Mercado

5.1 Opciones y Títulos Opcionales

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
84	TCT_84	ERROR ID. 84 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS NOMINAL EN M.N. (ACTIVO) RC01 VS RC18	Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC18
84	A	11170	
84	A	11172	
84	A	11174	
84	A	11176	
84	A	11178	
84	A	11180	
84	A	11182	
84	A	11184	
84	A	11186	
84	A	11188	
84	A	11190	
84	A	11192	
84	A	11194	
84	A	11196	
84	A	11986	
84	A	11987	
84	A	11988	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		84	A	11989		
		84	A	11990		
		84	A	11991		
		84	A	11992		
		84	A	11993		
		84	A	11994		
		84	A	11995		
		84	A	11996		
		84	A	11997		
		84	A	11998		
		84	A	11999		
		84	A	11530		
		84	A	11532		
		84	A	11534		
		84	A	11536		
		84	A	11538		
		84	A	11540		
		84	A	11542		
		84	A	11544		
		84	A	11546		
		84	A	11548		
		84	A	11550		
		84	A	11552		
		84	A	11554		
		84	A	11556		
		84	A	12151		
		84	A	12152		
		84	A	12153		
		84	A	12154		
		84	A	12155		
		84	A	12156		
		84	A	12157		
		84	A	12158		
		84	A	12159		
		84	A	12160		
		84	A	12161		
		84	A	12162		
		84	A	12163		
		84	A	12164		
		84	A	11680		
		84	A	11682		
		84	A	11684		
		84	A	11686		
		84	A	11688		
		84	A	11690		
		84	A	11692		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		84	A	11694		
		84	A	11696		
		84	A	11698		
		84	A	11700		
		84	A	11702		
		84	A	11704		
		84	A	11706		
		84	A	11710		
		84	A	11712		
		84	A	11714		
		84	A	11716		
		84	A	11718		
		84	A	11720		
		84	A	11722		
		84	A	11724		
		84	A	11726		
		84	A	11728		
		84	A	11730		
		84	A	11732		
		84	A	11734		
		84	A	11736		
		84	B		180052	
		84	B		180054	
		84	B		180056	
		84	B		180058	
		84	B		180060	
		84	B		180062	
		84	B		180064	
		84	B		180066	
		84	B		180068	
		84	B		180070	
		84	B		180072	
		84	B		180074	
		84	B		180076	
		84	B		180078	
		84	B		180102	
		84	B		180104	
		84	B		180106	
		84	B		180108	
		84	B		180110	
		84	B		180112	
		84	B		180114	
		84	B		180116	
		84	B		180118	
		84	B		180120	
		84	B		180122	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	84	B		180124	
	84	B		180126	
	84	B		180128	
	84	B		180152	
	84	B		180154	
	84	B		180156	
	84	B		180158	
	84	B		180160	
	84	B		180162	
	84	B		180164	
	84	B		180166	
	84	B		180168	
	84	B		180170	
	84	B		180172	
	84	B		180174	
	84	B		180176	
	84	B		180178	
	84	B		180202	
	84	B		180204	
	84	B		180206	
	84	B		180208	
	84	B		180210	
	84	B		180212	
	84	B		180214	
	84	B		180216	
	84	B		180218	
	84	B		180220	
	84	B		180222	
	84	B		180224	
	84	B		180226	
	84	B		180228	
	84	B		180252	
	84	B		180254	
	84	B		180256	
	84	B		180258	
	84	B		180260	
	84	B		180262	
	84	B		180264	
	84	B		180266	
	84	B		180268	
	84	B		180270	
	84	B		180272	
	84	B		180274	
	84	B		180276	
	84	B		180278	
	84	B		180302	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

84	B		180304
84	B		180306
84	B		180308
84	B		180310
84	B		180312
84	B		180314
84	B		180316
84	B		180318
84	B		180320
84	B		180322
84	B		180324
84	B		180326
84	B		180328

85 TCT_85 ERROR ID. 85 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS NOMINAL EN M.N. (PASIVO) RC01 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC18
85	A	14290	
85	A	14292	
85	A	14294	
85	A	14296	
85	A	14298	
85	A	14300	
85	A	14302	
85	A	14304	
85	A	14306	
85	A	14308	
85	A	14310	
85	A	14312	
85	A	14314	
85	A	14316	
85	A	15121	
85	A	15122	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		85	A	15123		
		85	A	15124		
		85	A	15125		
		85	A	15126		
		85	A	15127		
		85	A	15128		
		85	A	15129		
		85	A	15130		
		85	A	15131		
		85	A	15132		
		85	A	15133		
		85	A	15134		
		85	A	14650		
		85	A	14652		
		85	A	14654		
		85	A	14656		
		85	A	14658		
		85	A	14660		
		85	A	14662		
		85	A	14664		
		85	A	14666		
		85	A	14668		
		85	A	14670		
		85	A	14672		
		85	A	14674		
		85	A	14676		
		85	A	15286		
		85	A	15287		
		85	A	15288		
		85	A	15289		
		85	A	15290		
		85	A	15291		
		85	A	15292		
		85	A	15293		
		85	A	15294		
		85	A	15295		
		85	A	15296		
		85	A	15297		
		85	A	15298		
		85	A	15299		
		85	A	14800		
		85	A	14802		
		85	A	14804		
		85	A	14806		
		85	A	14808		
		85	A	14810		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		85	A	14812		
		85	A	14814		
		85	A	14816		
		85	A	14818		
		85	A	14820		
		85	A	14822		
		85	A	14824		
		85	A	14826		
		85	A	14890		
		85	A	14892		
		85	A	14894		
		85	A	14896		
		85	A	14898		
		85	A	14900		
		85	A	14902		
		85	A	14904		
		85	A	14906		
		85	A	14908		
		85	A	14910		
		85	A	14912		
		85	A	14914		
		85	A	14916		
		85	B		183052	
		85	B		183054	
		85	B		183056	
		85	B		183058	
		85	B		183060	
		85	B		183062	
		85	B		183064	
		85	B		183066	
		85	B		183068	
		85	B		183070	
		85	B		183072	
		85	B		183074	
		85	B		183076	
		85	B		183078	
		85	B		183102	
		85	B		183104	
		85	B		183106	
		85	B		183108	
		85	B		183110	
		85	B		183112	
		85	B		183114	
		85	B		183116	
		85	B		183118	
		85	B		183120	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	85	B		183122	
	85	B		183124	
	85	B		183126	
	85	B		183128	
	85	B		183152	
	85	B		183154	
	85	B		183156	
	85	B		183158	
	85	B		183160	
	85	B		183162	
	85	B		183164	
	85	B		183166	
	85	B		183168	
	85	B		183170	
	85	B		183172	
	85	B		183174	
	85	B		183176	
	85	B		183178	
	85	B		183202	
	85	B		183204	
	85	B		183206	
	85	B		183208	
	85	B		183210	
	85	B		183212	
	85	B		183214	
	85	B		183216	
	85	B		183218	
	85	B		183220	
	85	B		183222	
	85	B		183224	
	85	B		183226	
	85	B		183228	
	85	B		183252	
	85	B		183254	
	85	B		183256	
	85	B		183258	
	85	B		183260	
	85	B		183262	
	85	B		183264	
	85	B		183266	
	85	B		183268	
	85	B		183270	
	85	B		183272	
	85	B		183274	
	85	B		183276	
	85	B		183278	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

85	B		183302
85	B		183304
85	B		183306
85	B		183308
85	B		183310
85	B		183312
85	B		183314
85	B		183316
85	B		183318
85	B		183320
85	B		183322
85	B		183324
85	B		183326
85	B		183328

86 TCT_86

ERROR ID. 86 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS REAL EN M.N. (ACTIVO) RC03 VS RC18

Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC18
86	A	31170	
86	A	31172	
86	A	31174	
86	A	31176	
86	A	31178	
86	A	31180	
86	A	31182	
86	A	31184	
86	A	31186	
86	A	31188	
86	A	31190	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		86	A	31192		
		86	A	31194		
		86	A	31196		
		86	A	31260		
		86	A	31262		
		86	A	31264		
		86	A	31266		
		86	A	31268		
		86	A	31270		
		86	A	31272		
		86	A	31274		
		86	A	31276		
		86	A	31278		
		86	A	31280		
		86	A	31282		
		86	A	31284		
		86	A	31286		
		86	A	31410		
		86	A	31412		
		86	A	31414		
		86	A	31416		
		86	A	31418		
		86	A	31420		
		86	A	31422		
		86	A	31424		
		86	A	31426		
		86	A	31428		
		86	A	31430		
		86	A	31432		
		86	A	31434		
		86	A	31436		
		86	A	31470		
		86	A	31472		
		86	A	31474		
		86	A	31476		
		86	A	31478		
		86	A	31480		
		86	A	31482		
		86	A	31484		
		86	A	31486		
		86	A	31488		
		86	A	31490		
		86	A	31492		
		86	A	31494		
		86	A	31496		
		86	A	31530		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		86	A	31532		
		86	A	31534		
		86	A	31536		
		86	A	31538		
		86	A	31540		
		86	A	31542		
		86	A	31544		
		86	A	31546		
		86	A	31548		
		86	A	31550		
		86	A	31552		
		86	A	31554		
		86	A	31556		
		86	A	31560		
		86	A	31562		
		86	A	31564		
		86	A	31566		
		86	A	31568		
		86	A	31570		
		86	A	31572		
		86	A	31574		
		86	A	31576		
		86	A	31578		
		86	A	31580		
		86	A	31582		
		86	A	31584		
		86	A	31586		
		86	B		180352	
		86	B		180354	
		86	B		180356	
		86	B		180358	
		86	B		180360	
		86	B		180362	
		86	B		180364	
		86	B		180366	
		86	B		180368	
		86	B		180370	
		86	B		180372	
		86	B		180374	
		86	B		180376	
		86	B		180378	
		86	B		180402	
		86	B		180404	
		86	B		180406	
		86	B		180408	
		86	B		180410	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		86	B	180412	
		86	B	180414	
		86	B	180416	
		86	B	180418	
		86	B	180420	
		86	B	180422	
		86	B	180424	
		86	B	180426	
		86	B	180428	
		86	B	180452	
		86	B	180454	
		86	B	180456	
		86	B	180458	
		86	B	180460	
		86	B	180462	
		86	B	180464	
		86	B	180466	
		86	B	180468	
		86	B	180470	
		86	B	180472	
		86	B	180474	
		86	B	180476	
		86	B	180478	
		86	B	180502	
		86	B	180504	
		86	B	180506	
		86	B	180508	
		86	B	180510	
		86	B	180512	
		86	B	180514	
		86	B	180516	
		86	B	180518	
		86	B	180520	
		86	B	180522	
		86	B	180524	
		86	B	180526	
		86	B	180528	
		86	B	180552	
		86	B	180554	
		86	B	180556	
		86	B	180558	
		86	B	180560	
		86	B	180562	
		86	B	180564	
		86	B	180566	
		86	B	180568	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

86	B		180570
86	B		180572
86	B		180574
86	B		180576
86	B		180578
86	B		180602
86	B		180604
86	B		180606
86	B		180608
86	B		180610
86	B		180612
86	B		180614
86	B		180616
86	B		180618
86	B		180620
86	B		180622
86	B		180624
86	B		180626
86	B		180628

87 TCT_87 ERROR ID. 87 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS REAL EN M.N. (PASIVO) RC03 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC18
87	A	34290	
87	A	34292	
87	A	34294	
87	A	34296	
87	A	34298	
87	A	34300	
87	A	34302	
87	A	34304	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		87	A	34306		
		87	A	34308		
		87	A	34310		
		87	A	34312		
		87	A	34314		
		87	A	34316		
		87	A	34380		
		87	A	34382		
		87	A	34384		
		87	A	34386		
		87	A	34388		
		87	A	34390		
		87	A	34392		
		87	A	34394		
		87	A	34396		
		87	A	34398		
		87	A	34400		
		87	A	34402		
		87	A	34404		
		87	A	34406		
		87	A	34530		
		87	A	34532		
		87	A	34534		
		87	A	34536		
		87	A	34538		
		87	A	34540		
		87	A	34542		
		87	A	34544		
		87	A	34546		
		87	A	34548		
		87	A	34550		
		87	A	34552		
		87	A	34554		
		87	A	34556		
		87	A	34590		
		87	A	34592		
		87	A	34594		
		87	A	34596		
		87	A	34598		
		87	A	34600		
		87	A	34602		
		87	A	34604		
		87	A	34606		
		87	A	34608		
		87	A	34610		
		87	A	34612		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		87	A	34614		
		87	A	34616		
		87	A	34650		
		87	A	34652		
		87	A	34654		
		87	A	34656		
		87	A	34658		
		87	A	34660		
		87	A	34662		
		87	A	34664		
		87	A	34666		
		87	A	34668		
		87	A	34670		
		87	A	34672		
		87	A	34674		
		87	A	34676		
		87	A	34740		
		87	A	34742		
		87	A	34744		
		87	A	34746		
		87	A	34748		
		87	A	34750		
		87	A	34752		
		87	A	34754		
		87	A	34756		
		87	A	34758		
		87	A	34760		
		87	A	34762		
		87	A	34764		
		87	A	34766		
		87	B		183352	
		87	B		183354	
		87	B		183356	
		87	B		183358	
		87	B		183360	
		87	B		183362	
		87	B		183364	
		87	B		183366	
		87	B		183368	
		87	B		183370	
		87	B		183372	
		87	B		183374	
		87	B		183376	
		87	B		183378	
		87	B		183402	
		87	B		183404	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		87	B	183406	
		87	B	183408	
		87	B	183410	
		87	B	183412	
		87	B	183414	
		87	B	183416	
		87	B	183418	
		87	B	183420	
		87	B	183422	
		87	B	183424	
		87	B	183426	
		87	B	183428	
		87	B	183452	
		87	B	183454	
		87	B	183456	
		87	B	183458	
		87	B	183460	
		87	B	183462	
		87	B	183464	
		87	B	183466	
		87	B	183468	
		87	B	183470	
		87	B	183472	
		87	B	183474	
		87	B	183476	
		87	B	183478	
		87	B	183502	
		87	B	183504	
		87	B	183506	
		87	B	183508	
		87	B	183510	
		87	B	183512	
		87	B	183514	
		87	B	183516	
		87	B	183518	
		87	B	183520	
		87	B	183522	
		87	B	183524	
		87	B	183526	
		87	B	183528	
		87	B	183552	
		87	B	183554	
		87	B	183556	
		87	B	183558	
		87	B	183560	
		87	B	183562	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

87	B		183564
87	B		183566
87	B		183568
87	B		183570
87	B		183572
87	B		183574
87	B		183576
87	B		183578
87	B		183602
87	B		183604
87	B		183606
87	B		183608
87	B		183610
87	B		183612
87	B		183614
87	B		183616
87	B		183618
87	B		183620
87	B		183622
87	B		183624
87	B		183626
87	B		183628

88 TCT_88 ERROR ID. 88 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS NOMINAL EN M.E. (ACTIVO) RC04 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC18
88	A	41230	
88	A	41232	
88	A	41234	
88	A	41236	
88	A	41238	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		88	A	41240		
		88	A	41242		
		88	A	41244		
		88	A	41246		
		88	A	41248		
		88	A	41250		
		88	A	41252		
		88	A	41254		
		88	A	41256		
		88	A	41290		
		88	A	41292		
		88	A	41294		
		88	A	41296		
		88	A	41298		
		88	A	41300		
		88	A	41302		
		88	A	41304		
		88	A	41306		
		88	A	41308		
		88	A	41310		
		88	A	41312		
		88	A	41314		
		88	A	41316		
		88	A	41986		
		88	A	41987		
		88	A	41988		
		88	A	41989		
		88	A	41990		
		88	A	41991		
		88	A	41992		
		88	A	41993		
		88	A	41994		
		88	A	41995		
		88	A	41996		
		88	A	41997		
		88	A	41998		
		88	A	41999		
		88	A	41500		
		88	A	41502		
		88	A	41504		
		88	A	41506		
		88	A	41508		
		88	A	41510		
		88	A	41512		
		88	A	41514		
		88	A	41516		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		88	A	41518		
		88	A	41520		
		88	A	41522		
		88	A	41524		
		88	A	41526		
		88	A	41560		
		88	A	41562		
		88	A	41564		
		88	A	41566		
		88	A	41568		
		88	A	41570		
		88	A	41572		
		88	A	41574		
		88	A	41576		
		88	A	41578		
		88	A	41580		
		88	A	41582		
		88	A	41584		
		88	A	41586		
		88	A	42061		
		88	A	42062		
		88	A	42063		
		88	A	42064		
		88	A	42065		
		88	A	42066		
		88	A	42067		
		88	A	42068		
		88	A	42069		
		88	A	42070		
		88	A	42071		
		88	A	42072		
		88	A	42073		
		88	A	42074		
		88	A	41680		
		88	A	41682		
		88	A	41684		
		88	A	41686		
		88	A	41688		
		88	A	41690		
		88	A	41692		
		88	A	41694		
		88	A	41696		
		88	A	41698		
		88	A	41700		
		88	A	41702		
		88	A	41704		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		88	A	41706		
		88	A	41710		
		88	A	41712		
		88	A	41714		
		88	A	41716		
		88	A	41718		
		88	A	41720		
		88	A	41722		
		88	A	41724		
		88	A	41726		
		88	A	41728		
		88	A	41730		
		88	A	41732		
		88	A	41734		
		88	A	41736		
		88	B		180652	
		88	B		180654	
		88	B		180656	
		88	B		180658	
		88	B		180660	
		88	B		180662	
		88	B		180664	
		88	B		180666	
		88	B		180668	
		88	B		180670	
		88	B		180672	
		88	B		180674	
		88	B		180676	
		88	B		180678	
		88	B		180702	
		88	B		180704	
		88	B		180706	
		88	B		180708	
		88	B		180710	
		88	B		180712	
		88	B		180714	
		88	B		180716	
		88	B		180718	
		88	B		180720	
		88	B		180722	
		88	B		180724	
		88	B		180726	
		88	B		180728	
		88	B		180752	
		88	B		180754	
		88	B		180756	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		88	B	180758	
		88	B	180760	
		88	B	180762	
		88	B	180764	
		88	B	180766	
		88	B	180768	
		88	B	180770	
		88	B	180772	
		88	B	180774	
		88	B	180776	
		88	B	180778	
		88	B	180802	
		88	B	180804	
		88	B	180806	
		88	B	180808	
		88	B	180810	
		88	B	180812	
		88	B	180814	
		88	B	180816	
		88	B	180818	
		88	B	180820	
		88	B	180822	
		88	B	180824	
		88	B	180826	
		88	B	180828	
		88	B	180852	
		88	B	180854	
		88	B	180856	
		88	B	180858	
		88	B	180860	
		88	B	180862	
		88	B	180864	
		88	B	180866	
		88	B	180868	
		88	B	180870	
		88	B	180872	
		88	B	180874	
		88	B	180876	
		88	B	180878	
		88	B	180902	
		88	B	180904	
		88	B	180906	
		88	B	180908	
		88	B	180910	
		88	B	180912	
		88	B	180914	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

88	B		180916
88	B		180918
88	B		180920
88	B		180922
88	B		180924
88	B		180926
88	B		180928
88	B		180952
88	B		180954
88	B		180956
88	B		180958
88	B		180960
88	B		180962
88	B		180964
88	B		180966
88	B		180968
88	B		180970
88	B		180972
88	B		180974
88	B		180976
88	B		180978
88	B		181002
88	B		181004
88	B		181006
88	B		181008
88	B		181010
88	B		181012
88	B		181014
88	B		181016
88	B		181018
88	B		181020
88	B		181022
88	B		181024
88	B		181026
88	B		181028

89 TCT_89 ERROR ID. 89 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE INTERÉS NOMINAL EN M.E. (PASIVO) RC04 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC18
89	A	44350	
89	A	44352	
89	A	44354	
89	A	44356	
89	A	44358	
89	A	44360	
89	A	44362	
89	A	44364	
89	A	44366	
89	A	44368	
89	A	44370	
89	A	44372	
89	A	44374	
89	A	44376	
89	A	44410	
89	A	44412	
89	A	44414	
89	A	44416	
89	A	44418	
89	A	44420	
89	A	44422	
89	A	44424	
89	A	44426	
89	A	44428	
89	A	44430	
89	A	44432	
89	A	44434	
89	A	44436	
89	A	45121	
89	A	45122	
89	A	45123	
89	A	45124	
89	A	45125	
89	A	45126	
89	A	45127	
89	A	45128	
89	A	45129	
89	A	45130	
89	A	45131	
89	A	45132	
89	A	45133	
89	A	45134	
89	A	44620	
89	A	44622	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		89	A	44624		
		89	A	44626		
		89	A	44628		
		89	A	44630		
		89	A	44632		
		89	A	44634		
		89	A	44636		
		89	A	44638		
		89	A	44640		
		89	A	44642		
		89	A	44644		
		89	A	44646		
		89	A	44680		
		89	A	44682		
		89	A	44684		
		89	A	44686		
		89	A	44688		
		89	A	44690		
		89	A	44692		
		89	A	44694		
		89	A	44696		
		89	A	44698		
		89	A	44700		
		89	A	44702		
		89	A	44704		
		89	A	44706		
		89	A	45196		
		89	A	45197		
		89	A	45198		
		89	A	45199		
		89	A	45200		
		89	A	45201		
		89	A	45202		
		89	A	45203		
		89	A	45204		
		89	A	45205		
		89	A	45206		
		89	A	45207		
		89	A	45208		
		89	A	45209		
		89	A	44800		
		89	A	44802		
		89	A	44804		
		89	A	44806		
		89	A	44808		
		89	A	44810		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		89	A	44812		
		89	A	44814		
		89	A	44816		
		89	A	44818		
		89	A	44820		
		89	A	44822		
		89	A	44824		
		89	A	44826		
		89	A	44890		
		89	A	44892		
		89	A	44894		
		89	A	44896		
		89	A	44898		
		89	A	44900		
		89	A	44902		
		89	A	44904		
		89	A	44906		
		89	A	44908		
		89	A	44910		
		89	A	44912		
		89	A	44914		
		89	A	44916		
		89	B		183652	
		89	B		183654	
		89	B		183656	
		89	B		183658	
		89	B		183660	
		89	B		183662	
		89	B		183664	
		89	B		183666	
		89	B		183668	
		89	B		183670	
		89	B		183672	
		89	B		183674	
		89	B		183676	
		89	B		183678	
		89	B		183702	
		89	B		183704	
		89	B		183706	
		89	B		183708	
		89	B		183710	
		89	B		183712	
		89	B		183714	
		89	B		183716	
		89	B		183718	
		89	B		183720	

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
	89	B		183722	
	89	B		183724	
	89	B		183726	
	89	B		183728	
	89	B		183752	
	89	B		183754	
	89	B		183756	
	89	B		183758	
	89	B		183760	
	89	B		183762	
	89	B		183764	
	89	B		183766	
	89	B		183768	
	89	B		183770	
	89	B		183772	
	89	B		183774	
	89	B		183776	
	89	B		183778	
	89	B		183802	
	89	B		183804	
	89	B		183806	
	89	B		183808	
	89	B		183810	
	89	B		183812	
	89	B		183814	
	89	B		183816	
	89	B		183818	
	89	B		183820	
	89	B		183822	
	89	B		183824	
	89	B		183826	
	89	B		183828	
	89	B		183852	
	89	B		183854	
	89	B		183856	
	89	B		183858	
	89	B		183860	
	89	B		183862	
	89	B		183864	
	89	B		183866	
	89	B		183868	
	89	B		183870	
	89	B		183872	
	89	B		183874	
	89	B		183876	
	89	B		183878	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		89	B		183902	
		89	B		183904	
		89	B		183906	
		89	B		183908	
		89	B		183910	
		89	B		183912	
		89	B		183914	
		89	B		183916	
		89	B		183918	
		89	B		183920	
		89	B		183922	
		89	B		183924	
		89	B		183926	
		89	B		183928	
		89	B		183952	
		89	B		183954	
		89	B		183956	
		89	B		183958	
		89	B		183960	
		89	B		183962	
		89	B		183964	
		89	B		183966	
		89	B		183968	
		89	B		183970	
		89	B		183972	
		89	B		183974	
		89	B		183976	
		89	B		183978	
		89	B		184002	
		89	B		184004	
		89	B		184006	
		89	B		184008	
		89	B		184010	
		89	B		184012	
		89	B		184014	
		89	B		184016	
		89	B		184018	
		89	B		184020	
		89	B		184022	
		89	B		184024	
		89	B		184026	
		89	B		184028	
90	TCT_90	ERROR ID. 90 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO (ACTIVO) RC05 VS RC18 ***Algoritmo*:**				Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC05	RC18
90	A	55008	
90	A	55009	
90	A	55011	
90	A	55021	
90	A	55022	
90	A	55024	
90	A	55034	
90	A	55035	
90	A	55037	
90	B		181102
90	B		181152
90	B		181202

91 TCT_91 ERROR ID. 91 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES CON ACCIONES, SOBRE ACCIONES Y ORO (PASIVO) RC05 VS RC18 Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC05	RC18
91	A	55059	
91	A	55060	
91	A	55062	
91	A	55072	
91	A	55073	
91	A	55075	
91	A	55085	
91	A	55086	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

91	A	55088	
91	B		184102
91	B		184152
91	B		184202

92 TCT_92

ERROR ID. 92 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE RENDIMIENTO REFERIDA AL S.M.G (ACTIVO) RC11 VS RC18

Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC11	RC18
92	A	111170	
92	A	111172	
92	A	111174	
92	A	111176	
92	A	111178	
92	A	111180	
92	A	111182	
92	A	111184	
92	A	111186	
92	A	111188	
92	A	111190	
92	A	111192	
92	A	111194	
92	A	111196	
92	B		181052
92	B		181054
92	B		181056
92	B		181058
92	B		181060
92	B		181062
92	B		181064
92	B		181066
92	B		181068
92	B		181070

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

92	B		181072
92	B		181074
92	B		181076
92	B		181078

93 TCT_93

ERROR ID. 93 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES TASA DE RENDIMIENTO REFERIDA AL S.M.G (PASIVO) RC11 VS RC18

Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC11	RC18
93	A	114290	
93	A	114292	
93	A	114294	
93	A	114296	
93	A	114298	
93	A	114300	
93	A	114302	
93	A	114304	
93	A	114306	
93	A	114308	
93	A	114310	
93	A	114312	
93	A	114314	
93	A	114316	
93	B		184052
93	B		184054
93	B		184056
93	B		184058
93	B		184060
93	B		184062
93	B		184064
93	B		184066
93	B		184068

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

93	B		184070
93	B		184072
93	B		184074
93	B		184076
93	B		184078

94 TCT_94 ERROR ID. 94 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES REFERIDO A MERCANCÍAS (ACTIVO) RC17 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC17	RC18
94	A	170006	
94	A	170007	
94	A	170014	
94	A	170015	
94	A	170021	
94	A	170022	
94	B		181252
94	B		181302

95 TCT_95 ERROR ID. 95 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS MERCADO, OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES REFERIDO A MERCANCÍAS (PASIVO) RC17 VS RC18 — Grave

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si ∑ A <>0	∑ B <>0

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC17	RC18

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		95	A	170032	
		95	A	170033	
		95	A	170040	
		95	A	170041	
		95	A	170047	
		95	A	170048	
		95	B		184252
		95	B		184302

Contenido

Tipo6. Mercado vs Crédito. Cartera de Créditos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
96	TCT_96	ERROR ID. 96 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO, CARTERA DE CRÉDITOS NETA RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC08, RC08A y RC15	No Grave

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025

***Algoritmo*:**

|A-(C-D)| <= 0.17 A
Con tolerancia de 17%

Dónde:

150380	FILTRO[Clase={10201,10204,10212,10205,10213, 10214,10101,10102,10104,15000, 115010,115020,105002,105003,105004, 105005,105006,105007,115030,115040, 115050,115060,115070,115080,115090, 115100,115110,115120}] sum [Importe]
150390	FILTRO[Clase={10201,10204,10212,10205,10213, 10214,15000,115010,115020,105002, 105003,105004,105005,105006,105007, 115030,115040,115050,115060,115070, 115080,115090,115100,115110,115120}] sum [Reserva]
800380	Sección RC08A. Sum [Importe]
800390	Sección RC08A. Sum (Reserva)

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC08	RC08A	RC15A

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		96	A	10150	30150	40150	110150	
		96	A	10152	30152	40152	110152	
		96	A	10154	30154	40154	110154	
		96	A	10156	30156	40156	110156	
		96	A	10158	30158	40158	110158	
		96	A	10160	30160	40160	110160	
		96	A	10162	30162	40162	110162	
		96	A	10164	30164	40164	110164	
		96	A	10166	30166	40166	110166	
		96	A	10168	30168	40168	110168	
		96	A	10170	30170	40170	110170	
		96	A	10172	30172	40172	110172	
		96	A	10174	30174	40174	110174	
		96	A	10176	30176	40176	110176	
		96	A	10180	30180	40180	110180	
		96	A	10181	30181	40181	110181	
		96	A	10182	30182	40182	110182	
		96	A	10183	30183	40183	110183	
		96	A	10184	30184	40184	110184	
		96	A	10185	30185	40185	110185	
		96	A	10186	30186	40186	110186	
		96	A	10187	30187	40187	110187	
		96	A	10188	30188	40188	110188	
		96	A	10189	30189	40189	110189	
		96	A	10190	30190	40190	110190	
		96	A	10191	30191	40191	110191	
		96	A	10192	30192	40192	110192	
		96	A	10193	30193	40193	110193	
		96	A	10050	30100	40050		
		96	A	10100	30102	40100		
		96	A	10102	30104	40102		
		96	A	10104	30106	40104		
		96	A	10106	30108	40106		
		96	A	10108	30110	40108		
		96	A	10110	30112	40110		
		96	A	10112	30114	40112		
		96	A	10114	30116	40114		
		96	A	10116	30118	40116		
		96	A	10118	30120	40118		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		96	A	10120	30122	40120			
		96	A	10122	30124	40122			
		96	A	10124	30126	40124			
		96	A	10126		40126			
		96	C				80001	80380 150380	
		96	C				80201		
		96	C				80301		
		96	C				80303		
		96	C				80403		
		96	C				80651		
		96	C				80901		
		96	C				81371		
		96	C				81381		
		96	C				81391		
		96	C				81402		
		96	C				82000		
		96	C				82002		
		96	C				82005		
		96	C				82010		
		96	C				82012		
		96	C				82015		
		96	C				83010		
		96	C				83012		
		96	C				83015		
		96	C				84210		
		96	C				84010		
		96	C				80714		
		96	C				81106		
		96	C				81214		
		96	C				85000		
		96	C				85070		
		96	C				85140		
		96	C				85240		
		96	C				85402		
		96	C				87002		
		96	C				87012		
		96	C				87627		
		96	C				87657		
		96	C				89000		

No. Validación	Nombre		Descripción/ Algoritmo	Nivel
	96	C	82026	
	96	C	82027	
	96	C	86000	
	96	C	86052	
	96	C	86055	
	96	C	86060	
	96	C	86062	
	96	C	86065	
	96	C	86012	
	96	C	86024	
	96	C	86036	
	96	C	86302	
	96	C	86305	
	96	C	86310	
	96	C	86312	
	96	C	86315	
	96	C	86515	
	96	C	86540	
	96	C	86570	
	96	C	86600	
	96	C	86645	
	96	C	86685	
	96	C	86730	
	96	C	86775	
	96	C	86820	
	96	C	86865	
	96	C	86880	
	96	C	82025	
	96	C	83027	
	96	C	83028	
	96	C	83029	
	96	C	83030	
	96	C	83031	
	96	C	83032	
	96	C	84275	
	96	C	84278	
	96	C	84283	
	96	C	84290	
	96	C	85309	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		96	C	85316	
		96	C	85323	
		96	C	85330	
		96	C	85337	
		96	C	85344	
		96	C	85351	
		96	C	85358	
		96	C	85412	
		96	C	85423	
		96	C	86106	
		96	C	86109	
		96	C	86118	
		96	C	86121	
		96	C	86126	
		96	C	86129	
		96	C	86132	
		96	C	86135	
		96	C	86137	
		96	C	86138	
		96	C	86141	
		96	C	86142	
		96	C	86921	
		96	C	86926	
		96	C	86936	
		96	C	86941	
		96	C	86946	
		96	C*	87024	
		96	C*	87025	
		96	C**	87029	
		96	C**	87030	
		96	C**	87031	
		96	C**	87032	
		96	C**	87033	
		96	C**		
		96	C	87026	
		96	C	87027	
		96	C	87028	
		96	C*	87638	
		96	C*	87639	
		96	C**	87059	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		96	C**	87060		
		96	C**	87061		
		96	C**	87062		
		96	C**	87063		
		96	C	87640		
		96	C	87641		
		96	C	87642		
		96	C	89158		
		96	C	89165		
		96	C	88024		
		96	C	88032		
		96	C	88039		
		96	C	88045		
		96	D	86003	80390 150390	
		96	D	86226		
		96	D	86227		
		96	D	86228		
		96	D	86229		
		96	D	86230		
		96	D	86231		
		96	D	86017		
		96	D	86027		
		96	D	86041		
		96	D	86466		
		96	D	86467		
		96	D	86468		
		96	D	86469		
		96	D	86470		
		96	D	86471		
		96	D	86526		
		96	D	86551		
		96	D	86581		
		96	D	86611		
		96	D	86656		
		96	D	86696		
		96	D	86741		
		96	D	86786		
		96	D	86831		
		96	D	86876		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre		Descripción/ Algoritmo		Nivel
	96	D	86891		
	96	D	81422		
	96	D	82633		
	96	D	82634		
	96	D	82632		
	96	D	82625		
	96	D	82626		
	96	D	82627		
	96	D	82628		
	96	D	82629		
	96	D	82630		
	96	D	83057		
	96	D	83058		
	96	D	83059		
	96	D	83627		
	96	D	83628		
	96	D	83060		
	96	D	83629		
	96	D	83061		
	96	D	83062		
	96	D	84273		
	96	D	84276		
	96	D	84279		
	96	D	84073		
	96	D	84288		
	96	D	84295		
	96	D	80737		
	96	D	81112		
	96	D	81222		
	96	D	85031		
	96	D	85314		
	96	D	85321		
	96	D	85101		
	96	D	85328		
	96	D	85335		
	96	D	85201		
	96	D	85342		
	96	D	85349		
	96	D	85271		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo			Nivel
		96	D	85356	
		96	D	85363	
		96	D	85407	
		96	D	85417	
		96	D	85428	
		96	D	86003	
		96	D	86107	
		96	D	86116	
		96	D	86119	
		96	D	86124	
		96	D	86127	
		96	D	86130	
		96	D	86133	
		96	D	86136	
		96	D	86226	
		96	D	86227	
		96	D	86228	
		96	D	86229	
		96	D	86230	
		96	D	86139	
		96	D	86140	
		96	D	86466	
		96	D	86467	
		96	D	86468	
		96	D	86469	
		96	D	86470	
		96	D	86143	
		96	D	86144	
		96	D	86924	
		96	D	86929	
		96	D	86939	
		96	D	86944	
		96	D	86949	
		96	D	87695	
		96	D*	87703	
		96	D*	87704	
		96	D**	87054	
		96	D**	87055	
		96	D**	87056	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo		Nivel
		96	D** 87057	
		96	D** 87058	
		96	D 87699	
		96	D 87705	
		96	D 87706	
		96	D 87707	
		96	D 88011	
		96	D* 88017	
		96	D* 88018	
		96	D** 87084	
		96	D** 87085	
		96	D** 87086	
		96	D** 87087	
		96	D** 87088	
		96	D 88014	
		96	D 88019	
		96	D 88020	
		96	D 88021	
		96	D 89061	
		96	D 89163	
		96	D 89170	
		96	D 88029	
		96	D 88037	
		96	D 88044	

Contenido

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Tipo7. Crédito vs Capital. Metodologías Internas

7.1 Reservas Admisibles bajo Metodología Interna

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
97	TCT_97	ERROR ID. 97 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO, RESERVAS ADMISIBLES BAJO METODOLOGÍA INTERNA RC14 VS RC09 (95290)	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

140002	Sección RC14. Sum (Importe17)

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09	RC14
97	A		140002
97	B	95290	
97	B	95704	

7.2 Pérdidas Esperadas bajo Metodología Interna

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
98	TCT_98	ERROR ID. 98 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO, PÉRDIDAS ESPERADAS BAJO METODOLOGÍA INTERNA RC14 VS RC09 (95295	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

140001	Sección RC14. Sum (Importe16)

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09	RC14
98	A		140001
98	B	95295	
98	B	95704	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

Tipo 8. Crédito vs Crédito. Garantías y Avales

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
99	TCT_99	ERROR ID. 99 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CRÉDITO VS CRÉDITO, GARANTÍAS A RECIBIR MÉTODO SIMPLE E INTEGRAL RC08 Y RC15 VS RC13 * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ***Algoritmo***: **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

150430	Sección RC15A FILTRO[Clase={10201,10204,10212,10205,10213 ,10214,15000,115010,115020,105002,105003 ,105004,105005,105006,105007,115030 ,115040,115050,115060,115070,115080 ,115090,115100,115110,115120 }] sum [Garantia]
80430	Sección RC008A Sum (Garantia_ME) + Sum [Garantia_MI]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC08	RC13	RC15	RC08A
99	A	82100		150430	80430
99	A	82102			
99	A	82105			
99	A	82110			
99	A	82113			
99	A	82117			
99	A	82124			
99	A	82125			
99	A	82126			
99	A	82200			
99	A	82202			
99	A	82205			
99	A	82210			
99	A	82212			
99	A	82215			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		99	A	82224				
		99	A	82225				
		99	A	82226				
		99	A	83033				
		99	A	83034				
		99	A	83035				
		99	A	83036				
		99	A	83037				
		99	A	83038				
		99	A	83039				
		99	A	83040				
		99	A	83041				
		99	A	83042				
		99	A	83043				
		99	A	83044				
		99	A	83110				
		99	A	83112				
		99	A	83115				
		99	A	83210				
		99	A	83212				
		99	A	83215				
		99	A	84020				
		99	A	84030				
		99	A	84284				
		99	A	84285				
		99	A	84291				
		99	A	84292				
		99	A	85005				
		99	A	85010				
		99	A	85075				
		99	A	85080				
		99	A	85150				
		99	A	85160				
		99	A	85245				
		99	A	85250				
		99	A	85310				
		99	A	85311				
		99	A	85317				
		99	A	85318				

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		99	A	85324				
		99	A	85325				
		99	A	85331				
		99	A	85332				
		99	A	85338				
		99	A	85339				
		99	A	85345				
		99	A	85346				
		99	A	85352				
		99	A	85353				
		99	A	85359				
		99	A	85360				
		99	A	85403				
		99	A	85404				
		99	A	85413				
		99	A	85414				
		99	A	85424				
		99	A	85425				
		99	A	87102				
		99	A	87112				
		99	A*	87123				
		99	A*	87124				
		99	A**	87034				
		99	A**	87035				
		99	A**	87036				
		99	A**	87037				
		99	A**	87038				
		99	A	87125				
		99	A	87126				
		99	A	87127				
		99	A	87202				
		99	A	87212				
		99	A*	87223				
		99	A*	87224				
		99	A**	87039				
		99	A**	87040				
		99	A**	87041				
		99	A**	87042				
		99	A**	87043				

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		99	A	87225				
		99	A	87226				
		99	A	87227				
		99	A	87682				
		99	A	87712				
		99	A*	87713				
		99	A*	87714				
		99	A**	87064				
		99	A**	87065				
		99	A**	87066				
		99	A**	87067				
		99	A**	87068				
		99	A	87715				
		99	A	87716				
		99	A	87717				
		99	A	87737				
		99	A*	87748				
		99	A*	87749				
		99	A**	87069				
		99	A**	87070				
		99	A**	87071				
		99	A**	87072				
		99	A**	87073				
		99	A	87750				
		99	A	87751				
		99	A	87752				
		99	A	87767				
		99	A	89010				
		99	A	89020				
		99	A	89159				
		99	A	89160				
		99	A	89166				
		99	A	89167				
		99	A	860000				
		99	A	860001				
		99	A	861060				
		99	A	861061				
		99	A	861090				
		99	A	861091				

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		99	A	860120				
		99	A	860121				
		99	A	861180				
		99	A	861181				
		99	A	861210				
		99	A	861211				
		99	A	860240				
		99	A	860241				
		99	A	861260				
		99	A	861261				
		99	A	861290				
		99	A	861291				
		99	A	860360				
		99	A	860361				
		99	A	861320				
		99	A	861321				
		99	A	861350				
		99	A	861351				
		99	A	861381				
		99	A	861382				
		99	A	861383				
		99	A	861384				
		99	A	861385				
		99	A	861386				
		99	A	861387				
		99	A	861389				
		99	A	861390				
		99	A	861391				
		99	A	861392				
		99	A	861393				
		99	A	861394				
		99	A	861395				
		99	A	861421				
		99	A	861422				
		99	A	861423				
		99	A	861424				
		99	A	861425				
		99	A	861426				
		99	A	861427				

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		99	A	861429				
		99	A	861430				
		99	A	861431				
		99	A	861432				
		99	A	861433				
		99	A	861434				
		99	A	861435				
		99	A	88025				
		99	A	88026				
		99	A	88033				
		99	A	88034				
		99	A	88040				
		99	A	88041				
		99	B		130010			
		99	B		130015			
		99	B		130020			
		99	B		130035			
		99	B		130040			
		99	B		130045			
		99	B		130060			
		99	B*		130065			
		99	B*		130070			
		99	B**		137111			
		99	B**		137112			
		99	B**		137113			
		99	B**		137114			
		99	B		130085			
		99	B		130090			
		99	B		130095			
		99	B		130100			
		99	B		130105			
		99	B		130125			
		99	B		130126			
		99	B		130140			
		99	B		130145			
		99	B		130150			
		99	B		130157			
		99	B		130160			
		99	B		130165			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		99	B		130170		
		99	B		130190		
		99	B		130200		
		99	B		130210		
		99	B		130215		
		99	B		130220		
		99	B		130225		
		99	B		130235		
		99	B		130240		
		99	B		130246		
		99	B		130250		
		99	B		130255		
		99	B		130260		
		99	B		130265		
		99	B		130270		

100 TCT_100 ERROR ID. 100 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CRÉDITO VS CRÉDITO, GARANTÍAS A RECIBIR MÉTODO SIMPLE E INTEGRAL RC06 Y RC15 VS RC13 — Grave

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

600320	FILTRO[Clase pertenece a la lista de valores …[10103, 10105, {10315 a 10403}, 10450, {104041 a 104043}, {104051 a 104455}, {104061 a 104065}, {104068 a 104072} , {104075 a 104079} , { 104082 a 104086} , { 104089 a 104099}] entonces sum [GarantiaMS + Garantía MI]
150435	FILTRO[Clase pertenece a la lista de valores …[10103, 10105, {10315 a 10403}, 10450, {104041 a 104043}, {104051 a 104455}, {104061 a 104065}, {104068 a 104072} , {104075 a 104079} , { 104082 a 104086} , { 104089 a 104099}] entonces sum [Garantia]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC06	RC13	RC15
100	A	600320		150430
100	B		130010	

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre			Descripción/ Algoritmo		Nivel
	100	B		130015		
	100	B		130020		
	100	B		130035		
	100	B		130040		
	100	B		130045		
	100	B		130060		
	100	B		130065		
	100	B		130070		
	100	B		130085		
	100	B		130090		
	100	B		130095		
	100	B		130100		
	100	B		130105		
	100	B		130125		
	100	B		130126		
	100	B		130140		
	100	B		130145		
	100	B		130150		
	100	B		130157		
	100	B		130160		
	100	B*		130165		
	100	B*		130170		
	100	B**		137111		
	100	B**		137112		
	100	B**		137113		
	100	B**		137114		
	100	B		130190		
	100	B		130200		
	100	B		130210		
	100	B		130215		
	100	B		130220		
	100	B		130225		
	100	B		130235		
	100	B		130240		
	100	B		130246		
	100	B		130250		
	100	B		130255		
	100	B		130260		
	100	B		130265		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

100	B		130270	

101 TCT_101

ERROR ID. 101 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CRÉDITO VS CRÉDITO, USO GARANTÍAS REALES CONTRA INDICADOR RELATIVO A LA AUTORIZACIÓN PARA RECONOCER COBERTURA DE RGO CRÉDITO RC06 , RC08, RC13 Y RC15 VS RC08 (89900)

No Grave

* Aplica hasta noviembre 2025
** Aplica a partir de diciembre 2025

***Algoritmo*:**

CONDICIÓN PREVIA	CONDICIÓN BASE
Si los conceptos del RC13 con valor en el campo OPERACIÓN = 426 o 427 , ∑ Importe 1 + ∑ Importe2 <>0	ENTONCES concepto 89900 =1000

Con tolerancia de 10%

Dónde:

600320	FILTRO[Clase pertenece a la lista de valores …[10103, 10105, {10315 a 10403}, 10450, {104041 a 104043}, {104051 a 104455}, {104061 a 104065}, {104068 a 104072} , {104075 a 104079} , { 104082 a 104086} , { 104089 a 104099}] entonces sum [GarantiaMS + Garantía MI]

150430	FILTRO[Clase={10201,10204,10212,10205,10213,10214}] sum [Garantia]

150435	FILTRO[Clase pertenece a la lista de valores …[10103, 10105, {10315 a 10403}, 10450, {104041 a 104043}, {104051 a 104455}, {104061 a 104065}, {104068 a 104072} , {104075 a 104079} , { 104082 a 104086} , { 104089 a 104099}] entonces sum [Garantia]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC06	RC08	RC13	RC15

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
	101	A	600320	82100		150430	
	101	A		82102		150435	
	101	A		82105			
	101	A		82110			
	101	A		82113			
	101	A		82117			
	101	A		82124			
	101	A		82125			
	101	A		82126			
	101	A		82200			
	101	A		82202			
	101	A		82205			
	101	A		82210			
	101	A		82212	130105		
	101	A		82215	130125		
	101	A		82224	130126		
	101	A		82225	130140		
	101	A		82226	130145		
	101	A		83033	130150		
	101	A		83034	130157		
	101	A		83035	130160		
	101	A*		83036	130165		
	101	A*		83037	130170		
	101	A**			137111		
	101	A**			137112		
	101	A**			137113		
	101	A**			137114		
	101	A		83038	130190		
	101	A		83039	130200		
	101	A		83040	130210		
	101	A		83041	130215		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
	101	A		83042	130220		
	101	A		83043	130225		
	101	A		83044	130235		
	101	A		83110	130240		
	101	A		83112	130246		
	101	A		83115	130250		
	101	A		83210	130255		
	101	A		83212	130260		
	101	A		83215	130265		
	101	A		84020	130270		
	101	A		84030			
	101	A		84284			
	101	A		84285			
	101	A		84291			
	101	A		84292			
	101	A		85005			
	101	A		85010			
	101	A		85075			
	101	A		85080			
	101	A		85150			
	101	A		85160			
	101	A		85245			
	101	A		85250			
	101	A		85310			
	101	A		85311			
	101	A		85317			
	101	A		85318			
	101	A		85324			
	101	A		85325			
	101	A		85331			
	101	A		85332			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre			Descripción/ Algoritmo			Nivel
	101	A		85338			
	101	A		85339			
	101	A		85345			
	101	A		85346			
	101	A		85352			
	101	A		85353			
	101	A		85359			
	101	A		85360			
	101	A		87102			
	101	A		87112			
	101	A*		87123			
	101	A*		87124			
	101	A**		87034			
	101	A**		87035			
	101	A**		87036			
	101	A**		87037			
	101	A**		87038			
	101	A		87125			
	101	A		87126			
	101	A		87127			
	101	A		87202			
	101	A		87212			
	101	A*		87223			
	101	A*		87224			
	101	A**		87039			
	101	A**		87040			
	101	A**		87041			
	101	A**		87042			
	101	A**		87043			
	101	A		87225			
	101	A		87226			

No. Validación	Nombre			Descripción/ Algoritmo			Nivel
	101	A		87227			
	101	A		87682			
	101	A		87712			
	101	A*		87713			
	101	A*		87714			
	101	A**		87064			
	101	A**		87065			
	101	A**		87066			
	101	A**		87067			
	101	A**		87068			
	101	A		87715			
	101	A		87716			
	101	A		87717			
	101	A		87737			
	101	A*		87748			
	101	A*		87749			
	101	A**		87069			
	101	A**		87070			
	101	A**		87071			
	101	A**		87072			
	101	A**		87073			
	101	A		87750			
	101	A		87751			
	101	A		87752			
	101	A		87767			
	101	A		89010			
	101	A		89020			
	101	A		89159			
	101	A		89160			
	101	A		89166			
	101	A		89167			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

	101	B		89900			

102	TCT_102	ERROR ID. 102 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CRÉDITO VS CRÉDITO, DERIVADOS Y AVALES RC08 Y RC15 VS RC13 * Aplica hasta noviembre 2025 ** Aplica a partir de diciembre 2025 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

800440	Sum (Aval) + Sum (Der_Cred)
150440	FILTRO[Clase={10201,10204,10212,10205,10213, 10214,115000,115010,115020,105002,105003,105004, 105005,105006,105007,115030,115040,115050,115060, 115070,115080,115090,115100,115110,115120}] sum [Aval]

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC08	RC13	RC15	RC08A
102	A	82400		150440	80440
102	A	82402			
102	A	82405			
102	A	82410			
102	A	82413			
102	A	82415			
102	A	83051			
102	A	83052			
102	A	83053			
102	A	83410			
102	A	83412			
102	A	83054			
102	A	83415			
102	A	83055			
102	A	83056			
102	A	84050			
102	A	84287			
102	A	85020			
102	A	85313			
102	A	85090			
102	A	85327			

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		102	A	85180				
		102	A	85341				
		102	A	85260				
		102	A	85355				
		102	A	86923				
		102	A	86928				
		102	A	87402				
		102	A*	87423				
		102	A*	87424				
		102	A**	87049				
		102	A**	87050				
		102	A**	87051				
		102	A**	87052				
		102	A**	87053				
		102	A	87412				
		102	A	87425				
		102	A	87426				
		102	A	87427				
		102	A	87847				
		102	A*	87858				
		102	A*	87859				
		102	A**	87079				
		102	A**	87080				
		102	A**	87081				
		102	A**	87082				
		102	A**	87083				
		102	A	87877				
		102	A	87860				
		102	A	87861				
		102	A	87862				
		102	A	89040				
		102	A	89162				
		102	A	82300				
		102	A	82301				
		102	A	82305				
		102	A	82310				
		102	A	82312				
		102	A	82315				
		102	A	82325				

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		102	A	82326				
		102	A	83045				
		102	A	83046				
		102	A	83047				
		102	A	83310				
		102	A	83312				
		102	A	83048				
		102	A	83315				
		102	A	83049				
		102	A	83050				
		102	A	84040				
		102	A	85015				
		102	A	85085				
		102	A	85170				
		102	A	85255				
		102	A	87302				
		102	A*	87323				
		102	A*	87324				
		102	A**	87044				
		102	A**	87045				
		102	A**	87046				
		102	A**	87047				
		102	A**	87048				
		102	A	87312				
		102	A	87325				
		102	A	87326				
		102	A	87327				
		102	A	87792				
		102	A*	87803				
		102	A*	87804				
		102	A**	87074				
		102	A**	87075				
		102	A**	87076				
		102	A**	87077				
		102	A**	87078				
		102	A	87822				
		102	A	87805				
		102	A	87806				
		102	A	87807				

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		102	A	89030				
		102	A	89161				
		102	A	89168				
		102	A	84286				
		102	A	84293				
		102	A	85312				
		102	A	85319				
		102	A	85326				
		102	A	85333				
		102	A	85340				
		102	A	85347				
		102	A	85354				
		102	A	85361				
		102	A	85405				
		102	A	85415				
		102	A	85426				
		102	A	86922				
		102	A	86927				
		102	A	82324				
		102	A	82424				
		102	A	82425				
		102	A	82426				
		102	A	84294				
		102	A	85320				
		102	A	85334				
		102	A	85348				
		102	A	85362				
		102	A	89169				
		102	A	860002				
		102	A	860003				
		102	A	861062				
		102	A	861063				
		102	A	861092				
		102	A	861093				
		102	A	860122				
		102	A	860123				
		102	A	861182				
		102	A	861183				
		102	A	861212				

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		102	A	861213				
		102	A	860242				
		102	A	860243				
		102	A	861262				
		102	A	861263				
		102	A	861292				
		102	A	861293				
		102	A	860362				
		102	A	860363				
		102	A	861322				
		102	A	861323				
		102	A	861352				
		102	A	861353				
		102	A	861397				
		102	A	861398				
		102	A	861399				
		102	A	861400				
		102	A	861401				
		102	A	861402				
		102	A	861403				
		102	A	861405				
		102	A	861406				
		102	A	861407				
		102	A	861408				
		102	A	861409				
		102	A	861410				
		102	A	861411				
		102	A	861437				
		102	A	861438				
		102	A	861439				
		102	A	861440				
		102	A	861441				
		102	A	861442				
		102	A	861443				
		102	A	861445				
		102	A	861446				
		102	A	861447				
		102	A	861448				
		102	A	861449				

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		102	A	861450				
		102	A	861451				
		102	A	88028				
		102	A	88036				
		102	A	88043				
		102	A	88027				
		102	A	88035				
		102	A	88042				
		102	B		131005			
		102	B		131010			
		102	B		131015			
		102	B		131020			
		102	B		131025			
		102	B		132005			
		102	B		132010			
		102	B		132015			
		102	B		132017			
		102	B		132019			
		102	B		132020			
		102	B		132022			
		102	B		132025			
		102	B		132030			
		102	B		133005			
		102	B		133007			
		102	B		133015			
		102	B		133017			
		102	B		133020			
		102	B		133022			
		102	B		133025			
		102	B		133026			
		102	B		133027			
		102	B		133028			
		102	B		133030			
		102	B		134010			
		102	B		134015			
		102	B		134020			
		102	B		137005			
		102	B		137010			
		102	B		131030			

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		102	B		131035		
		102	B		131040		
		102	B		131105		
		102	B		131110		
		102	B		131115		
		102	B		131120		
		102	B		132105		
		102	B		132110		
		102	B		132115		
		102	B		132117		
		102	B		132118		
		102	B		132120		
		102	B		132122		
		102	B		132125		
		102	B		132130		
		102	B		133105		
		102	B		133107		
		102	B		133115		
		102	B		133117		
		102	B		133120		
		102	B		133125		
		102	B		133127		
		102	B		133128		
		102	B		133129		
		102	B		133135		
		102	B		134110		
		102	B		134115		
		102	B		137105		
		102	B		137110		
		102	B		132032		
		102	B		132033		

Etapa: Validaciones Posteriores al Cálculo

i. Objetivo de la validación

Verificar el cumplimiento de las reglas establecidas en la normatividad que fundamenta el formulario RCs.

La validación se lleva a cabo revisando los importes de algunos conceptos en particular reportados por los intermediarios/intermediarias contra el cálculo obtenido en el Banco de México.

ii. Validaciones por sección.

A continuación, se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC08A RELATIVO A RIESGO DE CRÉDITO DE CARTERA DE CONSUMO, VIVIENDA Y A MIPYMES

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
31		Valida que el Requerimiento de Capital por riesgo de crédito con la metodología anterior no puede ser menor al Requerimiento de Capital por riesgo de crédito actual. (RC08A-FCC). ***Algoritmo***: **A < B** **Dónde** *A* = 110424 = Requerimiento total de créditos bajo FCC* *B*= 110541 = Requerimiento total de créditos sin considerar FCC* **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
32		Valida que el Requerimiento de Capital por riesgo de crédito con la metodología anterior no puede ser menor al Requerimiento de Capital por riesgo de crédito actual. (RC08A-Nuevos ponderadores) ***Algoritmo***: **A < B** **Dónde** *A = 110803 = Requerimiento total de créditos art 2 bis 17 reforma* *B = 110832 = Requerimiento total de créditos art 2 bis 17 regulación anterior* **Cálculo Banco de México conforme CUB*	

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel

RC09 RELATIVO A LA DETERMINACIÓN DEL CAPITAL NETO Contenido

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
1	Obligaciones Subordinadas	Valida el concepto "Monto máximo permitido de Obligaciones Subordinadas e Instrumentos de capital emitidos con anterioridad al 31 de diciembre de 2012 que computan como Capital Básico 2 " reportado en el RC09. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95550=106065** **Cálculo Banco de México conforme CUB* *Aplica hasta diciembre 2021*	Grave
2	Obligaciones Subordinadas	Valida el concepto "Monto máximo permitido de Obligaciones Subordinadas e Instrumentos de capital emitidos con anterioridad al 31 de diciembre de 2012 que computan como Capital Complementario " reportado en el RC09. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95555=106066** **Cálculo Banco de México conforme CUB* *Aplica hasta diciembre 2021*	Grave
3	Capital Fundamental	Valida el concepto "Capital Fundamental " reportado en el RC09. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95671=106053** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
4	Capital Básico no Fundamental	Valida el concepto "Capital Básico no fundamental" reportado en el RC09. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95673=106055**	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td></td></tr>
<tr><td>5</td><td>Capital Complementario</td><td>Valida el concepto "Capital Complementario" reportado en el RC09.
Algoritmo:
|A-B|<= 1
Con tolerancia de 1
95640=106057*
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>6</td><td>Capital Neto</td><td>Valida el concepto "Capital Neto" reportado en el RC09.

Algoritmo:
|A-B|<= 1
Con tolerancia de 1
95655=106273*
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>7</td><td>Índice de capitalización</td><td>Valida el concepto "Índice de Capitalización (considerando el Capital Neto Reconocido) " reportado en el RC09.
Algoritmo:
|A-B| = 0
Sin tolerancia
95661=100834*
*Cálculo Banco de México de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>9</td><td>Capital Básico</td><td>Valida el concepto "Capital Básico " reportado en el RC09.
.
Algoritmo:
|A-B| <= 1
Con tolerancia de 1
95677=106272*
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>10</td><td>Obligaciones Subordinadas</td><td>Valida el concepto "Monto máximo permitido de Obligaciones Subordinadas e Instrumentos de capital emitidos con anterioridad al 31 de diciembre de 2012 que computan como Capital Básico 2 y Complementario" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico.
Algoritmo:
|A-B| <= 1
Con tolerancia de 1
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>10</td><td>A</td><td>95555</td></tr><tr><td>10</td><td>B</td><td>106065*</td></tr><tr><td>10</td><td>B</td><td>106066*</td></tr></table>*Cálculo Banco de México de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>Aplica hasta diciembre 2021</td><td></td></tr>
<tr><td>11</td><td>Coeficiente de Capital Básico</td><td>Valida el concepto "Coeficiente de Capital Básico " reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico.
Algoritmo:
|A-B| = 0.5
Con tolerancia de 0.5
95674 = 100000 *
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>12</td><td>Coeficiente de Capital Fundamental</td><td>Valida el concepto "Coeficiente de Capital Fundamental" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico.
Algoritmo:
|A-B| = 0.5
Con tolerancia de 0.5
95675= 106164*
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>13</td><td>Impuestos diferidos activos</td><td>Valida el concepto Impuestos diferidos activos, exclusivamente la parte que no se resta del capital básico (84913).
Algoritmo:
|A-B| <= 1
Con tolerancia de 1
84913 = 109943 *
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>14</td><td>Capital Básico No Fundamental antes de Impuestos diferidos activos</td><td>Valida el concepto "Capital Básico No Fundamental" antes de instrumentos de capital bajo tratamiento transitorio, reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico
Algoritmo:
|A-B| <= 1
Con tolerancia de 1
<table><tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>ELEMENTO</th><th>CONCEPTO</th></tr><tr><td>14</td><td>A</td><td>95672</td></tr><tr><td>14</td><td>B</td><td>106055*</td></tr><tr><td>14</td><td>B</td><td>106122*</td></tr></table>*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>15</td><td>Capital Fundamental antes de Impuestos diferidos activos</td><td>Valida el concepto "Capital Fundamental" antes de Impuestos diferidos activos, reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico.
Algoritmo:
|A-B| <= 1
Con tolerancia de 1
95669 = 106161 *
*Cálculo Banco de México conforme CUB</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
16	Capital Fundamental antes de Personas Relacionadas Relevantes	Valida el concepto "Capital Fundamental" antes de Personas Relacionadas Relevantes, reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95670 = 106051** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
22	Capital Fundamental mínimo regulatorio	Valida el concepto Capital Fundamental mínimo regulatorio. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95678 = 110086 ** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
23	Capital Fundamental , suplemento de conservación de capital inciso a)	Valida el concepto Capital Fundamental, suplemento de conservación de capital inciso a) del artículo 2 bis 5. ***Algoritmo*:** **|A-B|<= 1** **Con tolerancia de 1** *95679 = 110087** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
24	Capital Fundamental , suplemento de conservación de capital inciso b)	Valida el concepto Capital Fundamental , suplemento de conservación de capital inciso b) del artículo 2 bis 5 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95680= 110088** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	No Grave
25	Capital Fundamental excedente	Valida el concepto Capital Fundamental excedente ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95681= 110089** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	No Grave
26	Capital Fundamental suplemento contra cíclico	Valida el concepto Capital Fundamental, suplemento contra cíclico inciso c) del artículo 2 bis 5. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *95684= 110092** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
27	Coeficiente de capital fundamental sin suplementos de capital.	Valida el concepto Coeficiente de capital fundamental sin suplementos de capital. ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *95682 = 110090** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave
28	Coeficiente de capital fundamental en exceso al mínimo y suplementos de capital	Valida el concepto Coeficiente de capital fundamental en exceso al mínimo y suplementos de capital. ***Algoritmo*:** **|A-B| = 0** **Sin tolerancia** *95683 = 110091** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave

RC15 SECCIÓN A, RELATIVO AL RIESGO DE CRÉDITO POR ACREDITADO/ACREDITADA, CONTRAPARTE Y ENTIDAD EMISORA DE PERSONAS RELACIONADAS (RELEVANTES Y NO RELEVANTES)

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
8	Personas Relacionadas relevantes	Valida que la suma del campo "ImporteRC3" Importe de la Exposición que se deduce del capital informado en la Sección RC15 sea igual al monto que se deduce del Capital Básico 1 de operaciones realizadas con personas relacionadas relevantes obtenido durante la determinación del Capital. ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 1** **Con tolerancia de 1** *104740=106052** **Cálculo Banco de México conforme CUB*	Grave

RC 21 RELATIVA A LOS INSTRUMENTOS DE CAPITAL ELEGIBLES PARA COMPUTAR EL CAPITAL NETO

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel

<table>
<tr>
<td>33</td>
<td>Obligaciones Subordinadas</td>
<td>Valida el concepto "Monto o importe en circulación de títulos en valor nominal expresado en moneda nacional reportados en el capital básico no fundamental y el capital complementario, de la sección RC21 sean consistentes con lo reportado en el RC09".

Algoritmo:

|A-B| <= 0.04*A

Con tolerancia de 4%
<table>
<tr><th>Elemento</th><th>Concepto</th><th>Coeficiente</th><th>Procedencia</th></tr>
<tr><td>A</td><td>SUM(MontCircPes) & Nivel_capital IN (2,3,4,5)</td><td>1</td><td>RC21</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95075</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95085</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95090</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95095</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95100</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95105</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
<tr><td>B</td><td>95110</td><td>-1</td><td>RC09</td></tr>
</table>
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>34</td>
<td>Obligaciones Subordinadas</td>
<td>Valida el concepto "Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales empleados para calcular el suplemento al capital neto, sean consistentes con los computados para el ICAP".
Algoritmo:

A-B = 0
<table>
<tr><th>Elemento</th><th>Concepto</th><th>Coeficiente</th><th>Procedencia</th></tr>
<tr><td>A</td><td>CADA REGISTRO DEL CAMPO (activos_ponderados)</td><td>1</td><td>RC21</td></tr>
<tr><td>B</td><td>109942=Activos convertidos y ponderados sujetos a riesgo totales *</td><td>-1</td><td>BANXICO</td></tr>
</table>
*Cálculo Banco de México conforme CUB
</td>
<td>Grave</td>
</tr>
<tr>
<td>35</td>
<td>Obligaciones Subordinadas</td>
<td>Valida el concepto "Monto computable en el capital básico no fundamental o complementario de la sección RC21 sean consistentes con los computados para el ICAP".</td>
<td>Grave</td>
</tr>
</table>

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

***Algoritmo*:**

A-B = 0

Elemento	Concepto	Coeficiente	Procedencia
A	SUM(Monto_capital) & Nivel_capital IN (2,3)	1	RC21
B	106132 =Instrumentos de capital 1-S que computaron en el complementario *	-1	BANXICO
B	106130= Instrumentos de capital 1-R que computaron en el básico no fundamental*	-1	BANXICO

**Cálculo Banco de México conforme CUB*

USO LIMITADO

Contenido

MATRIZ DE LAS PARTES QUE CONFORMAN CADA OPERACIÓN PARA EFECTO DEL CÓMPUTO DE CAPITALIZACIÓN

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Tenencia de valores:		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
Compra de valores (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		
- dinero a entregar	----------	en la fecha de liquidación de la compra
- valores a recibir:		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
Ventas de valores (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		
- dinero a recibir	en la fecha de liquidación de la venta	----------

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
- valores a entregar:		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)
Préstamo de valores, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		
- valores a recibir (por la operación fecha valor) :		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
- valores a entregar (por el préstamo) :		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)
Préstamo de valores, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
- valores a entregar (por la operación fecha valor) :		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)
- valores a recibir (por el préstamo)		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
Préstamo de valores actuando como prestamista		
- valores a recibir		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
		----------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Préstamo de valores actuando como prestatario		
- valores a entregar		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Reportos actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		
- dinero a entregar (por la operación fecha valor)	----------	en la fecha de liquidación del reporto
- valores a recibir (por la operación fecha valor) 1_/		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal) en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------
- dinero a recibir (por el reporto) con premio asociado a tasa fija	en la fecha de vencimiento del reporto	----------
tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa pactada o en la fecha de vencimiento del reporto, si ésta última fuera anterior a la primera	----------
- valores a entregar (por el reporto) 1_/		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa o en la fecha de vencimiento del título, si ésta última fuera anterior a la primera (para el registro del componente nominal) en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Reportos actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 hrs., pendientes de liquidar)		
- dinero a recibir (por la operación fecha valor)	en la fecha de liquidación del reporto	----------
- valores a entregar (por la operación fecha valor) 1_/		
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)
- dinero a entregar (por el reporto) con premio asociado a tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del reporto
tasa variable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa pactada o en la fecha de vencimiento del reporto, si ésta última fuera anterior a la primera
- valores a recibir (por el reporto) 1_/		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa o en la fecha de vencimiento del título, si ésta última fuera anterior a la primera (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Reportos actuando como reportador		
- dinero a recibir con premio asociado a		
tasa fija	en la fecha de vencimiento del reporto	----------
tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa pactada o en la fecha de vencimiento del reporto, si ésta última fuera anterior a la primera	
- valores a entregar 1_/		
con tasa fija	---------	en la fecha de vencimiento del título
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa o en la fecha de vencimiento del título, si ésta última fuera anterior a la primera (para el registro del componente nominal)
	----------	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)
Reportos actuando como reportado		
- valores a recibir 1_/		
con tasa fija	en la fecha de vencimiento del título	----------
con tasa ajustable	en la próxima fecha de ajuste de la tasa o en la fecha de vencimiento del título, si ésta última fuera anterior a la primera (para el registro del componente nominal)	----------
	en la fecha de vencimiento del título (para el registro del componente sobretasa)	----------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
- Dinero a entregar con premio asociado a		
tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del reporto
tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa pactada o en la fecha de vencimiento del reporto, si ésta última fuera anterior a la primera
Compra de "contratos adelantados sobre tasa de interés nominal" distintos a los paquetes a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB.		
- dinero a recibir 2_/	en la fecha de vencimiento de la operación más el plazo de la tasa de referencia	----------
- dinero a entregar	----------	en la fecha de vencimiento de la operación
Venta de "contratos adelantados sobre tasa de interés nominal" distintos a los paquetes a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB.		
- dinero a recibir	en la fecha de vencimiento de la operación	----------
- dinero a entregar 2_/	----------	en la fecha de vencimiento de la operación más el plazo de la tasa de referencia
Compra de "futuros sobre tasa de interés nominal" distintos a los paquetes a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB.		
- dinero a recibir 2_/	en la fecha de vencimiento del contrato más el plazo de la tasa de referencia	----------
- dinero a entregar	----------	en la fecha de vencimiento del contrato

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Venta de "futuros sobre tasa de interés nominal" distintos a los paquetes a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB. - dinero a recibir - dinero a entregar 2_/	en la fecha de vencimiento del contrato ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato más el plazo de la tasa de referencia
Compra de "paquetes de contratos adelantados sobre tasa de interés nominal" a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB. - dinero a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento del último contrato del paquete (el contrato con mayor fecha de vencimiento) ----------	---------- en la fecha de vencimiento del primer contrato del paquete (el contrato con menor fecha de vencimiento)
Venta de "paquetes de contratos adelantados sobre tasa de interés nominal" a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB. - dinero a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento del primer contrato del paquete (el contrato con menor fecha de vencimiento) ----------	---------- en la fecha de vencimiento del último contrato del paquete (el contrato con mayor fecha de vencimiento
Compra de "paquetes de futuros sobre tasa de interés nominal" a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB. - dinero a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento del último contrato del paquete (el contrato con mayor fecha de vencimiento) ----------	---------- en la fecha de vencimiento del primer contrato del paquete (el contrato con menor fecha de vencimiento)
Venta de "paquetes de futuros sobre tasa de interés nominal" a los que se refiere el tercer párrafo del inciso VII del artículo 2 BIS 100 de la CUB. - dinero a recibir	en la fecha de vencimiento del primer contrato del paquete (el contrato con menor fecha de vencimiento)	----------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
- dinero a entregar	----------	en la fecha de vencimiento del último contrato del paquete (el contrato con mayor fecha de vencimiento
Compra de "futuros sobre swaps referenciados a una tasa de interés nominal variable" - dinero a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento del contrato más el plazo del instrumento subyacente de referencia ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato
Venta de "futuros sobre swaps referenciados a una tasa de interés nominal variable" - dinero a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento del contrato ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato más el plazo del instrumento subyacente de referencia
Compra de "futuros sobre bonos referenciados a una tasa de interés nominal fija" - bono a recibir - dinero a entregar	el plazo residual o duración del bono "cheapest to delivery", incluido en la canasta de bonos entregables ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato
Venta de "futuros sobre bonos referenciados a una tasa de interés nominal fija" - bono a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento del contrato	el plazo residual o duración del bono "cheapest to delivery", incluido en la canasta de bonos entregables ----------
Compra de "contratos adelantados sobre bonos referenciados a una tasa de interés nominal fija" - bono a recibir	el plazo residual o duración del bono a tasa fija	---------- en la fecha de vencimiento de la operación

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
- dinero a entregar	----------	
Venta de "contratos adelantados de bonos referenciados a una tasa de interés nominal fija" - bono a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la operación	el plazo residual o duración del bono a tasa fija subyacente ----------
Compra de "contratos adelantados sobre Treasury Notes o Treasury Bonds" - Treasury a recibir - dinero a entregar	el plazo residual o duración del Treasury Note o Treasury Bond ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la operación
Venta de "contratos adelantados sobre Treasury Notes o Treasury Bonds" - Treasury a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento del contrato	el plazo residual o duración del Treasury Note o Treasury Bond ----------
Compra de "futuros sobre Treasury Notes o Treasury Bonds" - Treasury a recibir - dinero a entregar	el plazo residual o duración del Treasury "cheapest to delivery" de la canasta de entregables ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato
Venta de "futuros sobre Treasury Notes o Treasury Bonds" - Treasury a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento del contrato	el plazo residual o duración del Treasury "cheapest to delivery" de la canasta de entregables ----------
Compra de "contratos adelantados sobre subyacentes distintos a tasa de interés nominal, divisas y bonos" - dinero o subyacente a recibir - dinero a entregar	conforme al vencimiento de la operación y a las características del instrumento subyacente ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la operación

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Venta de "contratos adelantados sobre subyacentes distintos a tasa de interés nominal, divisas y bonos" - dinero o subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la operación	conforme al vencimiento de la operación y a las características del instrumento subyacente ---------
Compra de "futuros sobre subyacentes distintos a tasa de interés nominal, divisas y bonos" - dinero o subyacente a recibir - dinero a entregar	conforme al vencimiento del contrato y a las características del instrumento subyacente ----------	---------- en la fecha de vencimiento del contrato
Venta de "futuros sobre subyacentes distintos a una tasa de interés nominal, divisas y bonos" - dinero o subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento del contrato	conforme al vencimiento del contrato y a las características del instrumento subyacente ----------
Compra de "futuros sobre el nivel del INPC" - dinero a recibir, con rendimiento referido al INPC: - dinero a entregar, en M.N. a tasa nominal	en la fecha de vencimiento de la operación ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la operación
Venta de "futuros sobre el nivel del INPC" - dinero a recibir, en M.N. a tasa nominal - dinero a entregar, con rendimiento referido al INPC.	en la fecha de vencimiento de la operación ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la operación
Compra de "futuros de pesos" liquidables en dólares de los EE. UU. A. - pesos a recibir - dólares a entregar	en la "fecha de vencimiento" del contrato ----------	---------- en la "fecha de vencimiento" del contrato
Venta de "futuros de pesos" liquidables en dólares de los EE. UU. A. - dólares a recibir - pesos a entregar	en la "fecha de vencimiento" del contrato ----------	---------- en la "fecha de vencimiento" del contrato

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Compra de "compra venta de dólares a futuro" liquidables en pesos mexicanos - dólares a recibir - pesos a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento" de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento" de la operación
Venta de "compra venta de dólares a futuro" liquidables en pesos mexicanos - pesos a recibir - dólares a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación
Compra de "futuros y contratos adelantados de euros liquidables en pesos mexicanos" - euros a recibir - pesos a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento" de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento" de la operación
Venta de "futuros y contratos adelantados de euros liquidables en pesos mexicanos" - pesos a recibir - euros a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación
Compra de "futuros y contratos adelantados sobre divisas" (ninguna de las divisas son pesos mexicanos) - divisa a recibir - divisa a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación
Venta de "futuros y contratos adelantados sobre divisas" (ninguna de las divisas son pesos mexicanos) - divisa a recibir - divisa a entregar	en la "fecha de vencimiento" de la operación ---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación
Compra de "futuros y contratos adelantados sobre acciones, canastas de acciones e índices accionarios" - acción, canasta o índice a recibir - dinero a entregar	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo ---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación	---------- en la "fecha de vencimiento " de la operación

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Venta de "futuros y contratos adelantados sobre acciones, canastas de acciones e índices accionarios"		
- dinero a recibir	en la "fecha de vencimiento" de la operación	----------
- acción, canasta o índice a entregar	----------	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal fija y se entrega una tasa de interés nominal variable - flujos sobre una tasa nominal fija a Recibir - flujos sobre una tasa nominal variable a Entregar 2_/	en la fecha de vencimiento o duración de la operación ----------	---------- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal variable y se entrega una tasa de interés nominal fija - flujos sobre una tasa nominal variable a Recibir 2_/ - flujos sobre una tasa nominal fija a Entregar	en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia ----------	---------- en la fecha de vencimiento o duración de la operación
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal variable y se entrega una tasa de interés nominal variable - flujos sobre una tasa Variable a Recibir 2_/ - flujos sobre una tasa Variable a Entregar 2_/	en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia ----------	---------- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal fija y se entrega una tasa de interés nominal fija, importe de referencia denominado en distintas monedas - flujos sobre una Tasa Fija a Recibir - flujos sobre una Tasa Fija a Entregar	en la fecha de vencimiento o duración de la operación ----------	---------- en la fecha de vencimiento o duración de la operación
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés real fija y se entrega una tasa de interés real variable - flujos sobre una tasa real Fija a Recibir - flujos sobre una tasa real Variable a Entregar 2_/	en la fecha de vencimiento o duración de la operación ----------	---------- en la próxima fecha de ajuste de la tasa o índice de referencia
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se recibe una tasa de interés real variable y se entrega una tasa de interés real fija - flujos sobre una tasa real Variable a Recibir 2_/ - flujos sobre una tasa real Fija a Entregar	en la próxima fecha de ajuste de la tasa o índice de referencia ----------	---------- en la fecha de vencimiento o duración de la operación

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se reciben flujos calculados con base en Salarios Mínimos Generales y se entregan Flujos calculados en términos de UDIS - flujos calculados sobre S. M. G., a Recibir - flujos calculados en términos de UDIS, a Entregar	en la fecha de vencimiento o duración de la operación ----------	---------- en la fecha de vencimiento o duración de la operación
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se reciben flujos calculados en términos de UDIS y se entregan flujos calculados con base en Salarios Mínimos Generales - flujos calculados en términos de UDIS, a Recibir - flujos calculados sobre S. M. G., a Entregar	---------- en la fecha de vencimiento o duración de la operación	en la fecha de vencimiento o duración de la operación ----------
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se reciben flujos con base en un activo distinto a una tasa de interés nominal o real fija, tal como una acción, divisas o títulos de deuda a tasa fija y se entregan flujos con base en un activo con un rendimiento variable, pudiendo ser una tasa de interés nominal variable. - activo a Recibir - activo con rendimiento variable a Entregar 2_/	tratándose de una acción, para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo, para otro activo, en la fecha de vencimiento de la operación ----------	---------- en la próxima fecha de ajuste del activo con rendimiento variable de referencia
Operaciones de Intercambio de flujos y rendimientos (Swaps) en las que se entregan flujos con base en un activo distinto a una tasa de interés fija, como una acción, divisas o títulos de deuda a tasa fija y se recibe un activo con un rendimiento variable, pudiendo ser una tasa de interés nominal variable. - activo a Entregar - activo con rendimiento variable a Recibir 2_/	---------- en la próxima fecha de ajuste del activo con rendimiento variable de referencia	tratándose de una acción, para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo; para otro activo, en la fecha de vencimiento de la operación ----------
Tenencia de opciones de compra de tasas de interés tipo "CAP" a los que se refiere el tercer párrafo de la fracción VII del art 2 BIS 100 de la CUB (Ejercicio Europeo). - dinero a entregar - subyacente a recibir 2_/	--------- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia	en la fecha de vencimiento de la opción (la operación con mayor fecha de vencimiento) ---------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Tenencia de opciones de venta de tasas de interés tipo "FLOOR" a los que se refiere el tercer párrafo de la fracción VII del art 2 BIS 100 de la CUB (Ejercicio Europeo). - dinero a recibir - subyacente a entregar 2_/	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia
Emisión de opciones de compra de tasas de interés l tipo "CAP" a los que se refiere el tercer párrafo de la fracción VII del art 2 BIS 100 de la CUB (Ejercicio Europeo). - dinero a recibir - subyacente a entregar 2_/	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia
Emisión de opciones de venta de tasas de interés tipo "FLOOR" a los que se refiere el tercer párrafo de la fracción VII del art 2 BIS 100 de la CUB (Ejercicio Europeo). - dinero a entregar - subyacente a recibir 2_/	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia	en la fecha de vencimiento de la opción ---
Tenencia de opciones de compra de tasas de interés, distintas a las opciones de compra tipo "CAP" (Ejercicio Europeo). - dinero a entregar - subyacente a recibir 2_/	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia	en la fecha de vencimiento de la opción ---
Tenencia de opciones de venta de tasas de interés, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" (Ejercicio Europeo). - dinero a recibir - subyacente a entregar 2_/	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Emisión de opciones de compra de tasas de interés, distintas a las opciones de compra tipo "CAP" (Ejercicio Europeo). - dinero a recibir - subyacente a entregar 2_/	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia
Emisión de opciones de venta de tasas de interés, distintas a las opciones de venta tipo "FLOOR" (Ejercicio Europeo). - dinero a entregar - subyacente a recibir 2_/	--- en la próxima fecha de ajuste de la tasa de referencia	en la fecha de vencimiento de la opción ---
Tenencia de opciones de compra de divisas (Ejercicio Europeo). - subyacente a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la fecha de vencimiento de la opción
Tenencia de opciones de venta de divisas (Ejercicio Europeo). - subyacente a entregar - dinero a recibir	--- en la fecha de vencimiento de la opción	en la fecha de vencimiento de la opción ---
Emisión de opciones de compra de divisas (Ejercicio Europeo). - subyacente a entregar - dinero a recibir	--- en la fecha de vencimiento de la opción	en la fecha de vencimiento de la opción ---
Emisión de opciones de venta de divisas (Ejercicio Europeo). - subyacente a recibir - dinero a entregar	en la fecha de vencimiento de la opción ---	--- en la fecha de vencimiento de la opción

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Tenencia de opciones de compra de divisas (Ejercicio Americano). - subyacente a recibir - dinero a entregar	si la opción está "dentro del dinero", deberá registrarse en la primera banda (de 1 a 7 días); si la opción está "fuera del dinero", el plazo será a la fecha de vencimiento de la opción ---------- en la fecha de vencimiento de la opción	---------- en la fecha de vencimiento de la opción
Tenencia de opciones de venta de divisas (Ejercicio Americano). - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	si la opción está "dentro del dinero", deberá registrarse en la primera banda (de 1 a 7 días); si la opción está "fuera del dinero", el plazo será a la fecha de vencimiento de la opción ----------
Emisión de opciones de compra de divisas (Ejercicio Americano). - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	opción está "dentro del dinero", deberá registrarse en la primera banda (de 1 a 7 días); si la opción está "fuera del dinero", el plazo será a la fecha de vencimiento de la opción ----------
Emisión de opciones de venta de divisas (Ejercicio Americano). - subyacente a recibir - dinero a entregar	si la opción está "dentro del dinero", deberá registrarse en la primera banda (de 1 a 7 días); si la opción está "fuera del dinero", el plazo será a la fecha de vencimiento de la opción ---------- en la fecha de vencimiento de la opción	---------- en la fecha de vencimiento de la opción

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Tenencia de opciones o títulos opcionales (warrants) de compra sobre una acción, canasta de acciones o índices accionarios. - subyacente a recibir - dinero a entregar	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la opción
Tenencia de opciones o títulos opcionales (warrants) de venta sobre una acción, canasta de acciones o índices accionarios. - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo ----------
Emisión de opciones o títulos opcionales (warrants) de compra sobre una acción, canasta de acciones o índices accionarios. - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo ----------
Emisión de opciones o títulos opcionales (warrants) de venta sobre una acción, canasta de acciones o índices accionarios. - subyacente a recibir - dinero a entregar	para efectos de las reglas, no es necesario determinar un plazo ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la opción
Tenencia de opciones de compra de otros subyacentes distintos a tasa de interés, divisas, acciones o índices. - subyacente a recibir - dinero a entregar	conforme al vencimiento de la opción y a las características del instrumento subyacente ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la opción

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Tenencia de opciones de venta de otros subyacentes distintos a tasa de interés, divisas, acciones o índices. - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	conforme al vencimiento de la opción y a las características del instrumento subyacente ----------
Emisión de opciones de compra de otros subyacentes distintos a tasa de interés, divisas, acciones o índices. - subyacente a entregar - dinero a recibir	---------- en la fecha de vencimiento de la opción	conforme al vencimiento de la opción y a las características del instrumento subyacente ----------
Emisión de opciones de venta de otros subyacentes distintos a tasa de interés, divisas, acciones o índices. - subyacente a entregar - dinero a recibir	conforme al vencimiento de la opción y a las características del instrumento subyacente ----------	---------- en la fecha de vencimiento de la opción
Cartera de créditos con tasa fija con tasa ajustable	en la fecha de vencimiento del crédito en la próxima fecha de ajuste de la tasa	--------- ---------
Depósitos a la vista, efectuados por la institución en otros bancos	estos depósitos se clasifican en la banda 1	----------
Depósitos a plazo, efectuados por la institución en otros bancos con tasa fija con tasa ajustable	en la fecha de vencimiento del depósito en la próxima fecha de ajuste de la tasa	---------- ----------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
Depósitos a la vista, en M.N., sin interés y con tasa de interés no superior al 50% de la tasa CETE (recibidos por la institución)3	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 a 5
Depósitos a la vista, en M.N., con tasa de interés superior al 50% de la tasa CETE (recibidos por la institución)3	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 y 2
Depósitos de ahorro y en cuenta corriente, en M.N., con tasa de interés no superior al 50% de la tasa CETE (recibidos por la institución)3	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 a 5
Depósitos de ahorro y en cuenta corriente, en M.N., con tasa de interés superior al 50% de la tasa CETE (recibidos por la institución)3	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 y 2
Depósitos a la vista, en M.E. en cuentas de cheques sin interés (recibidos por la institución)	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 a 5
Otros depósitos a la vista en M.E., (recibidos por la institución)	----------	según la regla, se clasifican indistintamente en las bandas 1 o 2
Instrumentos de captación a plazo (recibidos por la institución) - a plazo con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del instrumento
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa
Préstamos y depósitos de bancos (recibidos por la institución) - a la vista	----------	estos depósitos se clasifican en la banda 1
- a plazo		

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
con tasa fija	----------	en la fecha de vencimiento del préstamo o depósito
con tasa ajustable	----------	en la próxima fecha de ajuste de la tasa
Otros financiamientos otorgados y demás operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés.	conforme a las características de la operación	---------
Otros financiamientos recibidos y demás operaciones pasivas que sean objeto de una tasa de interés	---------	conforme a las características de la operación
Títulos descontados con endoso (con responsabilidad, cuentas 6101 y 6102)	conforme a las características del crédito objeto de la operación de descuento	---------
Responsabilidades por endoso (cuentas 6401 y 6402)	---------	conforme a las características del financiamiento por medio de la operación de descuento
Operaciones estructuradas		
Parte relativa al contrato principal		
-Posición activa	conforme a las características de la operación	----------
-Posición pasiva	----------	conforme a las características de la operación
Parte relativa al instrumento derivado		
-Posición activa	conforme a las características de la operación derivada	----------

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

TIPO DE OPERACIONES Y PARTES DE LAS MISMAS	PLAZOS DE CADA UNA DE LAS PARTES DE LAS OPERACIONES (secciones RC01, RC04, RC04, RC11) En todos los casos el plazo inicia el día último del mes de que se trate (mes del reporte) y termina:	
	ACTIVO	PASIVO
-Posición pasiva	----------	conforme a las características de la operación derivada
Derivados de rendimiento total		
Derivado de incumplimiento crediticio	no computa para efectos de riesgo de mercado	no computa para efectos del riesgo de mercado
Intercambio de flujos de dinero (Swaps)		
-Flujo a recibir	conforme a las características de la parte activa del swap	----------
-Flujo a entregar	----------	conforme a las características de la parte pasiva del swap
Compra de protección crediticia con Títulos de Vinculación Crediticia		
-Emisión de títulos	----------	conforme a las características del titulo
-Derivado de incumplimiento crediticio	no computa para efectos de riesgo de mercado	no computa para efectos de riesgo de mercado
Venta de protección crediticia con Títulos de Vinculación Crediticia		
-Tenencia de títulos	conforme a las características del titulo	----------
-Derivado de incumplimiento crediticio	no computa para efectos de riesgo de mercado	no computa para efectos de riesgo de mercado

1_/ Esta parte de las operaciones NO aplica en operaciones de reporto celebradas (fuera de México) en países cuyas leyes y practicas establezcan que el "reporto" no transfiere la propiedad del título. Lo anterior supone que no existen partidas contables de acciones a recibir o entregar" por operaciones de reporto, y que el título permanece en la tenencia del reportado.

Uso Limitado

Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.

2_/ En este caso, se deberá considerar la fecha de ajuste (o determinación) de la tasa variable de referencia en el cálculo del flujo de que se trate, para saber si al vencimiento de la operación hay que agregar el plazo de dicha tasa variable de referencia o no. Es decir, hay flujos en los que el ajuste (o determinación) de la tasa variable de referencia se realiza cuando inicia el flujo mientras que en otros casos, el ajuste (o determinación) de la tasa variable de referencia se considera al finalizar del período del flujo. Cuando la tasa variable de referencia se determine al inicio del flujo, a la fecha de vencimiento de la operación no deberá agregarse el plazo de la tasa variable de referencia. Cuando la tasa variable de referencia se determine al final del flujo, a la fecha de vencimiento de la operación se deberá agregar el plazo de la tasa variable de referencia.

3_/ Adicionalmente los bancos podrán clasificar los depósitos indistintamente en las bandas 1 a 6 por un monto máximo, según corresponda, al resultado del grado de estabilidad que guarden los depósitos y de la sensibilidad de las tasas de interés pasivas respecto a las tasas de mercado de conformidad con la tabla indicada en el Anexo 1- A fracción 1.1 de la CUB.

Uso Limitado
Información cuyo acceso está restringido a un grupo limitado de personas empleadas por el Banco de México y, en su caso, personas ajenas al mismo.